

ファンド概況

基準価額(円・1万口当たり)	6,481
純資産総額(億円)	29
実質株式組入比率(%)	99.8
うち株式先物(%)	8.7
組入銘柄数	225
決算日	11/15
当初設定日	00/11/30

実質株式組入比率は、マザーファンドを通じた組入比率です。

組入上位10業種(%)

順位	業種	ファンド	日経平均	差異
1	電気機器	22.3	22.3	0.0
2	情報・通信業	8.1	8.1	0.0
3	医薬品	7.5	7.5	0.0
4	小売業	7.2	7.2	0.0
5	化学	7.1	7.1	0.0
6	輸送用機器	6.5	6.5	0.0
7	機械	5.0	5.0	0.0
8	食料品	4.3	4.3	0.0
9	精密機器	3.8	3.8	0.0
10	サービス業	2.8	2.8	0.0

構成比は現物株式ポートフォリオに占める比率、業種は東証33業種分類によります。

差異は四捨五入の関係で、各構成比の差と一致しない場合があります。

基準価額の推移



収益分配金・税引前(円)

期(年月日)	分配金
第4期(04/11/15)	0
第5期(05/11/15)	0
第6期(06/11/15)	1,400
第7期(07/11/15)	0
第8期(08/11/17)	0
設定来合計	1,400

分配金は1万口当たりの金額で、直近5期分を掲載しています。

期間別騰落率・税引前(%)

	基準価額	日経平均	差異
1ヵ月比	2.9	3.4	+0.5
3ヵ月比	+2.3	+1.8	+0.5
6ヵ月比	+25.2	+25.0	+0.3
1年前比	8.9	10.0	+1.1
3年前比	35.1	37.2	+2.1
設定来	26.2	30.2	+4.0

期間別騰落率は、税引前分配金を再投資したものと仮定して計算しています。

組入上位10銘柄(%)

順位	コード	銘柄名	業種	構成比
1	9983	ファーストリテイリング	小売業	4.5
2	6971	京セラ	電気機器	3.3
3	6954	ファナック	電気機器	3.2
4	9984	ソフトバンク	情報・通信業	2.4
5	8035	東京エレクトロン	電気機器	2.3
6	7267	ホンダ	輸送用機器	2.2
7	4063	信越化学工業	化学	2.2
8	7751	キヤノン	電気機器	2.2
9	6762	TDK	電気機器	2.1
10	9433	KDDI	情報・通信業	2.0

構成比は現物株式ポートフォリオに占める比率です。

基準価額(税引前分配金再投資ベース)は信託報酬控除後であり、税引前分配金を再投資したものと計算しています。

基準価額は信託報酬控除後です。

「日経」および「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属します。また、株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。当ファンドは、朝日ライフアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社および株式会社日本経済新聞デジタルメディアは、その運用および受益権の取引に関して一切の責任を負いません。

市況概況

9月の国内株式市場は、上旬は8月以降の円高ドル安傾向やG20財務省・中央銀行総裁会議で議論された銀行の自己資本の規制強化への警戒感から軟調に推移して始まりました。しかしその後は、海外の主要株価指数が年初来高値を更新したことを背景に上昇に転じました。

中旬は、円高ドル安の更なる進行に加え、GDP(国内総生産)改定値などのマクロ指標が軒並み市場予想を下回ったことから下落しましたが、米鉱工業生産の回復や国際商品市況が上昇すると生産の回復期待が高まり反発しました。

下旬は、新政権の株式市場へのネガティブな発言やノンバンクの私的整理手続きの発表、さらに大手証券会社の大型増資などを嫌気して大幅に下落し、結果日経平均株価の月末終値は10,133円、月間騰落率は3.4%の下落となりました。

業種別騰落率上位: 食料品(上昇)

下位: 証券, 商品先物取引業, その他金融業, 銀行業, 空運業, 海運業, 不動産業(10%以上下落)

本資料は、朝日ライフアセットマネジメント(以下、当社といいます)が、当ファンドの運用の内容やリスク等を説明するために作成したものであり、法令に基づく開示資料ではありません。当ファンドは価格変動リスクや流動性リスク等を伴う証券等に投資します(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)ので、市場環境等によって基準価額は変動します。したがって投資元本が保証されているものではありません。運用による損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。本資料は当社が信頼できると判断した情報を元に、十分な注意を払い作成しておりますが、当社はその正確性や完全性をお約束するものではありません。本資料中のグラフ、数値等は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。本資料に記載されている内容は、今後予告なしに変更することがあります。ファンドの取得の申し込みにあたっては、投資信託説明書(交付目論見書)をお渡しますので、必ず内容についてご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。当ファンドは、金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

## 当ファンドの特色について

当ファンドは、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

1. 原則として日経平均株価採用銘柄のうち、200銘柄以上に等株数投資します。
2. 株式の組入比率は、できるだけ高位を保ちます。
3. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を活用することがあります。
4. 運用はファミリーファンド方式で行います。

流動性に著しく欠ける銘柄や信用リスクが高いと判断される銘柄の組入れは、行わないことがあります。

## 当ファンドのリスクについて

当ファンドをお申込みされる投資家のみなさまは、あらかじめ下記の事項および投資信託説明書(交付目論見書)の内容を十分にお読みください。

### 当ファンドに係るリスクについて

当ファンドは、主に国内の株式を実質的な投資対象としますので、組入れた株式の価格の下落や、組入れた株式の発行会社の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等の影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。

したがって、投資家のみなさまの投資元本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、投資元本を割り込むことがあります。信託財産に生じた利益および損失はすべて受益者に帰属します。

当ファンドの基準価額の変動要因としては、主に「株価変動リスク」、「金利変動リスク」、「信用リスク」、「価格乖離リスク」などがあります。

#### 株価変動リスク

株式市場が国内外の景気、経済、社会情勢の変化等の影響を受け下落するリスクをいいます。株式の実質組入比率は原則として高水準を維持しますので、株式市場が下落した場合には当ファンドの基準価額が下がる要因となります。ファンドが投資する企業が業績悪化や倒産等に陥った場合、その企業の株式の価格は大きく下落し、当ファンドの基準価額に大きな影響を及ぼすことがあります。

#### 金利変動リスク

金利変動により債券価格が変動するリスクをいいます。一般に金利が上昇した場合には、債券価格は下落します。また、金利水準の大きな変動は株式市場に影響を及ぼす場合があり、当ファンドの基準価額の変動要因となります。

#### 信用リスク

発行体が財政難、経営不振、その他の理由により、債券等の利息や償還金をあらかじめ決められた条件で支払うことができなくなるリスク(債務不履行)をいいます。一般に債務不履行が生じた場合またはそれが予想される場合には、株式ならびに債券およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品の価格は下落し(価格がゼロになることもあります。)、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。また、発行体の格付変更に伴い価格が下落するリスクもあります。

#### 価格乖離リスク

当ファンドは、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いますが、その実現が困難となる以下の要因が存在します。

- 日経平均株価の構成銘柄を全て組入れない場合があること
- 株式配当金の受取り、信託報酬およびファンドの監査費用等の控除による影響
- 運用の効率化を図るため株価指数先物取引等も活用することから、現物と先物の動きが連動していない場合の影響
- 株式または株価指数先物取引等の流動性が低下した場合における売買対応の影響
- 追加設定・解約に伴う株式の買付、売却のタイミング差による影響
- 株式売買委託手数料および先物取引等に要する費用等を負担することによる影響
- 株価指数先物取引等を含めた実質的な株式の組入比率が、ファンドの純資産総額の100%とまらない場合の影響 等

上記はファンドのリスクの一部をご説明したものです。詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「投資リスク」をご覧ください。

(2/4)

本資料は、朝日ライフ アセットマネジメント(以下、当社といいます)が、当ファンドの運用の内容やリスク等を説明するために作成したものであり、法令に基づく開示資料ではありません。当ファンドは価格変動リスクや流動性リスク等を伴う証券等に投資します(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)ので、市場環境等によって基準価額は変動します。したがって投資元本が保証されているものではありません。運用による損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。本資料は当社が信頼できると判断した情報を元に、十分な注意を払い作成しておりますが、当社はその正確性や完全性をお約束するものではありません。本資料中のグラフ、数値等は過去のものであり、将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。本資料に記載されている内容は、今後予告なしに変更することがあります。

ファンドの取得の申し込みにあたっては、投資信託説明書(交付目論見書)をお渡ししますので、必ず内容についてご確認の上、お客様ご自身でご判断ください。当ファンドは、金融機関の預金または保険契約ではありませんので、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。また、登録金融機関でご購入いただいた場合は、投資者保護基金による支払いの対象にはなりません。

## 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
信託期間	無期限
決算と収益分配	毎期、決算日(11月15日。ただし、休業日の場合には翌営業日)に、収益分配方針に基づいて分配を行います。
お申込み受付日	毎営業日にお申込みいただけます。
お申込み単位	「分配金受取コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があり、取扱いコースおよびお申込み単位は販売会社によって異なります。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。
お申込み価額	取得申込受付日の基準価額です。
ご解約単位	販売会社が個別に定める単位とします。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。
ご解約価額	解約請求受付日の基準価額です。信託財産留保額はありませぬ。 ご解約代金は、原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目から販売会社において支払います。

## ファンドに係る手数料等について

投資信託には、お申込みおよびご換金(解約)時にお客様に直接ご負担いただく費用と、投資信託の保有期間中に信託財産から間接的にご負担いただく費用との合計額がかかります。当該手数料等の合計額については、投資家のみなさまがファンドを保有される期間等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。

## お申込みおよびご換金(解約)時に直接ご負担いただく費用

お申込み手数料	取得申込受付日の基準価額に、2.1%(税抜2.0%)を上限として販売会社が個別に定める率を乗じて得た額とします。詳しくは、販売会社へお問い合わせください。
ご換金(解約)手数料	ご換金(解約)手数料はありません。
信託財産留保額	信託財産留保額はありませぬ。

## 投資信託の保有期間中に間接的にご負担いただく費用

信託報酬	ファンドの純資産総額に年0.525%(税抜0.5%)の率を乗じて得た額とします。
監査費用	ファンドの純資産総額に年0.00525%(税抜0.005%)の率を乗じて得た額とします。 ただし、年42万円(税抜40万円)を上限とします。 監査費用は、監査法人との契約等により変更になることがあります。
その他の費用	有価証券売買時の売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等 上記その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

## 課税関係

当ファンドは、課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

原則として、個人の受益者については、収益分配時には普通分配金に対して課税され、ご換金(解約)時および償還時には解約価額および償還価額から取得費(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税相当額を含みます。)を控除した差益(譲渡所得)に対して課税されます。

詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)の「手数料等及び税金」をご覧ください。

## 委託会社その他の関係法人

**委託会社** 信託財産の運用指図、受益権の発行、投資信託説明書(交付目論見書)および運用報告書の作成等を行います。

朝日ライフ アセットマネジメント株式会社

**受託会社** 信託財産の保管・管理業務等を行います。

みずほ信託銀行株式会社

**販売会社** 投資信託説明書(交付目論見書)の提供、受益権の募集の取扱い、解約請求の受付、収益分配金、償還金、解約代金の支払い等を行います。

## 販売会社一覧

販売会社名	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SBI証券	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第44号			
オリ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55号			
日興コーディアル証券株式会社(注)	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第2251号			
水戸証券株式会社	金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第181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			
イーバンク銀行株式会社	登録金融機関 関東財務局長(登金)第609号			
朝日生命保険相互会社	登録金融機関 関東財務局長(登金)第112号			

(注)「投信スーパーセンター」での取扱いのみとなります。なお、登録番号につきましては2009年10月1日以降のものを表示しています。

確定拠出年金制度に基づく取得申込みのみを取扱う販売会社は除きます。

当社ではホームページにて、商品内容・運用実績等の  
情報提供サービスを行っております。

URL: <http://www.alamco.co.jp/>