

●インデックスファンドTSP

(データは2021年9月30日現在)

[日興コード] 0905

[基準価額] 10,706円

[純資産総額] 235.14億円

[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＞ ※運用方針等は作成基準日現在のものであり、将来の市場環境の変動等により変更される場合があります。

◎市場環境

9月の国内株式市場は、東証株価指数(TOPIX)が前月比プラス3.54%の上昇、日経平均株価が同プラス4.85%の上昇となりました。前半は、首相の退陣表明を受けて次期政権による経済対策が期待されたことや、国内において新型コロナウイルスワクチンの2回目の接種を完了した人が人口の5割を超え、また新規感染者数の減少が進むなどの背景から投資家のリスク回避姿勢が後退したことなどを受けて、国内株式市場は上昇しました。後半は、中国の不動産大手の経営悪化が中国経済全体に影響を及ぼすことへの警戒感や、米国長期金利の上昇への警戒感から米国株式が下落したことなどから、国内株式市場は下落しました。

東証33業種分類では、鉱業、空運業、保険業など28業種が上昇する一方で、鉄鋼、海運業、機械などの5業種が下落しました。

◎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、「バーラ 日本株式モデル」を使用して2,100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3.54%の上昇に対し、4.31%の上昇となりました。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。

＜資産構成比＞

株式	100.0%
うち先物	2.9%
CB	0.0%
公社債	0.0%
現金その他	2.9%
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	18.6%
2	情報・通信業	8.4%
3	輸送用機器	7.7%
4	化学	7.1%
5	サービス業	6.0%

※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ので、それを用いて計算すると誤差が生じることがあります。

※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ヵ月	6ヵ月	1年	3年
当ファンド	5.15%	4.64%	26.81%	17.78%
TOPIX	4.46%	3.90%	24.90%	11.72%

※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＞

(2018年9月28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(後述の「手数料等の概要」参照)控除後の値です。

＜分配金実績(税引前)＞(円)

17/02/13	18/02/13	19/02/12	20/02/12	21/02/12
100	120	120	140	180

＜株式組入上位10銘柄＞(銘柄数 2130銘柄)

	銘柄	業種	比率
1	トヨタ自動車	輸送用機器	3.61%
2	ソニーグループ	電気機器	2.78%
3	キーエンス	電気機器	2.35%
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.80%
5	リクルートホールディングス	サービス業	1.67%
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.58%
7	日本電信電話	情報・通信業	1.26%
8	信越化学工業	化学	1.22%
9	HOYA	精密機器	1.21%
10	日立製作所	電気機器	1.14%

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、投資者の皆様にご理解を深めていただくことを目的として、日興アセットマネジメントが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
購入単位	販売会社が定める単位 ※販売会社の照会先にお問い合わせください。
購入価額	購入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、市況動向など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。 ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
換金価額	換金申込受付日の基準価額
換金代金	原則として、換金申込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。 ※公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。 ※配当控除の適用があります。 ※益金不算入制度は適用されません。

■手数料等の概要

投資者の皆様には、以下の費用をご負担いただきます。

<申込時、換金時にご負担いただく費用>

購入時手数料 購入時の基準価額に対し2.2%（税抜2%）以内
※購入時手数料は販売会社が定めます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
※収益分配金の再投資により取得する口数については、購入時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>

運用管理費用 ファンドの日々の純資産総額に対し年率0.572%（税抜0.52%）以内
（信託報酬）

その他の費用・手数料 監査費用、組入有価証券の売買委託手数料、借入金の利息および立替金の利息などがその都度、信託財産から支払われます。
※運用状況などにより変動するものであり、事前に料率、上限額などを表示することはできません。

※投資者の皆様にご負担いただくファンドの費用などの合計額については、保有期間や運用の状況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	三井住友信託銀行株式会社
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〕 www.nikkoam.com/ 〔コールセンター〕 0120-25-1404（午前9時～午後5時。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

投資者の皆様は投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者（受益者）の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。

当ファンドは、主に株式を実質的な投資対象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。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状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

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。デフォルト（債務不履行）や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落（価格がゼロになることもあります。）し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

< T O P I X（東証株価指数）と基準価額の主な乖離要因 >

当ファンドは、基準価額の変動率を T O P I X（東証株価指数）の変動率に一致させることをめざしますが、次のような要因があるため、同指数と一致した推移をすることをお約束できるものではありません。

- ・ T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の変更や資本異動などによってポートフォリオの調整が行なわれる場合、個別銘柄の売買などにあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があること、また、信託報酬、売買委託手数料、監査費用などの費用をファンドが負担すること。
- ・ 組入銘柄の配当金や有価証券の貸付による品貸料が発生すること。
- ・ 先物取引等のデリバティブ取引を利用した場合、当該取引の値動きと T O P I X（東証株価指数）の採用銘柄の一部または全部の値動きが一致しないこと。

※ 基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

○その他の留意事項

- ・ 当資料は、投資者の皆様にご理解を高めることを目的として、日興アセットマネジメントが作成した販売用資料です。
- ・ 当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ・ 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。
- ・ 分配金は、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した運用収益を超えて支払われる場合があります。投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。
- ・ 投資信託の運用による損益は、すべて受益者の皆様にご帰属します。当ファンドをお申込みの際には、投資信託説明書（交付目論見書）などを販売会社よりお渡ししますので、内容を必ずご確認ください。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：一般社団法人投資信託協会
 一般社団法人日本投資顧問業協会

投資信託説明書(交付目論見書)のご請求・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	一般社団法人日本投資顧問業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会
アイザワ証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第3283号	○	○	
あかつき証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第67号	○	○	○
池田泉州T T証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長（金商）第370号	○		
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	○		○
エース証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長（金商）第6号	○		
a u カブコム証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第61号	○	○	○
株式会社SMB C信託銀行 ※右の他に一般社団法人投資信託協会にも加入	登録金融機関	関東財務局長（登金）第653号	○	○	○
SMB C日興証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2251号	○	○	○
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	○	○	
OKB証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長（金商）第191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	○		
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	○		
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	○	○	
株式会社きらぼし銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第53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	○		
四国アライアンス証券株式会社	金融商品取引業者	四国財務局長（金商）第21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	○		
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	○	○	○
株式会社筑波銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第44号	○		
東海東京証券株式会社	金融商品取引業者	東海財務局長（金商）第140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	○		
とうほう証券株式会社	金融商品取引業者	東北財務局長（金商）第36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	○		
株式会社徳島大正銀行	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	○		
株式会社トマト銀行	登録金融機関	中国財務局長（登金）第11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	○		
内藤証券株式会社	金融商品取引業者	近畿財務局長（金商）第24号	○		○
ばんせい証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第148号	○		
PayPay銀行株式会社	登録金融機関	関東財務局長（登金）第624号	○	○	
松井証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第164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モルガン・スタンレー証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第2336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	○	○	
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	○	○	
株式会社山梨中央銀行	登録金融機関	関東財務局長（登金）第41号	○		
山和証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第190号	○		
楽天証券株式会社	金融商品取引業者	関東財務局長（金商）第195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	○		

※上記販売会社情報は、作成時点の情報に基づいて作成しております。

※販売会社によっては取扱いを中止している場合がございます。