

## DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>

### ◆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。

元本確保型の商品ではありません

### ◆基準価額、純資産総額

基準価額	12,402円
純資産総額	19,044百万円

### ◆資産構成

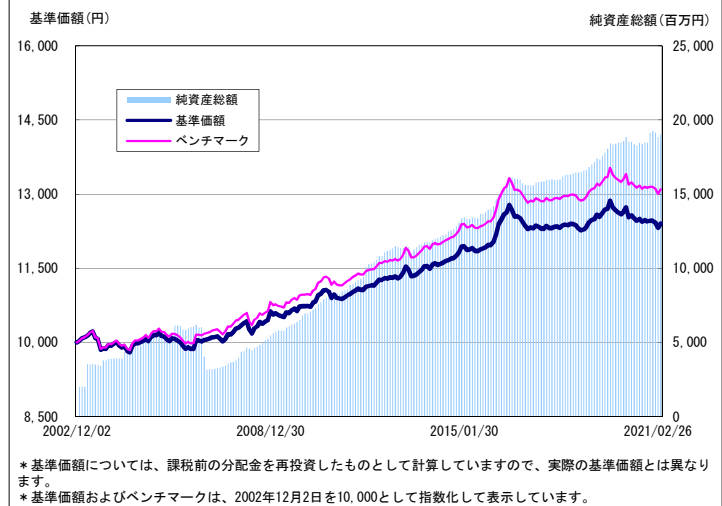
債券組入比率	99.68%
債券先物等組入比率	0.00%
債券実質組入比率	99.68%
現金等比率	0.32%

\*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	0.14%	0.14%
平均残存期間(年)	10.41	9.89
修正デュレーション	9.57	9.35
(先物等ヘッジ込み)	9.57	9.35

### ◆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)	-0.47%	-0.57%	-1.03%	0.05%	-0.13%	1.32%	1.17%
ベンチマーク収益率	-0.38%	-0.39%	-0.70%	0.33%	0.15%	1.62%	1.47%
差異	-0.09%	-0.18%	-0.33%	-0.28%	-0.28%	-0.30%	-0.30%
ファンドリスク(分配金再投資)	—	—	1.52%	1.98%	1.90%	1.78%	1.94%
ベンチマークリスク	—	—	1.52%	1.99%	1.91%	1.79%	1.95%

\*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ありません。  
\*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。

### ◆公社債種別構成比

No.	種別	ファンドのウェイト
1	国債	81.89%
2	事業債	7.02%
3	地方債	6.82%
4	政保債	2.68%
5	MBS	0.89%
6	金融債	0.20%
7	円建外債	0.17%
	現金等	0.32%

\*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 : 395)

No.	銘柄	ファンドのウェイト(%)	残存年数
1	346回 利付国庫債券(10年)	1.06	5.973
2	132回 利付国庫債券(5年)	1.02	1.222
3	350回 利付国庫債券(10年)	0.99	6.975
4	334回 利付国庫債券(10年)	0.95	3.225
5	324回 利付国庫債券(10年)	0.93	1.222
6	345回 利付国庫債券(10年)	0.91	5.726
7	339回 利付国庫債券(10年)	0.89	4.225
8	145回 利付国庫債券(5年)	0.87	4.477
9	344回 利付国庫債券(10年)	0.86	5.477
10	342回 利付国庫債券(10年)	0.86	4.973

\*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)	0.32%
1年以上3年未満	19.80%
3年以上7年未満	27.14%
7年以上10年未満	15.33%
10年以上	37.42%

\*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。■「DIAM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。「国内債券バタフライ・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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。