

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

◆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	11,155 円
純資産総額	14,929 百万円

◆資産構成

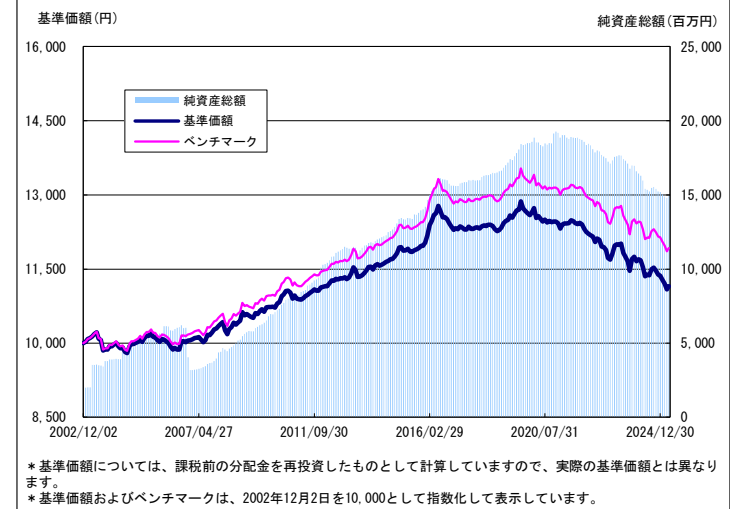
債券組入比率	101.38%
債券先物等組入比率	0.00%
債券実質組入比率	101.38%
現金等比率	-1.38%

\*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	1.30%	1.29%
平均残存期間(年)	9.70	10.22
修正デュレーション	8.69	8.37
(先物等ヘッジ込み)	8.69	8.37

◆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)	-1.15%	-2.72%	-3.37%	-2.89%	-2.36%	-0.66%	0.47%
ベンチマーク収益率	-1.06%	-2.58%	-3.08%	-2.60%	-2.06%	-0.37%	0.78%
差異	-0.09%	-0.14%	-0.29%	-0.29%	-0.30%	-0.28%	-0.30%
ファンドリスク(分配金再投資)	—	—	2.61%	2.96%	2.43%	2.30%	2.11%
ベンチマークリスク	—	—	2.63%	2.97%	2.43%	2.31%	2.12%

\*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いません。  
\*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	87.03%
2	事業債	6.57%
3	地方債	5.46%
4	MBS	1.08%
5	政保債	1.04%
6	金融債	0.11%
7	円建外債	0.08%
	現金等	-1.38%

\*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 : 621)

No.	銘柄	ファンドのウェイト(%)	残存年数
1	349回 利付国庫債券(10年)	1.28	2.641
2	348回 利付国庫債券(10年)	1.18	2.392
3	153回 利付国庫債券(5年)	1.08	2.140
4	376回 利付国庫債券(10年)	1.07	9.397
5	369回 利付国庫債券(10年)	1.00	7.647
6	365回 利付国庫債券(10年)	0.98	6.644
7	347回 利付国庫債券(10年)	0.96	2.140
8	377回 利付国庫債券(10年)	0.95	9.647
9	351回 利付国庫債券(10年)	0.93	3.142
10	366回 利付国庫債券(10年)	0.92	6.893

\*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)	-1.38%
1年以上3年未満	21.68%
3年以上7年未満	29.75%
7年以上10年未満	17.27%
10年以上	32.69%

\*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。■「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、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に帰属します。なお、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。