

確定拠出年金向け説明資料

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 …………… FTSE世界国債インデックス(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 | 14,945円 |
| 純資産総額 | 118百万円 |

※基準価額は1万円当たりです。

◆資産構成

| | |
|------------|-------|
| 債券 | 96.9% |
| 債券先物 | 0.0% |
| 債券実質 | 96.9% |
| 短期金融商品・その他 | 3.1% |

※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

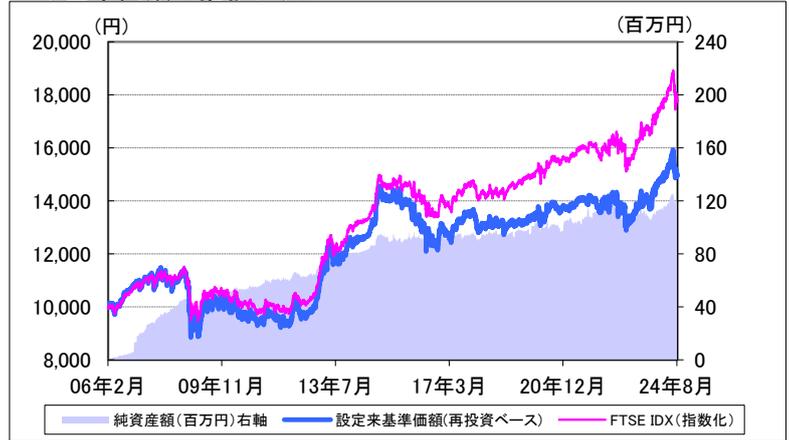
| | |
|---------|-------|
| 為替ヘッジ比率 | 0.00% |
|---------|-------|

◆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 | 7.02年 | 7.08年 |
| 残存年数 | 9.06年 | 9.55年 |
| 複利利回り | 3.31% | 3.32% |

* 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) FTSE IDX (指数化)とは、FTSE世界国債インデックス(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SBI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) | -1.85% | 0.60% | 4.88% | 2.00% | 2.44% | 1.45% | 2.20% |
| ベンチマーク収益率 | -2.06% | 0.60% | 5.47% | 3.51% | 3.62% | 2.77% | 3.16% |
| 差異 | 0.21% | 0.00% | -0.59% | -1.51% | -1.18% | -1.32% | -0.97% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | ----- | ----- | 7.71% | 7.19% | 5.93% | 6.15% | 7.77% |
| ベンチマークリスク | ----- | ----- | 6.68% | 6.43% | 5.27% | 5.28% | 6.13% |

* 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。

* 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おりません。

◆公社債通貨別構成比(上位5通貨)

| 通貨 | ウェイト |
|--------|-------|
| 1 米ドル | 42.3% |
| 2 ユーロ | 25.6% |
| 3 英ポンド | 9.1% |
| 4 円 | 8.0% |
| 5 豪ドル | 6.7% |

* ウェイトはマザーファンドを通じた実質比率です。

◆公社債残存別構成比

| 残存年数 | ウェイト |
|-------|-------|
| 1年未満 | 0.0% |
| 1~3年 | 16.8% |
| 3~7年 | 32.2% |
| 7~10年 | 29.9% |
| 10年以上 | 18.1% |

* 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

| 銘柄名 | クーポン | 償還日 | ウェイト | 通貨 |
|-------------|--------|------------|------|------|
| 1 日本国債 | 0.100% | 2028/06/20 | 6.0% | 円 |
| 2 米国債 | 4.000% | 2034/02/15 | 5.9% | 米ドル |
| 3 イタリア国債 | 4.400% | 2033/05/01 | 5.9% | ユーロ |
| 4 米国債 | 4.375% | 2034/05/15 | 5.2% | 米ドル |
| 5 米国債 | 6.250% | 2030/05/15 | 5.0% | 米ドル |
| 6 米国債 | 4.625% | 2026/02/28 | 4.7% | 米ドル |
| 7 オーストラリア国債 | 2.750% | 2027/11/21 | 4.3% | 豪ドル |
| 8 ドイツ国債 | 4.750% | 2028/07/04 | 4.3% | ユーロ |
| 9 イギリス国債 | 3.250% | 2033/01/31 | 4.1% | 英ポンド |
| 10 米国債 | 4.625% | 2054/05/15 | 3.8% | 米ドル |

* 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。■当ファンドの募集については、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、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したものであり、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、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、SBI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、今後の成果を示唆・保証するものではありません。■FTSE世界国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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 | | | | |
|----------|--------|----------|--------|----------|--------|----------|--------|
| 2024年8月 | -1.74% | 2021年8月 | 0.08% | 2018年8月 | 0.19% | 2015年8月 | -1.87% |
| 2024年7月 | -3.49% | 2021年7月 | 0.44% | 2018年7月 | 0.62% | 2015年7月 | 0.72% |
| 2024年6月 | 3.50% | 2021年6月 | 0.07% | 2018年6月 | 0.86% | 2015年6月 | -1.58% |
| 2024年5月 | 0.51% | 2021年5月 | 1.08% | 2018年5月 | -1.13% | 2015年5月 | 1.51% |
| 2024年4月 | 0.69% | 2021年4月 | -0.09% | 2018年4月 | 1.07% | 2015年4月 | 0.40% |
| 2024年3月 | 1.27% | 2021年3月 | 1.82% | 2018年3月 | 0.25% | 2015年3月 | -0.67% |
| 2024年2月 | 0.70% | 2021年2月 | -1.18% | 2018年2月 | -2.70% | 2015年2月 | 0.27% |
| 2024年1月 | 1.10% | 2021年1月 | -0.09% | 2018年1月 | -2.37% | 2015年1月 | -2.49% |
| 2023年12月 | 1.23% | 2020年12月 | 0.66% | 2017年12月 | 1.36% | 2014年12月 | 1.19% |
| 2023年11月 | 4.71% | 2020年11月 | 1.02% | 2017年11月 | -0.02% | 2014年11月 | 7.55% |
| 2023年10月 | -1.13% | 2020年10月 | -1.77% | 2017年10月 | -0.24% | 2014年10月 | 0.37% |
| 2023年9月 | -2.28% | 2020年9月 | 0.01% | 2017年9月 | 0.85% | 2014年9月 | 2.63% |
| 2023年8月 | 1.98% | 2020年8月 | -0.26% | 2017年8月 | 1.36% | | |
| 2023年7月 | -2.33% | 2020年7月 | 0.51% | 2017年7月 | -0.03% | | |
| 2023年6月 | 3.55% | 2020年6月 | 1.80% | 2017年6月 | 1.71% | | |
| 2023年5月 | 1.84% | 2020年5月 | 0.98% | 2017年5月 | 1.43% | | |
| 2023年4月 | 0.47% | 2020年4月 | -0.67% | 2017年4月 | 0.84% | | |
| 2023年3月 | 1.49% | 2020年3月 | -1.61% | 2017年3月 | -0.78% | | |
| 2023年2月 | 0.52% | 2020年2月 | 1.26% | 2017年2月 | -0.38% | | |
| 2023年1月 | 1.74% | 2020年1月 | 0.52% | 2017年1月 | -1.78% | | |
| 2022年12月 | -4.74% | 2019年12月 | 0.20% | 2016年12月 | 1.87% | | |
| 2022年11月 | -2.02% | 2019年11月 | 0.09% | 2016年11月 | 3.68% | | |
| 2022年10月 | 1.95% | 2019年10月 | 1.43% | 2016年10月 | -0.15% | | |
| 2022年9月 | -2.48% | 2019年9月 | -0.06% | 2016年9月 | -1.68% | | |
| 2022年8月 | -1.69% | 2019年8月 | 0.27% | 2016年8月 | -1.06% | | |
| 2022年7月 | 1.39% | 2019年7月 | -0.17% | 2016年7月 | 1.54% | | |
| 2022年6月 | 1.17% | 2019年6月 | 1.07% | 2016年6月 | -4.73% | | |
| 2022年5月 | -0.45% | 2019年5月 | -0.63% | 2016年5月 | 0.59% | | |
| 2022年4月 | -0.21% | 2019年4月 | -0.58% | 2016年4月 | -2.86% | | |
| 2022年3月 | 3.01% | 2019年3月 | 1.01% | 2016年3月 | 1.73% | | |
| 2022年2月 | -1.60% | 2019年2月 | 1.09% | 2016年2月 | -4.26% | | |
| 2022年1月 | -1.83% | 2019年1月 | -0.38% | 2016年1月 | 1.09% | | |
| 2021年12月 | 0.41% | 2018年12月 | -1.50% | 2015年12月 | -1.70% | | |
| 2021年11月 | -1.18% | 2018年11月 | 0.89% | 2015年11月 | 0.04% | | |
| 2021年10月 | 1.73% | 2018年10月 | -1.50% | 2015年10月 | 0.25% | | |
| 2021年9月 | -1.08% | 2018年9月 | 0.87% | 2015年9月 | -0.62% | | |

※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。■当ファンドの募集については、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、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したものであり、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、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、SBI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、今後の成果を示唆・保証するものではありません。■FTSE世界国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。