

## DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型

### ◆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・・・ 国内株式、国内債券、外国株式、外国債券
- ・ベンチマーク・・・ 国内株式:東証株価指数(TOPIX)、国内債券:NOMURA-BPI総合、外国株式:MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、為替ヘッジなし)、外国債券:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)、短期金融資産:コール・ローンのオーバーナイト物レートを、下記基本アロケーションに基づいて合成したものです。
- ・目標とする運用成果・・・ ベンチマークを上回る運用成果をめざします。

### ◆基準価額、純資産総額

|       |            |
|-------|------------|
| 基準価額  | 14,769 円   |
| 純資産総額 | 11,983 百万円 |

### ◆資産構成

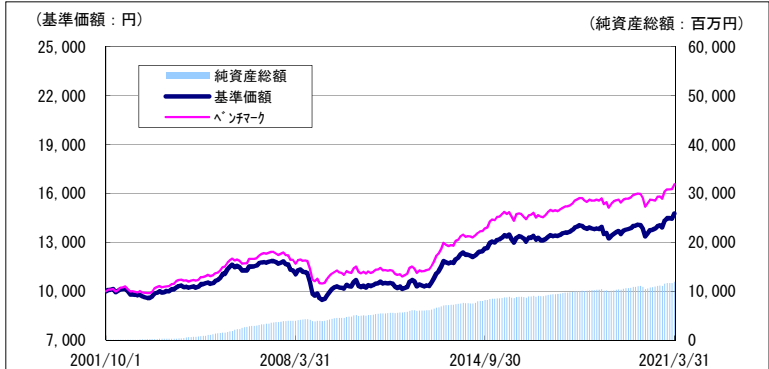
|      | ファンド   | 基本アロケーション |
|------|--------|-----------|
| 国内株式 | 19.6%  | 19.0%     |
| 国内債券 | 62.5%  | 65.0%     |
| 外国株式 | 5.9%   | 5.0%      |
| 外国債券 | 7.9%   | 8.0%      |
| 短期資産 | 4.1%   | 3.0%      |
| 合計   | 100.0% | 100.0%    |

\*資産構成は実質組入比率  
\*株式には投資証券および投資信託受益証券を含む場合があります(以下同じ)。

### ◆対円為替ヘッジ

|         |      |
|---------|------|
| 為替ヘッジ比率 | 0.0% |
|---------|------|

### ◆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、2001年10月1日を10,000として指数化して表示しています。

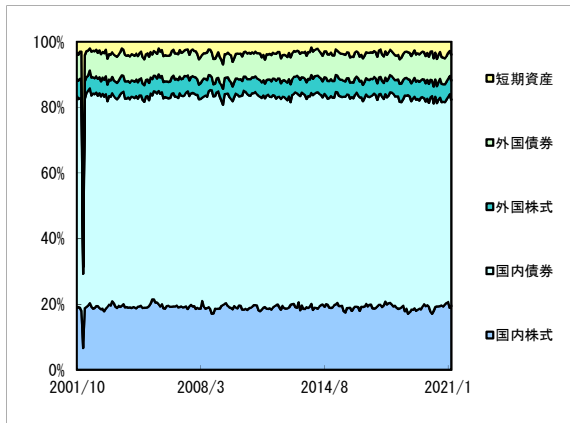
### ◆ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

|                 | 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) | 2.04% | 5.09% | 10.51% | 2.20%  | 2.14%  | 3.49%  | 2.02%  |
| ベンチマーク収益率       | 1.92% | 4.69% | 9.03%  | 2.28%  | 2.48%  | 3.91%  | 2.65%  |
| 差異              | 0.12% | 0.41% | 1.47%  | -0.08% | -0.35% | -0.42% | -0.63% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | —     | —     | 3.85%  | 4.55%  | 3.83%  | 4.19%  | 4.52%  |
| ベンチマークリスク       | —     | —     | 3.73%  | 4.18%  | 3.64%  | 4.09%  | 4.23%  |

\*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。

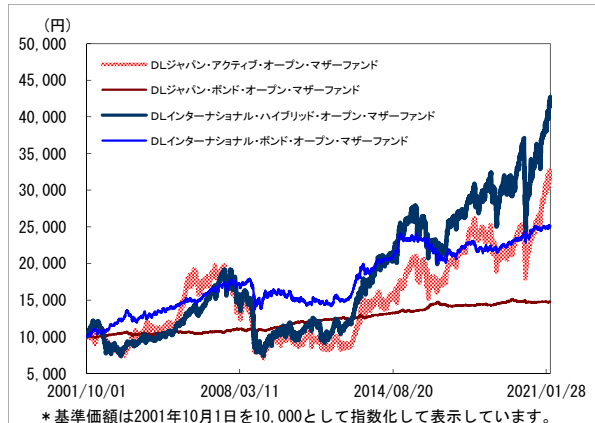
\*収益率は年率換算。但し、3ヶ月間、6ヶ月間の収益率は年率換算していません。

### ◆各マザーファンド組入比率の推移(対純資産総額)



\*2002年2月の資産配分比率の変動は、月末に入金があったことによる一時的なものです。

### ◆各マザーファンド基準価額推移



\*基準価額は2001年10月1日を10,000として指数化して表示しています。

■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。■「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型」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。「DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」等の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、実質的に株式、債券など価値のある有価証券等(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。

DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド (DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>)

◆ファンドの特色

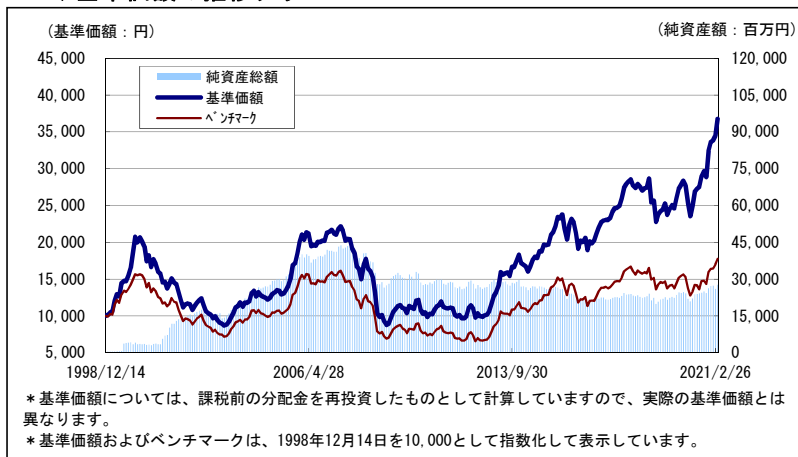
元本確保型の商品ではありません

- ・主な投資対象 . . . . . わが国の株式 (全上場銘柄)
- ・ベンチマーク . . . . . 東証株価指数 (TOPIX)
- ・目標とする運用成果 . . . . . ベンチマークを中長期的に上回る運用成果をめざします

◆基準価額、純資産総額

|       |            |
|-------|------------|
| 基準価額  | 36,752 円   |
| 純資産総額 | 27,720 百万円 |

◆基準価額の推移グラフ



◆資産構成

|        |        |
|--------|--------|
| 株式     | 98.23% |
| 東証1部   | 98.23% |
| 東証2部   | 0.00%  |
| 地方市場   | 0.00%  |
| ジャスダック | 0.00%  |
| その他    | 0.00%  |
| 株式先物等  | 0.00%  |
| 株式実質組入 | 98.23% |
| 現金等    | 1.77%  |

◆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) | 9.34% | 23.90% | 56.06% | 10.30% | 12.70% | 12.61% | 5.96%  |
| ベンチマーク収益率        | 8.27% | 20.21% | 39.27% | 4.42%  | 7.72%  | 8.44%  | 2.67%  |
| 差異               | 1.06% | 3.69%  | 16.79% | 5.88%  | 4.98%  | 4.17%  | 3.29%  |
| ファンドリスク (分配金再投資) | —     | —      | 13.82% | 17.45% | 14.95% | 16.36% | 18.47% |
| ベンチマークリスク        | —     | —      | 15.51% | 17.22% | 15.24% | 16.60% | 17.44% |

\*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。ただし、当マザーファンドでは収益の分配はありません。  
\*収益率は年率換算。但し、3ヶ月間、6ヶ月間の収益率は年率換算しておりません。  
\*設定月 (1998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。

◆株式組入上位10業種

(単位: %)

| No. | 業種     | ファンドのウェイト | ベンチマークのウェイト |
|-----|--------|-----------|-------------|
| 1   | 電気機器   | 22.46     | 17.47       |
| 2   | 情報・通信業 | 9.59      | 9.22        |
| 3   | 小売業    | 8.76      | 4.70        |
| 4   | 化学     | 8.45      | 7.38        |
| 5   | 輸送用機器  | 7.81      | 7.36        |
| 6   | 医薬品    | 5.47      | 5.51        |
| 7   | 銀行業    | 4.86      | 5.16        |
| 8   | サービス業  | 4.69      | 5.59        |
| 9   | 卸売業    | 3.50      | 4.79        |
| 10  | 機械     | 3.22      | 5.67        |

\*ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆株式組入上位10銘柄

(単位: %)

(組入銘柄数: 75)

| No. | 銘柄                | ファンドのウェイト | ベンチマークのウェイト |
|-----|-------------------|-----------|-------------|
| 1   | トヨタ自動車            | 3.79      | 3.26        |
| 2   | ソニー               | 3.27      | 2.71        |
| 3   | セブン&アイ・ホールディングス   | 2.75      | 0.64        |
| 4   | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 2.67      | 1.49        |
| 5   | 信越化学工業            | 2.43      | 1.26        |
| 6   | ソフトバンクグループ        | 2.42      | 2.71        |
| 7   | イビデン              | 2.32      | 0.09        |
| 8   | 大黒天物産             | 2.22      | 0.01        |
| 9   | 東京エレクトロン          | 2.21      | 1.02        |
| 10  | 三井住友フィナンシャルグループ   | 2.19      | 1.02        |

\*ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

■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。■「DLジャパン・アクティブ・オープン・マザーファンド」は「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型」の主要投資対象であり、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、株式など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。■東証株価指数 (TOPIX) は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、(株東京証券取引所) が有しています。なお、本商品は、(株東京証券取引所) により提供、保証または販売されるものではなく、(株東京証券取引所) は、ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド (DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>)

◆ファンドの特色

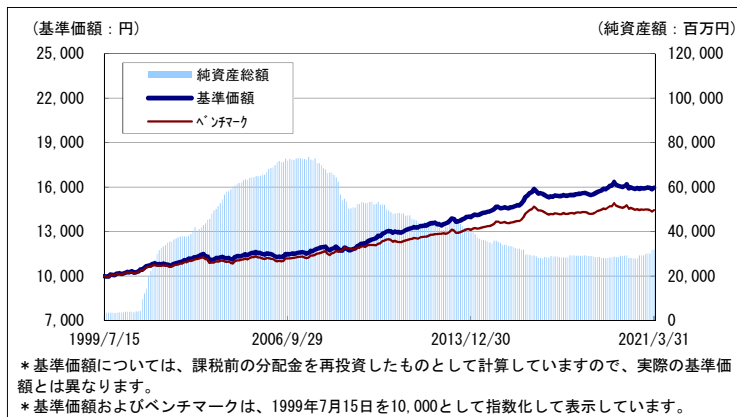
元本確保型の商品ではありません

- ・主な投資対象・・・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・・・ベンチマークを中長期的に上回る運用成果をめざします

◆基準価額、純資産総額

|       |           |
|-------|-----------|
| 基準価額  | 15,948円   |
| 純資産総額 | 31,992百万円 |

◆基準価額の推移グラフ



◆資産構成

|           |        |
|-----------|--------|
| 債券組入比率    | 97.07% |
| 債券先物等組入比率 | 0.00%  |
| 債券実質組入比率  | 97.07% |
| 現金等比率     | 2.93%  |

◆ポートフォリオプロフィール

|            | ファンド  | インデックス |
|------------|-------|--------|
| 最終利回り      | 0.28% | 0.14%  |
| 平均残存期間(年)  | 9.20  | 9.89   |
| 修正デュレーション  | 8.59  | 9.35   |
| (先物等ヘッジ込み) | 8.59  | 9.35   |

◆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) | -0.19% | 0.14%  | 0.26%  | 0.85% | 0.64% | 2.11% | 2.18% |
| ベンチマーク収益率       | -0.38% | -0.39% | -0.70% | 0.33% | 0.15% | 1.62% | 1.72% |
| 差異              | 0.19%  | 0.52%  | 0.96%  | 0.52% | 0.49% | 0.49% | 0.47% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | —      | —      | 1.35%  | 2.05% | 1.97% | 1.87% | 2.01% |
| ベンチマークリスク       | —      | —      | 1.52%  | 1.99% | 1.91% | 1.79% | 1.93% |

\* 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。ただし、当マザーファンドでは収益の分配はありません。  
\* 収益率は年率換算。但し、3ヶ月間、6ヶ月間の収益率は年率換算してありません。  
\* 設定月(1999年7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   | 50.90%    |
| 2   | 事業債  | 44.92%    |
| 3   | 地方債  | 1.25%     |
| 4   | 政保債  | 0.00%     |
| 5   | 金融債  | 0.00%     |
| 6   | 円建外債 | 0.00%     |
| 7   | MB S | 0.00%     |
|     | 現金等  | 2.93%     |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆公社債組入上位10銘柄

(組入銘柄数：149)

| No. | 銘柄                   | ファンドのウェイト | 残存年数  |
|-----|----------------------|-----------|-------|
| 1   | 360回 利付国庫債券(10年)     | 6.44%     | 9.48  |
| 2   | 154回 利付国庫債券(20年)     | 5.67%     | 14.48 |
| 3   | 361回 利付国庫債券(10年)     | 5.26%     | 9.73  |
| 4   | 351回 利付国庫債券(10年)     | 3.22%     | 7.23  |
| 5   | 33回 利付国庫債券(30年)      | 2.96%     | 19.49 |
| 6   | 44回 利付国庫債券(30年)      | 2.73%     | 23.49 |
| 7   | 979回 国庫短期証券          | 2.19%     | 0.22  |
| 8   | 156回 利付国庫債券(20年)     | 1.93%     | 14.98 |
| 9   | 146回 利付国庫債券(5年)      | 1.89%     | 4.73  |
| 10  | 6回 楽天社債 期限前償還条項付劣後社債 | 1.70%     | 9.60  |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆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) | 6.37%     |
| 1年以上3年未満   | 10.03%    |
| 3年以上7年未満   | 34.78%    |
| 7年以上10年未満  | 21.53%    |
| 10年以上      | 27.29%    |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

■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。■「DLジャパン・ボンド・オープン・マザーファンド」は「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型」の主要投資対象であり、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、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。

DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド (DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>)

◆ファンドの特色

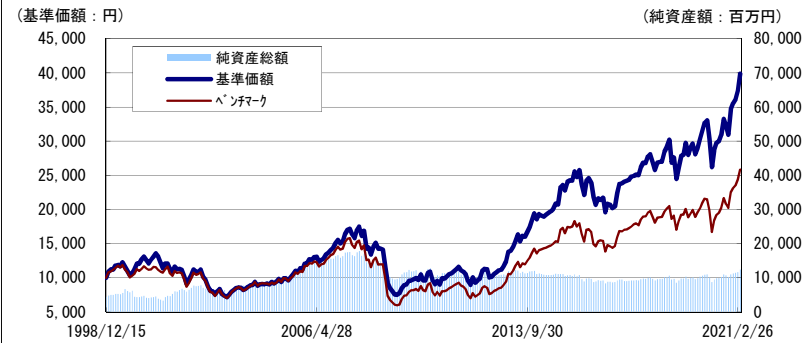
元本確保型の商品ではありません

- ・主な投資対象・・・日本を除く世界主要先進国の株式
- ・ベンチマーク・・・MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、為替ヘッジなし)
- ・目標とする運用成果・・・ベンチマークを長期的に上回る運用成果をめざします

◆基準価額、純資産総額

|       |            |
|-------|------------|
| 基準価額  | 39,866 円   |
| 純資産総額 | 12,435 百万円 |

◆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計算してありますので、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、1998年12月15日を10,000として指数化して表示しています。

◆資産構成

|           |        |
|-----------|--------|
| 株式組入比率    | 98.38% |
| 株式先物等組入比率 | 0.00%  |
| 株式実質組入比率  | 98.38% |
| 現金等比率     | 1.62%  |

\* 株式には投資証券および投資信託受益証券を含む場合があります (以下同じ)。

◆為替ヘッジ

|         |      |
|---------|------|
| 為替ヘッジ比率 | 0.0% |
|---------|------|

◆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) | 12.23% | 23.48% | 52.13% | 15.59% | 13.00% | 13.45% | 6.01%  |
| ベンチマーク収益率        | 11.60% | 24.37% | 54.37% | 12.65% | 10.97% | 11.03% | 4.00%  |
| 差異               | 0.63%  | -0.89% | -2.24% | 2.94%  | 2.03%  | 2.43%  | 2.00%  |
| ファンドリスク (分配金再投資) | —      | —      | 16.38% | 20.10% | 17.56% | 17.86% | 18.54% |
| ベンチマークリスク        | —      | —      | 15.71% | 19.65% | 17.30% | 17.87% | 18.74% |

\* 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 (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。ただし、当マザーファンドでは収益の分配はありません。  
\* 収益率は年率換算。但し、3ヶ月間、6ヶ月間の収益率は年率換算していません。  
\* 設定月 (1998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。

◆株式国別配分上位

| No. | 国      | ファンドのウェイト |
|-----|--------|-----------|
| 1   | 米国     | 70.65%    |
| 2   | 英国     | 6.76%     |
| 3   | スイス    | 4.49%     |
| 4   | ドイツ    | 4.18%     |
| 5   | フランス   | 2.85%     |
| 6   | カナダ    | 2.40%     |
| 7   | スウェーデン | 2.13%     |
| 8   | フィンランド | 1.49%     |
| 9   | リベリア   | 1.09%     |
| 10  | オランダ   | 1.05%     |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆株式業種配分上位

| No. | 業種                     | ファンドのウェイト |
|-----|------------------------|-----------|
| 1   | ソフトウェア・サービス            | 16.23%    |
| 2   | 資本財                    | 11.69%    |
| 3   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 11.44%    |
| 4   | 食品・飲料・タバコ              | 7.51%     |
| 5   | 銀行                     | 6.85%     |
| 6   | 運輸                     | 4.36%     |
| 7   | 消費者サービス                | 4.28%     |
| 8   | 半導体・半導体製造装置            | 4.13%     |
| 9   | 耐久消費財・アパレル             | 3.43%     |
| 10  | 小売                     | 3.34%     |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆株式組入上位10銘柄

(組入銘柄数: 81)

| No. | 銘柄                           | 発行国  | ファンドのウェイト |
|-----|------------------------------|------|-----------|
| 1   | MICROSOFT CORP               | アメリカ | 5.22%     |
| 2   | JOHNSON & JOHNSON            | アメリカ | 2.74%     |
| 3   | HOME DEPOT INC               | アメリカ | 2.57%     |
| 4   | VISA INC                     | アメリカ | 2.37%     |
| 5   | JPMORGAN CHASE & CO          | アメリカ | 2.12%     |
| 6   | THE WALT DISNEY CO           | アメリカ | 1.97%     |
| 7   | ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | スイス  | 1.86%     |
| 8   | ADOBE INC                    | アメリカ | 1.86%     |
| 9   | WALMART INC                  | アメリカ | 1.83%     |
| 10  | MORGAN STANLEY               | アメリカ | 1.83%     |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

■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。■「DLインターナショナル・ハイブリッド・オープン・マザーファンド」は「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「DIAMライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型」の主要投資対象であり、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、株式など流動性のある有価証券等 (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。■MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。



D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド (D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>)

◆ファンドの特色

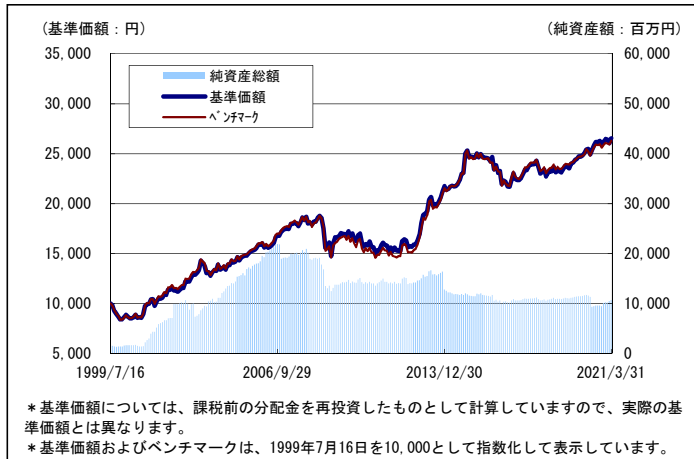
元本確保型の商品ではありません

- ・主な投資対象・・・日本を除く世界主要国の公社債
- ・ベンチマーク・・・FTSE世界国債インデックス (除く日本、円換算ベース)
- ・目標とする運用成果・・・ベンチマークを中長期的に上回る運用成果をめざします

◆基準価額、純資産総額

|       |            |
|-------|------------|
| 基準価額  | 26,538 円   |
| 純資産総額 | 10,672 百万円 |

◆基準価額の推移グラフ



◆資産構成

|           |        |
|-----------|--------|
| 債券組入比率    | 99.23% |
| 債券先物等組入比率 | 0.00%  |
| 債券実質組入比率  | 99.23% |
| 現金等比率     | 0.77%  |

◆為替ヘッジ

|         |      |
|---------|------|
| 為替ヘッジ比率 | 0.1% |
|---------|------|

◆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     | 1.04% | 0.62%  |
| 平均残存期間 (年) | 9.95  | 8.98   |
| 修正デュレーション  | 8.44  | 7.86   |

◆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) | 0.30%  | 1.05%  | 4.25%  | 4.63% | 2.16% | 5.33%  | 4.70% |
| ベンチマーク収益率        | 0.76%  | 1.26%  | 4.27%  | 3.97% | 2.12% | 5.60%  | 4.67% |
| 差異               | -0.46% | -0.21% | -0.03% | 0.66% | 0.05% | -0.27% | 0.03% |
| ファンドリスク (分配金再投資) | —      | —      | 4.94%  | 4.35% | 5.72% | 7.39%  | 8.88% |
| ベンチマークリスク        | —      | —      | 3.92%  | 3.69% | 5.34% | 7.43%  | 8.94% |

\* 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。ただし、当マザーファンドでは収益の分配はありません。

\* 収益率は年率換算。但し、3ヶ月間、6ヶ月間の収益率は年率換算していません。

\* 設定月 (1999年7月) の実績は上記の収益率およびリスクに含まれていません。

◆公社債通貨別構成比

| 通貨          | 通貨別組入状況 |         |        |
|-------------|---------|---------|--------|
|             | 組入債券    | 為替予約・先物 | 計      |
| USドル        | 46.38%  | -9.08%  | 37.30% |
| カナダ・ドル      | 3.00%   | 1.00%   | 4.00%  |
| メキシコ・ペソ     | 3.72%   | -2.96%  | 0.76%  |
| イギリス・ポンド    | 6.65%   | 0.01%   | 6.66%  |
| デンマーク・クローネ  | 0.00%   | 0.50%   | 0.50%  |
| ノルウェー・クローネ  | 0.00%   | 1.28%   | 1.28%  |
| ユーロ         | 34.05%  | 9.46%   | 43.51% |
| スウェーデン・クローネ | 0.00%   | 0.34%   | 0.34%  |
| ポーランド・ズロチ   | 2.13%   | -1.56%  | 0.56%  |
| オーストラリア・ドル  | 3.30%   | 0.01%   | 3.32%  |
| シンガポール・ドル   | 0.00%   | 0.44%   | 0.44%  |
| イスラエル・シケル   | 0.00%   | 0.44%   | 0.44%  |

\* 上記比率は、純資産総額に対する比率です。

◆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) | 0.77%     |
| 1年以上3年未満    | 10.01%    |
| 3年以上7年未満    | 34.10%    |
| 7年以上10年未満   | 30.35%    |
| 10年以上       | 24.77%    |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

◆外国公社債上位銘柄

|     |                          | (組入銘柄数: 46) |       |           |
|-----|--------------------------|-------------|-------|-----------|
| No. | 銘柄                       | 通貨          | 残存年数  | ファンドのウェイト |
| 1   | US T N/B 2.0 02/15/23    | 米ドル         | 1.88  | 8.73%     |
| 2   | ITALY BTPS 1.25 12/01/26 | ユーロ         | 5.67  | 7.37%     |
| 3   | US T N/B 2.125 05/15/25  | 米ドル         | 4.13  | 6.81%     |
| 4   | US T N/B 2.0 08/15/25    | 米ドル         | 4.38  | 5.52%     |
| 5   | ITALY BTPS 3.0 08/01/29  | ユーロ         | 8.34  | 5.48%     |
| 6   | US T N/B 2.25 08/15/27   | 米ドル         | 6.38  | 5.14%     |
| 7   | US T N/B 1.25 05/15/50   | 米ドル         | 29.13 | 4.52%     |
| 8   | US T N/B 2.375 05/15/29  | 米ドル         | 8.13  | 4.36%     |
| 9   | US T N/B 3.125 11/15/28  | 米ドル         | 7.63  | 3.46%     |
| 10  | SPAIN 1.95 04/30/26      | ユーロ         | 5.08  | 3.30%     |

\* ファンドのウェイトとは、純資産総額に対する比率です。

■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。■「D Lインターナショナル・ボンド・オープン・マザーファンド」は「D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>1安定型」、「D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>2安定・成長型」、「D I A Mライフサイクル・ファンド<DC年金>3成長型」の主要投資対象であり、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、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いません。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。