

インデックスファンドTSP

(データは2009年9月30日現在)

[日興コード] 0905

[基準価額] 4,715円

[純資産総額] 227.03億円

[信託期間] 無期限

[決算日] 原則2月12日

[設定日] 1986年2月13日

<運用担当者のコメント>

運用概況

当ファンドはTOPIX(東証株価指数)に連動した投資成果をめざすファンドです。実際の運用は、「インデックスマザーファンド TOPIX」受益証券を高位に組入れ、株式先物を利用して実質株式組入比率を100%程度で推移させています。「インデックスマザーファンド TOPIX」では、「バラ 日本株式モデル」を使用して1,600銘柄程度に投資し、TOPIXへの連動性の高いポートフォリオを構築するとともに、株式先物を利用して実質の株式組入比率を100%程度で推移させています。

9月における当ファンドの基準価額は、TOPIXの5.79%の下落に対し、5.17%の下落となりました。乖離の主な原因は、株式配当金を取得したことによります。今後もこれまでの運用方針を継続し、TOPIXに連動した投資成果を目指します。

株式市況

月初965.73ポイントのTOPIXは、軟調な米国株式市場や円高傾向などが嫌気され、上旬に下落しました。その後、欧米株式市場やアジア株式市場の上昇につれて、TOPIXはやや持ち直しました。しかし月半ばには、円高による業績悪化懸念から輸出関連株が売られたほか、金融担当相の中小・零細企業などに対する返済猶予制度構想を受けて銀行株にも売りが広がり、TOPIXは再び軟調となりました。大型連休明け後、機関投資家などの買い戻しが入り、TOPIXは一時上昇しましたが、国内金融機関の増資観測や米国株式市場の軟化、さらに急激な円高進行など悪材料が重なり、急反落しました。月末にかけては、円高の一服から、TOPIXは若干値を戻し、909.84ポイントで月末を迎えました。

<資産構成比>

株式	100.0%
うち先物	3.0%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	3.0%
外貨建資産	0.0%

<国内株式組入上位5業種>

	業種	比率
1	電気機器	14.3%
2	輸送用機器	9.6%
3	銀行	9.2%
4	化学	6.0%
5	情報・通信	6.0%

<分配金実績(税引前)>(円)

05/02/14	06/02/13	07/02/13	08/02/12	09/02/12
40	60	80	40	40

<株式組入上位10銘柄>(銘柄数 1648銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.87%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行	2.35%
3	ホンダ	輸送用機器	1.99%
4	キヤノン	電気機器	1.78%
5	日本電信電話	情報・通信	1.59%
6	三井住友フィナンシャルグループ	銀行	1.42%
7	東京電力	電気・ガス	1.25%
8	パナソニック	電気機器	1.19%
9	ソニー	電気機器	1.19%
10	武田薬品工業	医薬品	1.16%

インデックスファンドでは、実質の株式組入比率を通常100%を目標に運用を行なっております。

追加設定や解約への売買対応により、株式組入比率は100%から乖離する場合があります。

「国内株式組入上位5業種」「株式組入上位10銘柄」はマザーファンドの状況です。

「資産構成比」「株式組入上位10銘柄」の比率は対純資産、

「国内株式組入上位5業種」の比率は対組入株式時価総額です。

「分配金実績」の分配金は、1万口当たりの実績です。

当レポート中の各数値は四捨五入して表示している場合があります。

当レポートのグラフ、数値等は過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

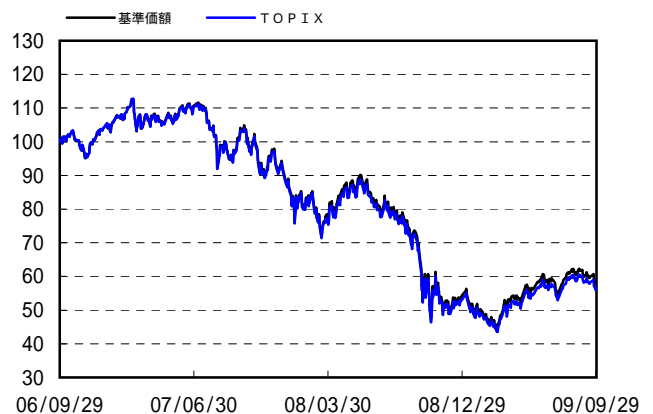
<分配金込み基準価額のパフォーマンス>

	3カ月	6カ月	1年	3年
当ファンド	-1.55%	18.08%	-15.21%	-41.48%
TOPIX	-2.14%	17.60%	-16.33%	-43.51%

基準価額の騰落率およびグラフのデータは分配金(税引前)を再投資し計算しています。

<分配金込み基準価額の指数化グラフ>

(2006年9月29日を100として指数化)



TOPIX(東証株価指数)に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。基準価額は、信託報酬(年率0.546%(税抜0.52%))控除後の値です。

投資信託は、値動きのある資産(外貨建資産は為替変動リスクもあります。)を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。後述のリスク情報とその他の留意事項をよくお読みください。

当資料は、日興アセットマネジメントが当ファンドの投資信託説明書(交付目論見書)を補足することなどを目的とし、投資家の皆様に当ファンドへのご理解を高めていただくために作成した販売用資料です。掲載されている見解は、当資料作成時点のものであり、将来の市場環境や運用成果などを保証するものではありません。

お申込みメモ

- 商品分類 : 追加型投信 / 国内 / 株式 / インデックス型
お申込単位 : お申込単位につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
お申込価額 : お申込受付日の基準価額
信託期間 : 無期限 (1986年2月13日設定)
決算日 : 毎年2月12日 (休業日の場合は翌営業日)
収益分配 : 毎決算時に、利子・配当等収益を中心に分配を行ないませんが、分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
ご換金価額 : 換金請求受付日の基準価額
ご換金代金のお支払い : 原則として、換金請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。
課税関係 : 原則として、分配時の普通分配金ならびに換金時および償還時の差益は課税の対象となります。課税上は、株式投資信託として取り扱われます。詳しくは、投資信託説明書 (交付目論見書) をご覧ください。

手数料等の概要

- お客様には、以下の費用をご負担いただきます。
- <お申込時、ご換金時にご負担いただく費用>
 - ・お申込手数料：お申込手数料率は、2.1% (税抜2.0%) を上限として販売会社が定める率とします。分配金再投資コースの場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、お申込手数料はかかりません。
 - ・換金手数料：ありません。
 - ・信託財産留保額：ありません。
 - <信託財産で間接的にご負担いただく (ファンドから支払われる) 費用>
 - ・信託報酬：純資産総額に対して年率0.546% (税抜0.52%) 以内を乗じて得た額
 - ・その他費用：組入有価証券の売買委託手数料、監査費用、借入金の利息、立替金の利息 など
- その他費用については、運用状況により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことが出来ません。当ファンドの手数料などの合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間などに応じて異なりますので、表示することができません。詳しくは、投資信託説明書 (交付目論見書) をご覧ください。

委託会社、その他関係法人

委託会社：日興アセットマネジメント株式会社

受託会社：中央三井アセット信託銀行株式会社 (再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

販売会社：販売会社については下記にお問い合わせください。

日興アセットマネジメント株式会社

〔ホームページ〕<http://www.nikkoam.com/>

〔コールセンター〕0120-25-1404 (午前9時～午後5時、半休日となる場合は午前9時～正午。土、日、祝・休日は除く。)

お申込みに際しての留意事項

リスク情報

- ・当ファンド (マザーファンドを含みます。) は、主に株式など値動きのある証券を投資対象としているため、基準価額は変動します。したがって、元金を割り込むことがあります。
- ・当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

【価格変動リスク】

一般に株式の価格は、国内および国外の経済・政治情勢などの影響を受け変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

【流動性リスク】

市場規模や取引量が少ない場合、組入銘柄を売却する際に市場実勢から期待される価格で売却できず、不測の損失を被るリスクがあります。

【信用リスク】

一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。

【指数との乖離リスク】

当ファンドの基準価額とT O P I X (東証株価指数) の動きの乖離は、主として株式の配当金、信託報酬の費用負担、組入銘柄の選定に伴う影響などにより生じます。

その他の留意事項

- ・当資料は、日興アセットマネジメントが「インデックスファンドTSP」の投資信託説明書 (交付目論見書) を補足することなどを目的とし、投資家の皆様に当ファンドへのご理解を高めていただくために作成した販売用資料です。
- ・投資信託は、預金や保険契約とは異なり、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、銀行など登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金の支払いの対象とはなりません。
- ・投資信託の運用による損益は、すべて受益者の皆様に帰属します。当ファンドをお申込みの際には、販売会社より、投資信託説明書 (交付目論見書) などをあらかじめ、または同時に お渡ししますので、必ず詳細をご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。

設定・運用は 日興アセットマネジメント株式会社
 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第368号
 加入協会：（社）投資信託協会
 （社）日本証券投資顧問業協会

お申込みは

金融商品取引業者等の名称		登録番号	加入協会		
			日本証券業協会	(社)日本証券投資顧問業協会	(社)金融先物取引業協会
株式会社伊予銀行	登録金融機関	四国財務局長（登金）第2号			
株式会社SBI証券	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第44号			
株式会社大垣共立銀行	登録金融機関	東海財務局長（登金）第3号			
株式会社沖縄銀行	登録金融機関	沖縄総合事務局長（登金）第1号			
かざか証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第58号			
株式会社神奈川銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第55号			
金十証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第59号			
株式会社関東つくば銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第44号			
株式会社京都銀行	登録金融機関	近畿財務局長（登金）第10号			
株式会社京葉銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第56号			
光世証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長（金商）第14号			
株式会社佐賀共栄銀行	登録金融機関	福岡財務支局長（登金）第10号			
株式会社四国銀行	登録金融機関	四国財務局長（登金）第3号			
シティバンク銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長（登金）第623号			
株式会社十六銀行	登録金融機関	東海財務局長（登金）第7号			
ソニー銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長（登金）第578号			
株式会社損害保険ジャパン	登録金融機関	関東財務局長（登金）第142号			
東海東京証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2134号			
東武証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第120号			
株式会社東邦銀行	登録金融機関	東北財務局長（登金）第7号			
株式会社東北銀行	登録金融機関	東北財務局長（登金）第8号			
東洋証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第121号			
株式会社徳島銀行	登録金融機関	四国財務局長（登金）第10号			
株式会社栃木銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第57号			
株式会社富山銀行	登録金融機関	北陸財務局長（登金）第1号			
株式会社富山第一銀行	登録金融機関	北陸財務局長（登金）第7号			
日興コーディアル証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2251号			
浜銀TT証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第1977号			
マネックス証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第165号			
丸三証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第167号			
三菱UFJ証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第179号			
株式会社みなと銀行	登録金融機関	近畿財務局長（登金）第22号			
明和證券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第185号			
株式会社もみじ銀行	登録金融機関	中国財務局長（登金）第12号			
株式会社八千代銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第53号			
株式会社山梨中央銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第41号			
ワイエム証券株式会社	金融商品取引業者	中国財務局長（金商）第8号			