

インデックスファンド海外新興国(エマージング)債券(1年決算型)
(愛称:DC インデックス海外新興国債券)

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 … 新興国の公社債
- ・ベンチマーク … JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし・円ベース)
- ・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。

◆基準価額と純資産総額

| | |
|-------|----------|
| 基準価額 | 15.680円 |
| 純資産総額 | 129.75億円 |

◆資産構成

| | |
|-------|--------|
| 債券 | 97.09% |
| 債券先物 | 0.00% |
| 債券実質 | 97.09% |
| 現金その他 | 2.91% |

※当ファンドの実質の組入比率です。

◆為替ヘッジ

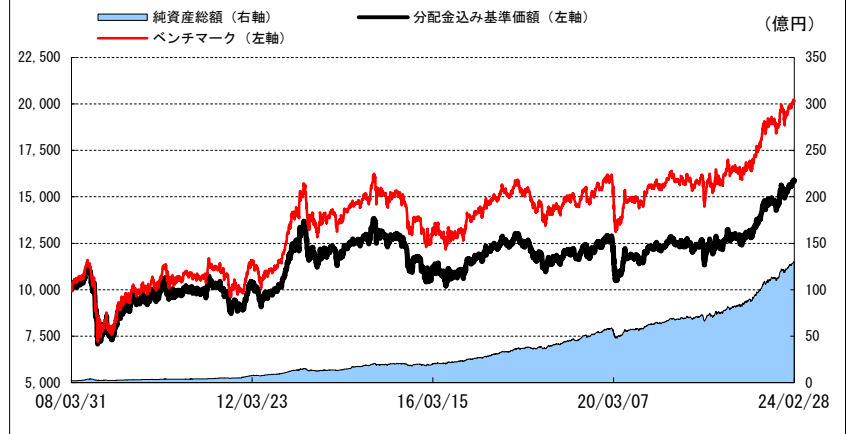
| | |
|--------|-------|
| 為替ヘッジ率 | 0.00% |
|--------|-------|

◆ポートフォリオプロフィール

| | ファンド | ベンチマーク |
|---------|-------|--------|
| 残存年数 | 7.03年 | 7.17年 |
| デュレーション | 4.99年 | 5.03年 |
| 複利回り | 6.42% | 6.18% |

※上記は、マザーファンドの値です。

◆基準価額の推移グラフ



※基準価額、ベンチマークは設定日(2008年4月1日)の前営業日を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(分配金再投資) | 2.79% | 6.04% | 21.06% | 9.03% | 5.49% | 2.96% | 2.77% |
| ベンチマーク収益率 | 2.33% | 4.53% | 20.32% | 8.99% | 6.08% | 3.97% | 4.22% |
| 差異 | 0.45% | 1.51% | 0.74% | 0.04% | -0.58% | -1.01% | -1.45% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | | | 8.33% | 7.23% | 10.24% | 10.25% | 13.02% |
| ベンチマークリスク | | | 8.31% | 7.39% | 10.29% | 10.40% | 13.28% |

※収益率は、1年以上の場合、年率ベースで、1年未満(3か月間、6か月間)は、年率換算していません。

※ファンド(分配金再投資)の収益率は、当ファンド決算時に分配金があった場合の分配金を再購入(再投資)し、算出しています。

※収益率・リスクともに月次の収益率より算出しています。設定日が月中の場合、設定日が属する月は含んでいません。

※上記表およびグラフ使用のベンチマークは、前日(土、日等を除く)のドルベースインデックスを当日のファンドで採用しているレートで円換算しており、投資信託の基準価額算出方式に合わせています。

◆公社債通貨構成比

| 通貨 | ウェイト |
|---------------|--------|
| 1 ブラジルレアル | 9.85% |
| 2 メキシコペソ | 9.82% |
| 3 中国元 | 9.82% |
| 4 インドネシアルピア | 9.79% |
| 5 マレーシアリングギット | 9.78% |
| その他 | 48.05% |

※ウェイトはマザーファンドの対純資産総額比です。

◆公社債残存別構成比

| 残存年数 | ウェイト |
|-------|--------|
| 1年未満 | 5.72% |
| 1~3年 | 23.46% |
| 3~7年 | 30.02% |
| 7~10年 | 17.08% |
| 10年以上 | 20.82% |

※ウェイトはマザーファンドの対純資産総額比です。

◆公社債組入上位10銘柄(組入銘柄数 282銘柄)

| 銘柄名 | 種別 | クーポン | ウェイト | 通貨 | 残存年数 |
|----------------------------|----|-------|-------|----------|-------|
| 1 LETRA TESOURO NACIONAL | 国債 | 0% | 1.61% | ブラジルレアル | 2.34年 |
| 2 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10% | 1.49% | ブラジルレアル | 4.84年 |
| 3 LETRA TESOURO NACIONAL | 国債 | 0% | 1.37% | ブラジルレアル | 1.84年 |
| 4 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債 | 10.5% | 1.25% | 南アフリカランド | 2.81年 |
| 5 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10% | 1.18% | ブラジルレアル | 0.84年 |
| 6 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10% | 1.17% | ブラジルレアル | 2.84年 |
| 7 LETRA TESOURO NACIONAL | 国債 | 0% | 1.11% | ブラジルレアル | 1.34年 |
| 8 MEX BONOS DESARR FIX RT | 国債 | 5.75% | 1.06% | メキシコペソ | 2.01年 |
| 9 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債 | 8% | 1.04% | 南アフリカランド | 5.93年 |
| 10 MEX BONOS DESARR FIX RT | 国債 | 7.75% | 0.97% | メキシコペソ | 7.25年 |

※ウェイトはマザーファンドの対純資産総額比です。

■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。■当資料は、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。特に投資する新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。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、日興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。■「JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし・円ベース)」に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、JPMorgan Chase & Co.に帰属します。

確定拠出年金向け説明資料

基準日

2024年2月29日

運営管理機関：株式会社百五銀行

インデックスファンド海外新興国(エマージング)債券(1年決算型)
(愛称:DC インデックス海外新興国債券)

<リターン実績表>

単位%

設定日 2008年4月1日

| 年月 | リターン | 年月 | リターン | 年月 | リターン | 年月 | リターン |
|----------|-------|----------|--------|----------|-------|----------|-------|
| 2024年2月 | 1.67 | 2021年2月 | -0.26 | 2018年2月 | -1.39 | 2015年2月 | -1.27 |
| 2024年1月 | 2.25 | 2021年1月 | -0.58 | 2018年1月 | 0.02 | 2015年1月 | -0.63 |
| 2023年12月 | -1.12 | 2020年12月 | 2.60 | 2017年12月 | 2.60 | 2014年12月 | -4.94 |
| 2023年11月 | 5.24 | 2020年11月 | 4.99 | 2017年11月 | 0.43 | 2014年11月 | 6.47 |
| 2023年10月 | 0.38 | 2020年10月 | -0.25 | 2017年10月 | -2.13 | 2014年10月 | 2.02 |
| 2023年9月 | -2.34 | 2020年9月 | -2.39 | 2017年9月 | 1.39 | 2014年9月 | 0.13 |
| 2023年8月 | 1.36 | 2020年8月 | 0.05 | 2017年8月 | 1.45 | 2014年8月 | 0.37 |
| 2023年7月 | 0.13 | 2020年7月 | -0.02 | 2017年7月 | 0.48 | 2014年7月 | 0.81 |
| 2023年6月 | 6.18 | 2020年6月 | 0.94 | 2017年6月 | 1.70 | 2014年6月 | 0.28 |
| 2023年5月 | 3.10 | 2020年5月 | 6.19 | 2017年5月 | 1.33 | 2014年5月 | 1.73 |
| 2023年4月 | 1.30 | 2020年4月 | 2.03 | 2017年4月 | -0.10 | 2014年4月 | 0.90 |
| 2023年3月 | 1.44 | 2020年3月 | -13.33 | 2017年3月 | 1.68 | 2014年3月 | 3.20 |
| 2023年2月 | 1.34 | 2020年2月 | -2.03 | 2017年2月 | 1.33 | | |
| 2023年1月 | 2.79 | 2020年1月 | -1.24 | 2017年1月 | -0.65 | | |
| 2022年12月 | -2.56 | 2019年12月 | 3.74 | 2016年12月 | 5.68 | | |
| 2022年11月 | -0.28 | 2019年11月 | -1.48 | 2016年11月 | 0.11 | | |
| 2022年10月 | 2.29 | 2019年10月 | 3.77 | 2016年10月 | 2.39 | | |
| 2022年9月 | -1.14 | 2019年9月 | 2.68 | 2016年9月 | -0.64 | | |
| 2022年8月 | 3.43 | 2019年8月 | -4.83 | 2016年8月 | -0.06 | | |
| 2022年7月 | -1.99 | 2019年7月 | 1.59 | 2016年7月 | 1.04 | | |
| 2022年6月 | 1.72 | 2019年6月 | 4.42 | 2016年6月 | -2.21 | | |
| 2022年5月 | 1.03 | 2019年5月 | -2.53 | 2016年5月 | -3.15 | | |
| 2022年4月 | -0.57 | 2019年4月 | 0.42 | 2016年4月 | -0.49 | | |
| 2022年3月 | 0.92 | 2019年3月 | -1.82 | 2016年3月 | 7.67 | | |
| 2022年2月 | -1.09 | 2019年2月 | 2.15 | 2016年2月 | -4.41 | | |
| 2022年1月 | -0.21 | 2019年1月 | 2.43 | 2016年1月 | -1.46 | | |
| 2021年12月 | 2.74 | 2018年12月 | -1.87 | 2015年12月 | -3.47 | | |
| 2021年11月 | -3.36 | 2018年11月 | 2.88 | 2015年11月 | -0.10 | | |
| 2021年10月 | 0.59 | 2018年10月 | -1.66 | 2015年10月 | 5.58 | | |
| 2021年9月 | -1.20 | 2018年9月 | 4.75 | 2015年9月 | -5.21 | | |
| 2021年8月 | 0.38 | 2018年8月 | -6.57 | 2015年8月 | -6.92 | | |
| 2021年7月 | -1.45 | 2018年7月 | 3.02 | 2015年7月 | -1.41 | | |
| 2021年6月 | -0.15 | 2018年6月 | -2.13 | 2015年6月 | -2.65 | | |
| 2021年5月 | 2.32 | 2018年5月 | -5.35 | 2015年5月 | 0.69 | | |
| 2021年4月 | 1.89 | 2018年4月 | -0.45 | 2015年4月 | 2.46 | | |
| 2021年3月 | -0.21 | 2018年3月 | -0.25 | 2015年3月 | -2.50 | | |

※リターンは、分配金込み基準価額の月次騰落率を掲載しています。

■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、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。特に投資する新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。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、購入者に帰属します。■当資料は、日興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。