

## DCワールド・ソブリンインカム

### 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 …… マザーファンドへの投資を通じて、日本を含む主要先進各国のソブリン債(国債及び政府保証債等)に投資します
- ・ ベンチマーク …… シティグループ世界国債インデックス(為替ヘッジなし、円ベース)
- ・ 目標とする運用成果 …… 中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します

### 基準価額、純資産総額

基準価額	9,407円
純資産総額	61,157,423円

基準価額は1万円当たりです。

### 資産構成

債券	96.4%
債券先物	0.0%
債券実質	96.4%
短期金融商品・その他	3.6%

マザーファンドを通じた間接的な保有も含めた、実質的な組入状況を表しています。

### 為替ヘッジ

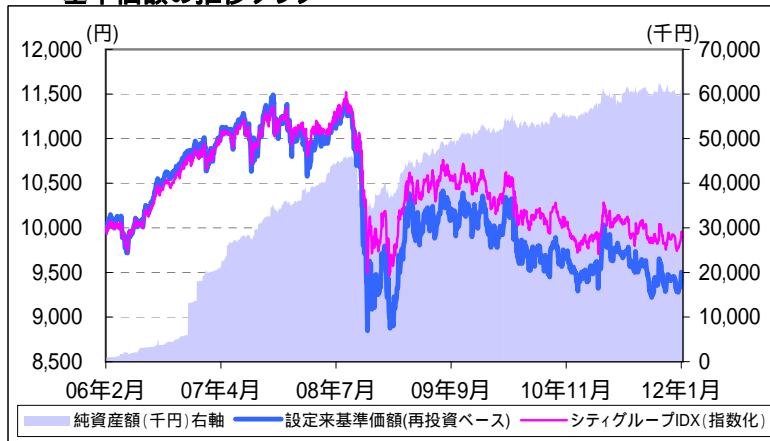
為替ヘッジ比率	0.00%
---------	-------

### ポートフォリオプロフィール

	ファンド	ベンチマーク
修正デュレーション	3.79年	6.74年
残存年数	4.69年	8.27年
複利回り	1.24%	1.52%

\*ファンドの修正デュレーションと残存年数は「短期金融商品・その他」を含むファンド全体、複利回りは保有債券部分の数値です。

### 基準価額の推移グラフ



(注1)シティグループDX(指数化)とは、シティグループ世界国債インデックス(為替ヘッジなし、円ベース)であり、Bloombergのデータを基に2006年2月24日の同指数の現地終値を10,000円として岡三アセットマネジメントが指数化したものです。  
(注2)グラフは過去の実績であり、将来の成果を示唆または保証するものではありません。

### 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か月間	6か月間	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)	-2.19%	-1.22%	-0.35%	1.66%	-2.87%	- - - -	-1.03%
ベンチマーク収益率	0.33%	0.12%	0.39%	0.76%	-1.78%	- - - -	-0.18%
差異	-2.53%	-1.34%	-0.74%	0.90%	-1.10%	- - - -	-0.85%
ファンドリスク(分配金再投資)	- - - -	- - - -	6.80%	8.82%	10.25%	- - - -	9.63%
ベンチマークリスク	- - - -	- - - -	4.16%	6.20%	7.39%	- - - -	7.01%

\*ファンド(分配金再投資)の収益率は、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・リスクともに月次収益率より算出。

\*収益率は期間が1年以上の場合は年率、期間が1年未満のものについては年率換算してありません。

### 公社債通貨別構成比(上位5通貨)

通貨	ウェイト
1 米ドル	27.3%
2 ユーロ	25.6%
3 加ドル	16.7%
4 英ポンド	11.8%
5 豪ドル	9.6%

\*ウェイトはマザーファンドを通じた実質比率です。

### 公社債残存別構成比

残存年数	ウェイト
1年未満	10.8%
1~3年	16.6%
3~7年	52.0%
7~10年	3.4%
10年以上	13.7%

\*ウェイトはマザーファンドを通じた実質比率です。

### 公社債組入上位10銘柄

(組入銘柄数 27)

銘柄名	クーポン	償還日	ウェイト	通貨
1 ドイツ国債	6.000%	2016/06/20	8.91%	ユーロ
2 カナダ国債	11.250%	2015/06/01	8.64%	加ドル
3 米国債	9.875%	2015/11/15	7.27%	米ドル
4 米国債	11.250%	2015/02/15	7.03%	米ドル
5 イギリス国債	8.750%	2017/08/25	5.79%	英ポンド
6 フランス国債	8.500%	2012/12/26	5.27%	ユーロ
7 イギリス国債	8.000%	2013/09/27	4.89%	英ポンド
8 米国債	10.625%	2015/08/15	4.81%	米ドル
9 カナダ国債	10.250%	2014/03/15	4.50%	加ドル
10 オーストラリア国債	6.250%	2014/06/15	3.73%	豪ドル

\*ウェイトはマザーファンドを通じた実質比率です。

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。「DCワールド・ソブリンインカム」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。当ファンドは、公社債など値動きのある証券等(外貨建資産に投資しますので為替変動リスクもあります。)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。当ファンドの運用による損益は、お客様に帰属します。当資料は、岡三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されましたが、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、今後の成果を示唆・保証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(為替ヘッジなし、円ベース)は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券インデックスであり、当インデックスに関する権利はすべてシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属しています。

DCワールド・ソブリンインカム

<リターン実績表>

単位%

設定日2006年2月27日

リターン	リターン	リターン	リターン
2006年3月 0.94%	2009年3月 4.01%		
2006年4月 -1.35%	2009年4月 0.38%		
2006年5月 0.13%	2009年5月 0.02%		
2006年6月 0.97%	2009年6月 1.51%		
2006年7月 1.23%	2009年7月 0.20%		
2006年8月 3.60%	2009年8月 -0.75%		
2006年9月 0.76%	2009年9月 -0.86%		
2006年10月 -0.16%	2009年10月 2.24%		
2006年11月 1.40%	2009年11月 -3.03%		
2006年12月 0.79%	2009年12月 2.14%		
2007年1月 0.50%	2010年1月 -2.63%		
2007年2月 0.08%	2010年2月 -1.18%		
2007年3月 -0.51%	2010年3月 3.39%		
2007年4月 2.09%	2010年4月 1.45%		
2007年5月 0.20%	2010年5月 -5.15%		
2007年6月 0.56%	2010年6月 -2.33%		
2007年7月 -0.37%	2010年7月 1.89%		
2007年8月 -1.27%	2010年8月 -1.72%		
2007年9月 1.68%	2010年9月 3.07%		
2007年10月 2.29%	2010年10月 -2.77%		
2007年11月 -1.77%	2010年11月 0.56%		
2007年12月 1.63%	2010年12月 -3.41%		
2008年1月 -3.64%	2011年1月 1.59%		
2008年2月 0.51%	2011年2月 0.46%		
2008年3月 -2.29%	2011年3月 2.78%		
2008年4月 1.93%	2011年4月 1.84%		
2008年5月 0.43%	2011年5月 -1.64%		
2008年6月 1.49%	2011年6月 -0.36%		
2008年7月 1.30%	2011年7月 -2.11%		
2008年8月 -0.73%	2011年8月 0.80%		
2008年9月 -5.08%	2011年9月 -3.18%		
2008年10月 -12.05%	2011年10月 3.49%		
2008年11月 0.88%	2011年11月 -2.17%		
2008年12月 2.84%	2011年12月 0.10%		
2009年1月 -8.14%	2012年1月 -0.12%		
2009年2月 7.58%			

月末の基準価額にて算出しております。

リターンは、月次の騰落率を掲載しております。

リターンは、分配金を再投資して算出しております。

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。「DCワールド・ソブリンインカム」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。当ファンドは、公社債など値動きのある証券等（外貨建資産に投資しますので為替変動リスクもあります。）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。当ファンドの運用による損益は、お客様に帰属します。当資料は、岡三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されましたが、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、今後の成果を示唆・保証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（為替ヘッジなし、円ベース）は、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが開発した債券インデックスであり、当インデックスに関する権利はすべてシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属しています。