

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	11,696円
純資産総額	16,448百万円

◆資産構成

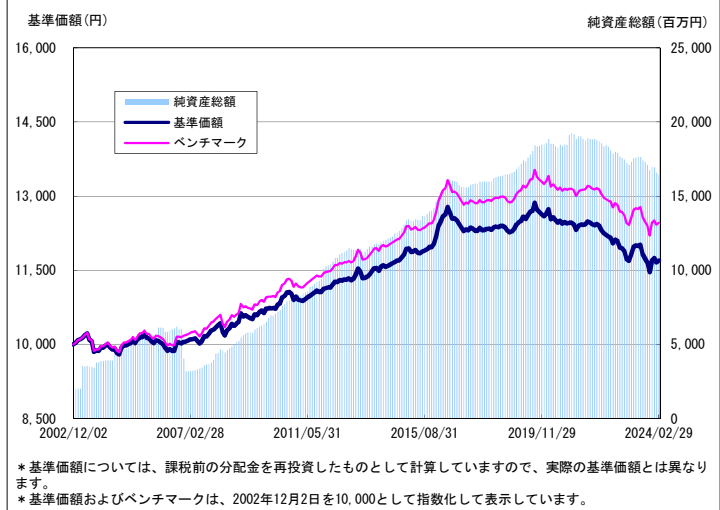
債券組入比率	99.64%
債券先物等組入比率	0.00%
債券実質組入比率	99.64%
現金等比率	0.36%

*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	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。■「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」と呼ぶ)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。