

DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

投資信託協会分類: 追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型

本商品は元本確保型の商品ではありません

1.投資方針

1.基本方針

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2.投資態度

- 主に外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資し、「シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 外国債券への実質投資割合は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 実質組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 有価証券等の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、通貨に係るオプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。
- 信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。
- 信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

(参考)「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」の投資方針

1.基本方針

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2.投資態度

主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果を目指して運用を行います。

運用プロセス

- 流動性基準によるユニバース設定
シティグループ世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資ユニバースを設定します。
- 最適化法によるポートフォリオの構築
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。
- リバランス
日次・月次レベルでリスク管理を行い、リバランスが必要とされる場合には速やかに実行します。リバランス要因には以下のものがあります。
 - ・年限・通貨構成変化要因
 - ・指数構成銘柄変更
 - ・リスク量の変更
 - ・クーポン・償還再投資
- 外国債券の組入比率は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。
- 有価証券等の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行うことがあります。

2.主要投資対象

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券
(マザーファンドは、海外の公社債を主要投資対象とします。)

3.主な投資制限

株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使及び社債権者割当等により取得するものに限ります。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資には、制限を設けません。

4.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、円ベース、為替ヘッジなし)

シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

5.信託設定日

2002/12/10

6.信託期間

無期限

7.償還条項

受益権口数が10億口を下回ることとなった場合等には、信託を終了させることがあります。

8.決算日

毎年2月21日(休業日の場合は翌営業日)

9.信託報酬

純資産総額に対して年0.2625%(税抜0.25%)
内訳: 委託会社0.1155%(税抜0.11%)、受託会社0.0315%(税抜0.03%)、販売会社0.1155%(税抜0.11%)

10.信託報酬以外のコスト

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

11.お申込単位

1円以上1円単位

12.お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額

13.お申込手数料

ありません。

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。「DIAM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おります。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、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、株式など値動きのある有価証券等(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、元本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、購入者に帰属します。

DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>

投資信託協会分類：追加型投信 / 海外 / 債券 / インデックス型

本商品は元本確保型の商品ではありません

14.ご解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

15.信託財産留保額

ありません。

16.収益分配

年1回の決算時(原則として2月21日、休日の場合は翌営業日。)に収益分配方針に基づき収益分配を行います。分配金は、自動的に再投資されます。

17.申込不可日

申込日がニューヨークの銀行、フランクフルトの銀行、パリの銀行、ロンドンの銀行の休業日に該当する場合は、取得申込・解約請求の受付は行いません。金融商品取引所等における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社の判断でファンドの取得申込・解約請求を中止等する場合があります。また、確定拠出年金制度上、取得申込・解約請求ができない場合がありますので運営管理機関にお問い合わせください。

18.課税関係

確定拠出年金制度上は運用益は非課税となります。

19.損失の可能性

基準価額は、後述の基準価額の主な変動要因等により、下落する場合があります。したがって、購入者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。また、運用により信託財産に生じた損失はすべて購入者のみなさまに帰属します。

20.セーフティーネットの有無

投資信託は、預貯金や保険契約とは異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。

21.持分の計算

解約価額×保有口数

注：解約価額が10,000口あたりで表示されている場合は10,000で除して下さい。

22.委託会社

DIAMアセットマネジメント株式会社
(信託財産の運用指図等を行います。)

23.受託会社

みずほ信託銀行株式会社(信託財産の保管・管理を行います。)
再信託受託銀行：資産管理サービス信託銀行株式会社

24.基準価額の主な変動要因

(1)為替リスク

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落した(円高になった)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。したがって、外貨建証券が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落(円高)度合いによっては、当該証券の円ベースの評価額が減価し、ファンドの受益権の基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建証券への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

(2)金利リスク

金利リスクとは、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、債券の価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

(3)信用リスク

信用リスクとは、公社債、コマーシャルペーパーおよび短期金利商品の発行者が、経営不振、その他の理由により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(債務不履行)リスクをいいます。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、当該公社債等の価格は下落し(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。

<その他の留意点>

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じてシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)に連動する投資成果を目指して運用を行います。当該インデックス採用全銘柄を組入れないこと、資金流出から組入債券の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額とシティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)が乖離する場合があります。

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等によって市場に混乱が生じた場合、もしくは取引に対して規制が変更となる場合または新たな規制が設けられた場合には、基準価額は予想外に下落する要因となる場合があります。

当ファンドの収益分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により、分配を行わないことがあります。

資金動向、市場動向等によっては、前記の投資態度にしたがった運用ができない場合があります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回った場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合等、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)させる場合があります。

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。「DIAM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おります。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、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、株式など値動きのある有価証券等(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、元本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失は、購入者に帰属します。