

三菱UFJ DC新興国債券インデックスファンド

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 主として新興国債券インデックスマザーファンド受益証券を通じて新興国の現地通貨建ての公社債に投資します
- ・ベンチマーク JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
- ・目標とする運用成果 ベンチマークに連動する運用成果をめざします

◆基準価額、純資産総額

| | |
|-------|----------|
| 基準価額 | 16,528円 |
| 純資産総額 | 235.15億円 |

◆資産構成

| | |
|------|--------|
| 債券 | 98.24% |
| 債券先物 | 0.00% |
| 債券実質 | 98.24% |
| 現金等 | 1.76% |

* ベビーフンドの実質組入比率(純資産総額比)

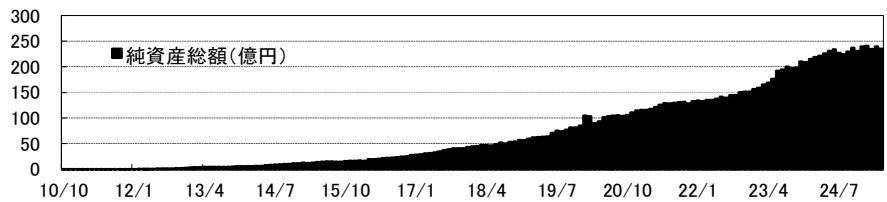
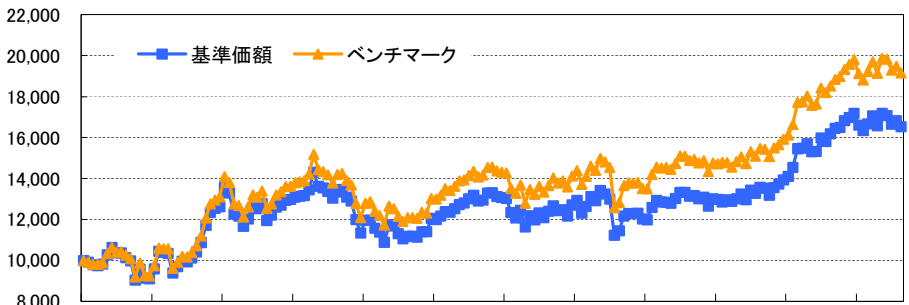
◆為替ヘッジ

| | |
|---------|---------|
| 為替ヘッジ比率 | 為替ヘッジ無し |
|---------|---------|

◆ポートフォリオプロフィール

| | ファンド | ベンチマーク |
|-----------|-------|--------|
| 残存年数 | 7.91年 | 7.73年 |
| 修正デュレーション | 5.27 | 5.29 |
| 複利利回り | 6.48% | 6.09% |

◆基準価額(分配金再投資)の推移グラフ



* 基準価額、ベンチマークは設定日(2010年10月29日)前日を10,000として指数化しています。

◆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 | -3.22% | -3.12% | -1.69% | 8.64% | 7.61% | 2.16% | 3.59% |
| ベンチマーク収益率 | -3.33% | -2.74% | -0.90% | 9.56% | 8.36% | 3.04% | 4.61% |
| 差異 | 0.11% | -0.38% | -0.79% | -0.91% | -0.75% | -0.88% | -1.03% |
| ファンドリスク | — | — | 8.01% | 7.75% | 7.59% | 10.15% | 11.35% |
| ベンチマークリスク | — | — | 8.09% | 7.91% | 7.76% | 10.19% | 11.47% |

* 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・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。(設定来は設定月末を起点として算出)

* 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いません。

◆公社債通貨別構成比

| 通貨 | ファンドのウェイト |
|---------------|-----------|
| 1 メキシコペソ | 9.95% |
| 2 マレーシアリングgit | 9.87% |
| 3 インドルピー | 9.79% |
| 4 中国元 | 9.65% |
| 5 インドネシアルピア | 9.57% |
| その他 | 49.41% |

* ベビーフンドの実質組入比率(純資産総額比)

◆公社債組入上位10銘柄

(組入銘柄数：357銘柄)

| 銘柄名 | ファンドのウェイト | 通貨 | 残存年数 |
|-----------------------------|-----------|-------------|--------|
| 1 BRAZIL-LTN 260701 | 1.43% | ブラジルリアル | 1.17年 |
| 2 10(IN) BRAZIL NTN 290101 | 1.12% | ブラジルリアル | 3.67年 |
| 3 2.632 MALAYSIAGOV 310415 | 1.08% | マレーシアリングgit | 5.96年 |
| 4 10 (IN)BRAZIL NT 270101 | 1.02% | ブラジルリアル | 1.67年 |
| 5 7.5 MEXICAN BONOS 270603 | 0.97% | メキシコペソ | 2.09年 |
| 6 8.5 MEXICAN BONOS 290531 | 0.93% | メキシコペソ | 4.08年 |
| 7 7.75 MEXICAN BONO 310529 | 0.89% | メキシコペソ | 6.08年 |
| 8 5.5 MEXICAN BONOS 270304 | 0.89% | メキシコペソ | 1.84年 |
| 9 8.5 MEXICAN BONOS 290301 | 0.89% | メキシコペソ | 3.84年 |
| 10 8.75 SOUTH AFRICA 480228 | 0.83% | 南アフリカランド | 22.83年 |

* ベビーフンドの実質組入比率(純資産総額比)

◆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 | 2.29% |
| 1～3年 | 19.11% |
| 3～7年 | 35.18% |
| 7～10年 | 17.97% |
| 10年以上 | 23.70% |

* ベビーフンドの実質組入比率(純資産総額比)

■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。■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、株式や公社債など値動きのある証券等(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。■当資料は、三菱UFJ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。■JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマーゼング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマーゼング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)とは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表しているJPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。