確定拠出年金向け説明資料

基準日　2025年2月28日
アセットマネジメントOne株式会社

ＤＩＡＭ外国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・・・・・・・海外の公社債
・ベンチマーク・・・・・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）
・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	22,383 円
純 資 産 総 額	16,683 百万円

◆資産構成

債券	98.35%
債券先物等	0.00%
債券実質	98.35%
現金等	1.65%

＊資産構成は実質組入比率。

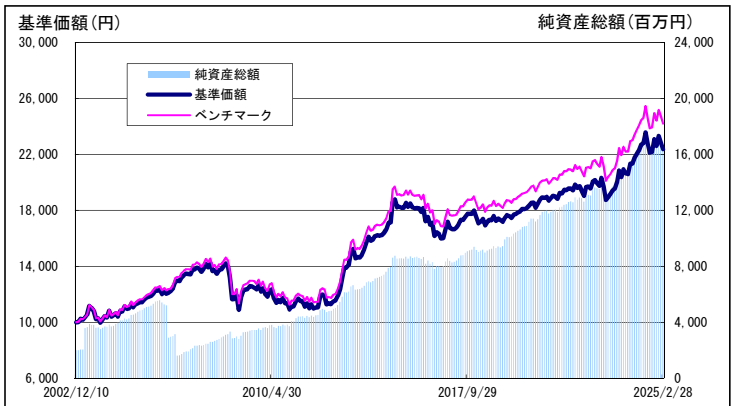
◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	0.0%

◆ポートフォリオプロフィール

	ファンド	ベンチマーク
平均複利利回り	3.43%	3.45%
平均残存期間（年）	8.05	8.97
修正デュレーション	6.25	6.45

◆基準価額の推移グラフ



＊基準価額については、課税前の分配金を再投資したものとして計算していますので、実際の基準価額とは異なります。
＊基準価額およびベンチマークは、2002年12月10日を10,000として指数化して表示しています。

◆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）	-1.05%	1.09%	1.77%	5.54%	3.84%	2.06%	3.70%
ベンチマーク収益率	-0.83%	1.42%	2.14%	5.82%	4.21%	2.37%	4.05%
差異	-0.22%	-0.32%	-0.37%	-0.28%	-0.37%	-0.31%	-0.35%
ファンドリスク（分配金再投資）	－	－	9.07%	8.01%	6.73%	6.36%	8.41%
ベンチマークリスク	－	－	9.24%	8.12%	6.77%	6.42%	8.42%

＊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。
＊収益率は年率換算。但し、3ヶ月、6ヶ月の収益率は年率換算しておりません。
＊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。

◆公社債通貨別構成比

	通貨別組入状況		
	組入債券	為替予約・先物	計
ＵＳドル	46.99%	0.00%	46.99%
カナダ・ドル	1.96%	0.00%	1.96%
メキシコ・ペソ	0.77%	0.00%	0.77%
イギリス・ポンド	5.08%	0.00%	5.08%
デンマーク・クローネ	0.21%	0.00%	0.21%
ノルウェー・クローネ	0.14%	0.00%	0.14%
ユーロ	28.89%	0.00%	28.89%
スウェーデン･クローネ	0.16%	0.00%	0.16%
ポーランド・ズロチ	0.55%	0.00%	0.55%
オーストラリア・ドル	1.18%	0.00%	1.18%
ニュージーランド・ドル	0.26%	0.00%	0.26%
シンガポール・ドル	0.37%	0.00%	0.37%
マレーシア・リンギット	0.48%	0.00%	0.48%
オフショア・人民元	10.96%	0.00%	10.96%
イスラエル・シュケル	0.35%	0.00%	0.35%

＊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	ﾌｧﾝﾄﾞのｳｪｲﾄ
1年未満（現金等含）	1.69%
1年以上3年未満	29.28%
3年以上7年未満	33.75%
7年以上10年未満	12.95%
10年以上	22.33%

＊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。

◆外国公社債上位銘柄

（ファンドのウェイト：%）　（組入銘柄数：　955）

No.	銘柄	通貨	ﾌｧﾝﾄﾞのｳｪｲﾄ	残存年数
1	US T N/B 4.375 05/15/34	米ドル	0.47	9.208
2	US T N/B 4.125 11/15/32	米ドル	0.45	7.708
3	US T N/B 3.875 08/15/34	米ドル	0.43	9.458
4	US T N/B 4.0 02/15/34	米ドル	0.41	8.958
5	US T N/B 4.5 11/15/33	米ドル	0.39	8.708
6	US T N/B 2.75 08/15/32	米ドル	0.39	7.458
7	US T N/B 1.25 08/15/31	米ドル	0.39	6.458
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/15/26	オフショア人民元	0.38	1.458
9	US T N/B 3.5 02/15/33	米ドル	0.38	7.958
10	CHINA GOVERNMENT BOND 2.3 05/15/26	オフショア人民元	0.38	1.208

＊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。

■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外国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。「外国債券パッシブ･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（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。■FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

確定拠出年金向け説明資料

基準日 2025年2月28日

ＤＩＡＭ外国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10日

年月	リターン
2025年2月	-1.96
2025年1月	-2.11
2024年12月	3.10
2024年11月	-2.06
2024年10月	4.09
2024年9月	0.21
2024年8月	-2.56
2024年7月	-3.64
2024年6月	3.43
2024年5月	0.54
2024年4月	1.86
2024年3月	1.22
2024年2月	1.26
2024年1月	1.76
2023年12月	0.09
2023年11月	3.47
2023年10月	-0.15
2023年9月	-1.48
2023年8月	2.70
2023年7月	-2.18
2023年6月	3.97
2023年5月	2.54
2023年4月	0.72
2023年3月	1.24
2023年2月	1.19
2023年1月	1.17
2022年12月	-4.93
2022年11月	-3.01
2022年10月	2.92
2022年9月	-0.90
2022年8月	-1.21
2022年7月	0.66
2022年6月	2.34
2022年5月	-0.62
2022年4月	0.20
2022年3月	3.27

年月	リターン
2022年2月	-1.82
2022年1月	-1.74
2021年12月	0.60
2021年11月	-1.13
2021年10月	2.13
2021年9月	-0.71
2021年8月	-0.05
2021年7月	0.66
2021年6月	-0.18
2021年5月	1.32
2021年4月	-0.06
2021年3月	2.18
2021年2月	-0.92
2021年1月	-0.16
2020年12月	0.81
2020年11月	1.01
2020年10月	-1.51
2020年9月	0.44
2020年8月	-0.13
2020年7月	0.97
2020年6月	1.57
2020年5月	1.40
2020年4月	-1.92
2020年3月	0.09
2020年2月	1.15
2020年1月	0.79
2019年12月	0.43
2019年11月	0.03
2019年10月	0.95
2019年9月	0.45
2019年8月	0.64
2019年7月	0.28
2019年6月	1.28
2019年5月	-0.82
2019年4月	-0.29
2019年3月	1.31

年月	リターン
2019年2月	1.38
2019年1月	-0.64
2018年12月	-0.65
2018年11月	0.88
2018年10月	-1.83
2018年9月	1.64
2018年8月	-0.09
2018年7月	0.73
2018年6月	1.48
2018年5月	-2.60
2018年4月	1.21
2018年3月	0.63
2018年2月	-2.58
2018年1月	-2.49
2017年12月	1.23
2017年11月	0.07
2017年10月	-0.02
2017年9月	1.09
2017年8月	1.40
2017年7月	-0.08
2017年6月	1.87
2017年5月	1.48
2017年4月	0.58
2017年3月	-0.01
2017年2月	-0.55
2017年1月	-2.40
2016年12月	3.09
2016年11月	4.00
2016年10月	0.15
2016年9月	-1.93
2016年8月	-0.75
2016年7月	1.61
2016年6月	-5.55
2016年5月	0.87
2016年4月	-3.18
2016年3月	1.75

年月	リターン
2016年2月	-5.16
2016年1月	1.54
2015年12月	-1.42
2015年11月	-0.08
2015年10月	0.09
2015年9月	-0.35
2015年8月	-1.49
2015年7月	1.27
2015年6月	-1.50
2015年5月	1.89
2015年4月	0.00
2015年3月	-0.40

※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。■「ＤＩＡＭ外国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。「外国債券パッシブ・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（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。