

DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>

元本確保型の商品ではありません

◆ファンドの特色

- ・主な投資対象・・・・・・・・わが国の公社債
- ・ベンチマーク・・・・・・・・NOMURA-BPI総合
- ・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めざします。

◆基準価額、純資産総額

| | |
|-------|-----------|
| 基準価額 | 11,696円 |
| 純資産総額 | 16,448百万円 |

◆資産構成

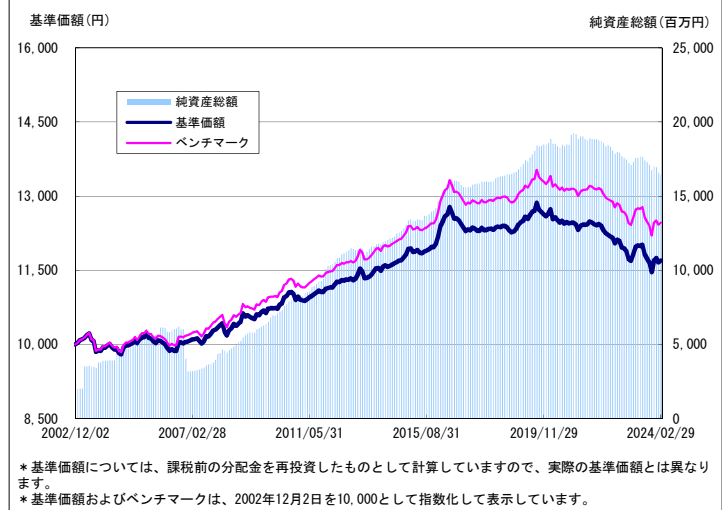
| | |
|-----------|--------|
| 債券組入比率 | 99.64% |
| 債券先物等組入比率 | 0.00% |
| 債券実質組入比率 | 99.64% |
| 現金等比率 | 0.36% |

*資産構成は実質組入比率。
*債券には転換社債が含まれる場合があります。
*基準日に当ファンド又は当ファンドのマザーファンドへ追加設定の申込があった場合、現金等の比率が一時的にマイナスとなる場合があります。

◆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 | 0.70% | 0.70% |
| 平均残存期間(年) | 9.96 | 10.12 |
| 修正デュレーション (先物等ヘッジ込み) | 9.11 | 8.82 |

◆基準価額の推移グラフ



◆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) | -0.09% | -0.39% | -1.02% | -1.72% | -1.32% | 0.08% | 0.73% |
| ベンチマーク収益率 | 0.01% | -0.23% | -0.72% | -1.43% | -1.03% | 0.37% | 1.03% |
| 差異 | -0.09% | -0.16% | -0.30% | -0.29% | -0.29% | -0.29% | -0.30% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | - | - | 3.79% | 2.64% | 2.47% | 2.16% | 2.07% |
| ベンチマークリスク | - | - | 3.80% | 2.64% | 2.48% | 2.17% | 2.07% |

*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(課税前)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ありません。
*設定月(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。

◆公社債種別構成比

| No. | 種別 | ファンドのウェイト |
|-----|------|-----------|
| 1 | 国債 | 84.50% |
| 2 | 事業債 | 7.13% |
| 3 | 地方債 | 5.35% |
| 4 | 政保債 | 1.17% |
| 5 | MBS | 1.12% |
| 6 | 金融債 | 0.30% |
| 7 | 円建外債 | 0.07% |
| | 現金等 | 0.36% |

*転換社債は事業債に含まれる場合があります。
*ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する実質組入比率です。
*基準日に当ファンド又は当ファンドのマザーファンドへ追加設定の申込があった場合、現金等の比率が一時的にマイナスとなる場合があります。

◆公社債組入上位10銘柄

(組入銘柄数 : 662)

| No. | 銘柄 | ファンドのウェイト(%) | 残存年数 |
|-----|------------------|--------------|-------|
| 1 | 451回 利付国庫債券(2年) | 2.06 | 1.422 |
| 2 | 145回 利付国庫債券(5年) | 1.37 | 1.559 |
| 3 | 350回 利付国庫債券(10年) | 1.23 | 4.058 |
| 4 | 364回 利付国庫債券(10年) | 1.14 | 7.562 |
| 5 | 349回 利付国庫債券(10年) | 1.09 | 3.808 |
| 6 | 147回 利付国庫債券(5年) | 1.08 | 2.055 |
| 7 | 357回 利付国庫債券(10年) | 1.07 | 5.811 |
| 8 | 361回 利付国庫債券(10年) | 1.01 | 6.811 |
| 9 | 372回 利付国庫債券(10年) | 1.01 | 9.564 |
| 10 | 365回 利付国庫債券(10年) | 0.99 | 7.811 |

*ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する実質組入比率です。

◆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) | 0.36% |
| 1年以上3年未満 | 18.63% |
| 3年以上7年未満 | 29.37% |
| 7年以上10年未満 | 16.49% |
| 10年以上 | 35.15% |

*ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する実質組入比率です。
*基準日に当ファンド又は当ファンドのマザーファンドへ追加設定の申込があった場合、現金等の比率が一時的にマイナスとなる場合があります。

■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国内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。「国内債券バッシブ・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、実質的に債券など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。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、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、アセットマネジメントOne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。■NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社」という)に帰属します。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>

元本確保型の商品ではありません

<リターン実績表>

単位%

設定日 2002年12月3日

| 年月 | リターン |
|----------|-------|
| 2024年2月 | 0.29 |
| 2024年1月 | -0.77 |
| 2023年12月 | 0.39 |
| 2023年11月 | 2.08 |
| 2023年10月 | -1.61 |
| 2023年9月 | -0.73 |
| 2023年8月 | -0.74 |
| 2023年7月 | -1.56 |
| 2023年6月 | 0.23 |
| 2023年5月 | -0.12 |
| 2023年4月 | 0.22 |
| 2023年3月 | 1.36 |

| 年月 | リターン |
|----------|-------|
| 2021年2月 | -0.86 |
| 2021年1月 | -0.27 |
| 2020年12月 | -0.01 |
| 2020年11月 | 0.10 |
| 2020年10月 | -0.19 |
| 2020年9月 | 0.27 |
| 2020年8月 | -0.48 |
| 2020年7月 | 0.31 |
| 2020年6月 | -0.42 |
| 2020年5月 | -0.45 |
| 2020年4月 | 0.32 |
| 2020年3月 | -1.61 |

| 年月 | リターン |
|----------|-------|
| 2018年2月 | 0.36 |
| 2018年1月 | -0.19 |
| 2017年12月 | 0.03 |
| 2017年11月 | 0.24 |
| 2017年10月 | -0.02 |
| 2017年9月 | -0.39 |
| 2017年8月 | 0.52 |
| 2017年7月 | -0.01 |
| 2017年6月 | -0.32 |
| 2017年5月 | -0.22 |
| 2017年4月 | 0.47 |
| 2017年3月 | -0.15 |

| 年月 | リターン |
|----------|-------|
| 2015年2月 | -0.56 |
| 2015年1月 | 0.01 |
| 2014年12月 | 1.02 |
| 2014年11月 | 0.57 |
| 2014年10月 | 0.44 |
| 2014年9月 | 0.05 |
| 2014年8月 | 0.29 |
| 2014年7月 | 0.14 |
| 2014年6月 | 0.27 |
| 2014年5月 | 0.27 |
| 2014年4月 | 0.12 |
| 2014年3月 | -0.25 |

| | |
|----------|-------|
| 2023年2月 | 1.08 |
| 2023年1月 | -0.29 |
| 2022年12月 | -1.33 |
| 2022年11月 | -0.50 |
| 2022年10月 | -0.13 |
| 2022年9月 | -1.08 |
| 2022年8月 | -0.26 |
| 2022年7月 | 0.63 |
| 2022年6月 | -0.95 |
| 2022年5月 | -0.18 |
| 2022年4月 | -0.27 |
| 2022年3月 | -0.30 |

| | |
|----------|-------|
| 2020年2月 | 0.75 |
| 2020年1月 | 0.40 |
| 2019年12月 | -0.32 |
| 2019年11月 | -0.36 |
| 2019年10月 | -0.41 |
| 2019年9月 | -1.09 |
| 2019年8月 | 1.32 |
| 2019年7月 | 0.09 |
| 2019年6月 | 0.59 |
| 2019年5月 | 0.60 |
| 2019年4月 | -0.33 |
| 2019年3月 | 0.68 |

| | |
|----------|-------|
| 2017年2月 | 0.28 |
| 2017年1月 | -0.57 |
| 2016年12月 | -0.58 |
| 2016年11月 | -0.66 |
| 2016年10月 | -0.29 |
| 2016年9月 | 0.03 |
| 2016年8月 | -0.98 |
| 2016年7月 | -0.86 |
| 2016年6月 | 1.19 |
| 2016年5月 | 0.33 |
| 2016年4月 | 0.86 |
| 2016年3月 | 0.77 |

| | |
|----------|-------|
| 2022年2月 | -0.51 |
| 2022年1月 | -0.74 |
| 2021年12月 | -0.24 |
| 2021年11月 | 0.22 |
| 2021年10月 | -0.14 |
| 2021年9月 | -0.36 |
| 2021年8月 | -0.11 |
| 2021年7月 | 0.47 |
| 2021年6月 | 0.03 |
| 2021年5月 | 0.02 |
| 2021年4月 | 0.16 |
| 2021年3月 | 0.67 |

| | |
|----------|-------|
| 2019年2月 | 0.19 |
| 2019年1月 | 0.38 |
| 2018年12月 | 0.71 |
| 2018年11月 | 0.40 |
| 2018年10月 | 0.15 |
| 2018年9月 | -0.27 |
| 2018年8月 | -0.57 |
| 2018年7月 | -0.20 |
| 2018年6月 | 0.02 |
| 2018年5月 | 0.20 |
| 2018年4月 | -0.10 |
| 2018年3月 | 0.14 |

| | |
|----------|-------|
| 2016年2月 | 1.68 |
| 2016年1月 | 1.21 |
| 2015年12月 | 0.58 |
| 2015年11月 | -0.03 |
| 2015年10月 | 0.35 |
| 2015年9月 | 0.27 |
| 2015年8月 | 0.15 |
| 2015年7月 | 0.26 |
| 2015年6月 | -0.08 |
| 2015年5月 | -0.49 |
| 2015年4月 | 0.30 |
| 2015年3月 | 0.03 |

※リターンは、分配金込み基準価額の月次騰落率を掲載

■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国内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。「国内債券パッシブ・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、金融商品取引法第5条の規定による有価証券届出書の提出を行っておりません。■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。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、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、アセットマネジメントOne株式会社が信頼できると判断し、提供した諸データに基づき、運営管理機関によっ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、今後の成果を保証・約束するものではありません。