



NISSAY  
ASSET MANAGEMENT

# <購入・換金手数料なし> ニッセイ日経平均インデックスファンド

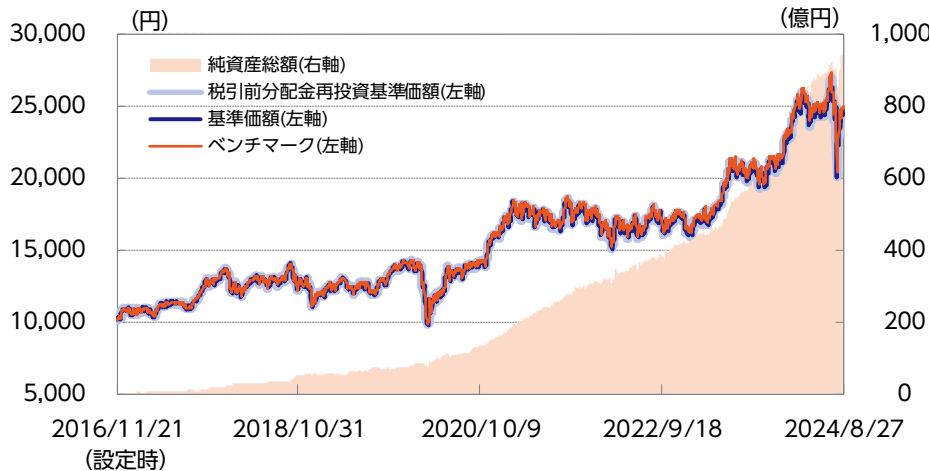
追加型投信／国内／株式／インデックス型

マンスリーレポート

2024年8月末現在

## 運用実績

### 基準価額・純資産の推移



### 基準価額および純資産総額

基準価額	24,656円
前月末比	-256円
純資産総額	946億円

### 基準価額の騰落率 (税引前分配金再投資)

	1カ月	3カ月	6カ月	1年	3年	設定来
ファンド	-1.0%	0.6%	-0.5%	20.6%	45.5%	146.6%
ベンチマーク (※1)	-1.1%	0.6%	-0.4%	20.7%	46.2%	149.9%
(ご参考) 日経225	-1.2%	0.4%	-1.3%	18.5%	37.6%	113.5%

### 分配の推移 (1万口当り、税引前)

第2期	2018年02月	0円
第3期	2019年02月	0円
第4期	2020年02月	0円
第5期	2021年02月	0円
第6期	2022年02月	0円
第7期	2023年02月	0円
第8期	2024年02月	0円
直近1年間累計		0円
設定来累計額		0円

※上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

※基準価額は信託報酬控除後のものです。税引前分配金再投資基準価額は分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。なお、信託報酬率は「手続・手数料等」の「ファンドの費用」をご覧ください。

※運用状況によっては、分配金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。分配金は信託財産から支払いますので、基準価額が下がる要因となります。収益分配金には普通分配金に対して所得税および地方税がかかります(個人受益者の場合)。

※ファンド騰落率は分配金(税引前)を再投資したものと計算しており、実際の投資家利回りと異なります。

※基準価額の前月末比は、決算日到来月に分配金支払実績がある場合、分配金込みで算出しています。

(※1)ベンチマークは配当込みの日経平均株価(日経225)の値動きを示す「日経平均トータルリターン・インデックス」としています。日経平均トータルリターン・インデックスは設定日の前営業日の終値を起点として指数化しています。なお、日経平均株価に関する著作権、知的所有権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は本商品を保証するものではなく、本商品について一切の責任を負いません。以下同じです。

マザーファンドの状況

組入上位10業種			組入上位10銘柄			組入比率	
	業種	比率		銘柄	比率	株式	100.0%
1	電気機器	25.7%	1	ファーストリテイリング	11.8%	うち現物	97.6%
2	小売業	14.5%	2	東京エレクトロン	6.5%	うち先物	2.4%
3	情報・通信業	10.6%	3	アドバンテスト	4.5%	※対純資産総額比	
4	医薬品	6.7%	4	ソフトバンクグループ	4.3%		
5	化学	6.6%	5	信越化学工業	2.7%		
6	機械	4.6%	6	TDK	2.5%		
7	サービス業	4.5%	7	KDDI	2.5%		
8	輸送用機器	4.1%	8	リクルートホールディングス	2.3%		
9	精密機器	3.8%	9	中外製薬	1.9%		
10	卸売業	3.2%	10	テルモ	1.8%		

※対組入株式評価額比

※対組入株式評価額比

当月の市況動向

当月の国内株式市場は下落しました。

上旬に米国の景気後退懸念と日銀の追加利上げ観測による急速な円高進行などから大幅下落となったものの、内田日銀副総裁のハト派（金融引き締めには慎重な姿勢）寄りの発言を受けて再び円安に向かうと、株価は月半ばにかけて値を戻し、月前半はボラティリティ（価格変動性）の高い相場展開となりました。その後はジャクソンホール会議でパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長が近く利下げに踏み切る姿勢を示したことを受け、再び円高に振れたことで国内株は上値の重い展開となりました。日経平均株価の月末終値は38,647.75円（前月末比-454.07円）となりました。

東証株価指数（TOPIX）の月末終値は2,712.63ポイント（前月末比-81.63ポイント）、JPX日経インデックス400の月末終値は24,868.22ポイント（前月末比-734.41ポイント）となりました。

業種別では海運業、精密機器、小売業、医薬品、非鉄金属などが上昇しましたが、銀行業、証券、商品先物取引業、金属製品、保険業、ゴム製品などが下落しました。

主な株式指標の騰落率は、日経平均株価が-1.2%、TOPIXが-2.9%、JPX日経インデックス400が-2.9%となりました。

## ファンドの特色

- ①「日経平均株価（日経225）」（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざします。
  - 配当込みの日経平均株価（日経225）の値動きを示す「日経平均トータルリターン・インデックス」の動きに連動する投資成果をめざし、原則として、同指数に採用されている銘柄のなかから200銘柄以上に等株数投資を行います。
  - 日経平均株価（日経225）は、東証プライム市場銘柄のうち代表的な225銘柄の平均株価指数で、株式会社日本経済新聞社より算出・公表されています。当指数は、国内の株式市場の動向を継続的に捉える代表的な指数として、広く利用されています。
  - ※「日経平均株価（日経225）」および「日経平均トータルリターン・インデックス」（以下「各指数」といいます）は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、各指数自体および各指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有していません。
- ②購入時および換金時の手数料は無料です。

## 投資リスク

※ご購入に際しては、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みください。

### 基準価額の変動要因

- ファンド（マザーファンドを含みます）は、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。また、「日経平均株価（日経225）」（配当込み）の動きに連動することを目標に運用しますので、「日経平均株価（日経225）」（配当込み）の動きにより基準価額は変動します。したがって、投資元本を割込むことがあります。
- ファンドは、預貯金とは異なり、投資元本および利回りの保証はありません。運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなりますので、ファンドのリスクを十分にご認識ください。**

### 主な変動要因

株式投資リスク	株式は国内および国際的な景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け、また業績悪化（倒産に至る場合も含む）等により、価格が下落することがあります。
流動性リスク	市場規模が小さいまたは取引量が少ない場合、市場実勢から予期される時期または価格で取引が行えず、損失を被る可能性があります。

❗ 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。

## その他の留意点

### 分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの信託財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収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 受益者のファンドの購入価額によっては、支払われる分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
- ファンドは、多量の換金の申込みが発生し換金代金を短期間で手当てする必要性が生じた場合や組入資産の主たる取引市場において市場環境が急変した場合等には、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引ができないリスク、取引量が限定されるリスク等が顕在します。  
これらにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金の申込みの受け付けを中止する、また既に受け付けた換金の申込みの受け付けを取消しする可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

手続・手数料等

※基準価額は便宜上1万円当りに換算した価額で表示されます。

お申込みメモ

購入時	購入単位	販売会社が定める単位とします。
	購入価額	購入申込受付日の基準価額とします。
換金時	換金価額	換金申込受付日の基準価額とします。
	換金代金	換金申込受付日から起算して、原則として5営業日目からお支払いします。
申込について	申込締切時間	原則として毎営業日の午後3時までに販売会社の手続きが完了したものを当日受付分とします。 ※申込締切時間は2024年11月5日から「午後3時30分」までとする予定です。ただし、申込締切時間は販売会社によって異なる場合があります。
決算・分配	決算日	2月15日（該当日が休業日の場合は翌営業日）
	収益分配	年1回の毎決算日に、収益分配方針に基づき収益分配を行います。
その他	信託期間	無期限（設定日：2016年11月21日）
	繰上償還	委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の手続きを経て、ファンドを繰上償還させることがあります。
	課税関係	課税上は株式投資信託として取扱われます。 配当控除の適用があります。なお、益金不算入制度の適用はありません。 公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の対象となり、当ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象となります。ただし、販売会社により取扱いが異なる場合があります。 詳しくは、販売会社にお問合せください。

❗ ご購入に際しては、投資信託説明書（交付目論見書）の内容を十分にお読みください。

ファンドの費用

投資者が直接的に負担する費用

購入時	購入時手数料	ありません。
換金時	換金時手数料	ありません。
換金時	信託財産留保額	ありません。

投資者が信託財産で間接的に負担する費用

毎日	運用管理費用 (信託報酬)	ファンドの純資産総額に <b>年率0.143% (税抜0.13%)</b> 以内の率をかけた額とし、ファンドからご負担いただけます。
	監査費用	ファンドの純資産総額に年率0.0011% (税抜0.001%) をかけた額とし、ファンドからご負担いただけます。
随時	その他の費用・ 手数料	組入有価証券の売買委託手数料、信託事務の諸費用および借入金の利息等はファンドからご負担いただけます。これらの費用は運用状況等により変動するため、事前に料率・上限額等を記載することはできません。

- ❗ 当該費用の合計額、その上限額および計算方法は、運用状況および受益者の保有期間等により異なるため、事前に記載することはできません。
- ❗ 詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

税金

分配時の普通分配金、換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対して、所得税および地方税がかかります。詳しくは、投資信託説明書（交付目論見書）をご覧ください。

- ・少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」は少額上場株式等に関する非課税制度であり、NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たしたファンドを購入するなど、一定の条件に該当する方となります。詳しくは、販売会社にお問合せください。
- ・外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が投資信託説明書（交付目論見書）の記載と異なる場合があります。
- ・法人の場合は上記とは異なります。
- ・確定拠出年金法に基づく運用として購入する加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用され、またNISAおよび外国税額控除の適用対象外です。
- ・税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

委託会社【ファンドの運用の指図を行います】	ファンドに関するお問合せ先
ニッセイアセットマネジメント株式会社 金融商品取引業者登録番号 関東財務局長（金商）第369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	ニッセイアセットマネジメント株式会社 コールセンター 0120-762-506 9:00~17:00（土日祝日・年末年始を除く）
受託会社【ファンドの財産の保管および管理を行います】	ホームページ <a href="https://www.nam.co.jp/">https://www.nam.co.jp/</a>
三菱UFJ信託銀行株式会社	

ご留意いただきたい事項

- ①投資信託はリスクを含む商品であり、運用実績は市場環境等により変動し、運用成果（損益）はすべて投資者の皆様のものとなります。投資元本および利回りが保証された商品ではありません。
- ②当資料はニッセイアセットマネジメントが作成したものです。ご購入に際しては、販売会社よりお渡しする投資信託説明書（交付目論見書）、契約締結前交付書面等（目論見書補完書面を含む）の内容を十分にお読みになり、ご自身でご判断ください。
- ③投資信託は、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、登録金融機関で購入された場合、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。
- ④投資信託のお取引に関しては、クーリング・オフ（金融商品取引法第37条の6の規定）の適用はありません。
- ⑤当資料のいかなる内容も将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。また、資金動向、市況動向等によっては方針通りの運用ができない場合があります。
- ⑥当資料は、信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保証するものではありません。
- ⑦当資料のグラフ・数値等はあくまでも過去の実績であり、将来の投資収益を示唆あるいは保証するものではありません。また税金・手数料等を考慮しておりませんので、実質的な投資成果を示すものではありません。
- ⑧当資料にインデックス・統計資料等が記載される場合、それらの知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。
- ⑨当資料の内容は原則作成基準日現在のものであり、将来予告なく変更されることがあります。

取扱販売会社一覧

※販売会社は今後変更となる場合があります。また、販売会社によっては、新規のお申込みを停止している場合があります。詳しくは、販売会社または委託会社の照会先までお問合せください。

取扱販売会社名	金融商品取引業者	登録金融機関	登録番号	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	取扱販売会社名	金融商品取引業者	登録金融機関	登録番号	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
岩井コスモ証券株式会社	○		近畿財務局長(金商)第15号	○	○	○		株式会社イオン銀行 (委託金融商品取引業者 マネックス証券株式会社)	○		関東財務局長(登金)第633号	○			
auカブコム証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第61号	○	○	○	○	株式会社SBI新生銀行 (委託金融商品取引業者 株式会社SBI証券)	○		関東財務局長(登金)第10号	○		○	
SMB C日興証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第2251号	○	○	○	○	株式会社SBI新生銀行 (委託金融商品取引業者 マネックス証券株式会社)	○		関東財務局長(登金)第10号	○		○	
株式会社SBI証券	○		関東財務局長(金商)第44号	○		○	○	ソニー銀行株式会社	○		関東財務局長(登金)第578号	○		○	○
岡三証券株式会社(※1)	○		関東財務局長(金商)第53号	○	○	○	○	株式会社大光銀行	○		関東財務局長(登金)第61号	○			
香川証券株式会社	○		四国財務局長(金商)第3号	○				株式会社千葉銀行(※2)	○		関東財務局長(登金)第39号	○		○	
光世証券株式会社	○		近畿財務局長(金商)第14号	○				PayPay銀行株式会社	○		関東財務局長(登金)第624号	○		○	
Jトラストグローバル証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第35号	○				株式会社三菱UFJ銀行(※2)	○		関東財務局長(登金)第5号	○		○	○
東海東京証券株式会社(※3)	○		東海財務局長(金商)第140号	○	○	○	○	足利小山信用金庫	○		関東財務局長(登金)第217号				
PWM日本証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第50号	○				西尾信用金庫	○		東海財務局長(登金)第58号	○			
ほくほくTT証券株式会社	○		北陸財務局長(金商)第24号	○				ニッセイアセットマネジメント株式会社(※4)	○		関東財務局長(金商)第369号	○			
松井証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第164号	○		○									
マネックス証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第165号	○	○	○	○								
mo o m o o証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第3335号	○	○										
楽天証券株式会社	○		関東財務局長(金商)第195号	○	○	○	○								

(※1)一般社団法人日本暗号資産取引業協会にも加入しております。 (※2)インターネットのみのお取扱いとなります。

(※3)一般社団法人日本STO協会にも加入しております。 (※4)一般社団法人投資信託協会にも加入しております。