

D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>

ファンドの特色

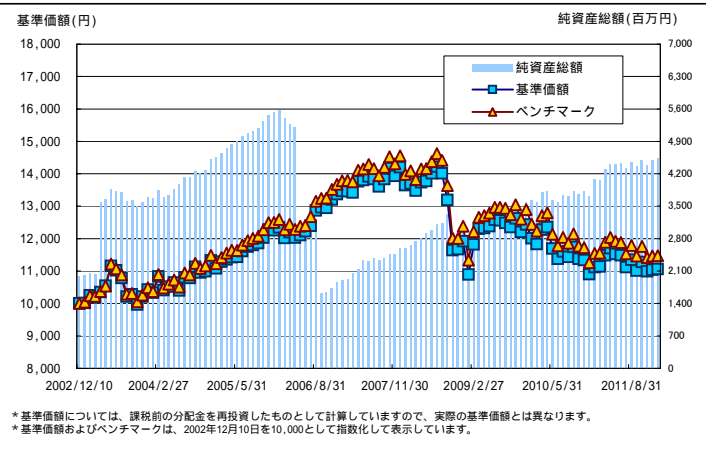
元本確保型の商品ではありません

- ・主な投資対象・・・日本を除く世界主要国の公社債
- ・ベンチマーク・・・シティグループ世界国債インデックス（除く日本、為替ヘッジなし、円ベース）
- ・目標とする運用成果・・・ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

基準価額、純資産総額

基準価額	11,059 円
純資産総額	4,531 百万円

基準価額の推移グラフ



資産構成

債券	97.39%
債券先物等	0.00%
債券実質	97.39%
現金等	2.61%

* 資産構成は実質組入れ比率。

為替ヘッジ

為替ヘッジ比率 0.0%

ポートフォリオプロフィール

	ファンド	ベンチマーク
平均複利回り	1.90%	1.92%
平均残存期間(年)	8.20	8.03
修正デュレーション	6.08	6.25

ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

	3ヶ月間	6ヶ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	-1.97%	-0.53%	-0.56%	0.50%	-3.86%		1.10%
ベンチマーク収益率	-2.45%	-0.58%	-0.66%	0.39%	-3.61%		1.48%
差異	0.48%	0.05%	0.11%	0.11%	-0.25%		-0.37%
ファンドリスク(分配金再投資)	—	—	7.55%	9.60%	10.76%		9.51%
ベンチマークリスク	—	—	7.16%	9.40%	10.69%		9.46%

* ファンド(分配金再投資)の収益率とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。

* 収益率は年率換算。但し、3ヶ月、6ヶ月の収益率は年率換算していません。

* 設定日(2002年12月)の実績は上記の収益率およびリスクに含まれておりません。

公社債通貨別構成比

	通貨別組入状況		
	組入債券	為替予約・先物	計
USドル	40.48%	0.00%	40.48%
カナダ・ドル	2.95%	0.00%	2.95%
メキシコ・ペソ	0.85%	0.00%	0.85%
イギリス・ポンド	8.52%	0.00%	8.52%
デンマーク・クローネ	0.83%	0.00%	0.83%
ノルウェー・クローネ	0.31%	0.00%	0.31%
ユーロ	39.78%	0.00%	39.78%
スウェーデン・クローネ	0.60%	0.00%	0.60%
ポーランド・ズロチ	0.72%	0.00%	0.72%
オーストラリア・ドル	1.45%	0.00%	1.45%
シンガポール・ドル	0.41%	0.00%	0.41%
マレーシア・リンギット	0.48%	0.00%	0.48%

* 純資産総額に対する比率です。

公社債残存別構成比

残存年数	ファンドのウェイト
1年未満(現金等含)	2.96%
1年以上3年未満	27.31%
3年以上7年未満	30.99%
7年以上10年未満	17.21%
10年以上	21.52%

* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

外国公社債上位銘柄

(ファンドのウェイト：%) (組入銘柄数 444銘柄)

No	銘柄	通貨	ファンドのウェイト	残存年数
1	US T N/B 4.0 02/15/14	米ドル	0.90	2.042
2	US T N/B 4.25 11/15/13	米ドル	0.90	1.792
3	US T N/B 1.0 07/15/13	米ドル	0.85	1.458
4	US T N/B 4.75 05/15/14	米ドル	0.81	2.292
5	US T N/B 4.25 08/15/13	米ドル	0.78	1.542
6	US T N/B 0.125 08/31/13	米ドル	0.73	1.583
7	US T N/B 3.5 05/31/13	米ドル	0.70	1.333
8	US T N/B 4.25 11/15/14	米ドル	0.70	2.792
9	US T N/B 3.875 02/15/13	米ドル	0.70	1.042
10	US T N/B 2.625 06/30/14	米ドル	0.66	2.417

* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。「D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>」の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生していません。一方、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の受益証券の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法第25号)第5条の規定による有価証券届出書の提出を行っていません。当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき、加入者のみなさまに対して、当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。投資信託は、債券など価値のある証券等(外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。本資料は、D I A Mアセットマネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証・約束するものではありません。シティグループ世界国債インデックスはシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発したものです。