

DCダイワ新興国債券インデックスファンド

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 …… 外国債券
- ・ベンチマーク …… JP モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)
- ・目標とする運用成果 …… ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行います。

◆基準価額、純資産総額

基準価額	12,966円
純資産総額	88.55億円

* 既出分配金累計：0円

◆資産構成

債券	96.33%
債券先物	0.00%
債券実質	96.33%
現金等	3.67%

* 比率は純資産総額対比です。
(ヘビーファンドの実質組入比率にて計算しています。)

◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	-
---------	---

* 当ファンドは為替ヘッジを行いません。

◆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(年)	7.38	7.33
デュレーション(年)	5.38	5.38
複利回り	4.20%	4.36%

* ファンドの数値はヘビーファンドの実質組入債券の数値です。
* 上記デュレーションは、修正デュレーションを記載しています。

◆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)	2.30%	3.53%	-2.53%	-0.86%	1.02%	2.32%	2.25%
ベンチマーク収益率	2.69%	3.86%	-1.52%	0.05%	1.95%	3.65%	3.51%
差異	-0.40%	-0.33%	-1.00%	-0.91%	-0.94%	-1.33%	-1.26%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	17.28%	13.04%	11.62%	12.78%	12.67%
ベンチマークリスク	-----	-----	17.49%	13.09%	11.68%	12.95%	12.83%

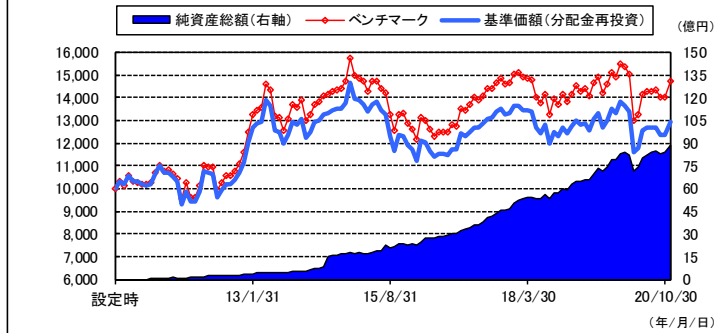
* ファンド収益率(分配金再投資)とは、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。

* 収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。

* 収益率は期間が1年以上の場合は年率換算しております。期間が1年未満のものについては年率換算していません。

◆基準価額の推移

- ・基準価額(分配金再投資)とベンチマークとの比較グラフです。
- ・月末最終営業日データ(分配金再投資基準価額・純資産総額)を使用しています。
- ・設定日(2010/7/6)の前日の基準価額とベンチマークを10,000として指数化したものです。
- ・ベンチマークは、JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(米ドルベース)に基づき、大和アセットマネジメント株式会社が計算したものです。



◆通貨別構成比

通貨	ファンド ウェイト
メキシコ・ペソ	9.83%
インドネシア・ルピア	9.66%
ブラジル・レアル	8.72%
タイ・バーツ	8.64%
ポーランド・ズロチ	8.16%
その他	55.00%

* ファンドウェイトは当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	ファンド ウェイト
1年未満	0.15%
1年以上～3年未満	20.05%
3年以上～7年未満	38.84%
7年以上～10年未満	19.00%
10年以上	21.97%

* ファンドウェイトは当ファンドの対債券ポートフォリオ比です。

◆組入上位銘柄

(組入銘柄数 222)

銘柄名	ファンドウェイト	通貨	残存年数
1 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	1.62%	ブラジル・レアル	2.09
2 Brazil Letras do Tesouro Nacional	1.42%	ブラジル・レアル	3.09
3 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1.37%	南アフリカ・ランド	6.06
4 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	1.33%	ブラジル・レアル	4.09
5 Brazil Letras do Tesouro Nacional	1.22%	ブラジル・レアル	2.58
6 Mexican Bonos	1.09%	メキシコ・ペソ	8.50
7 Poland Government Bond	1.05%	ポーランド・ズロチ	5.65
8 Mexican Bonos	1.00%	メキシコ・ペソ	6.51
9 Poland Government Bond	0.99%	ポーランド・ズロチ	8.90
10 Mexican Bonos	0.96%	メキシコ・ペソ	1.53

* ファンドウェイトは当ファンドの対純資産総額比です。

◆過去3ヶ月間のパフォーマンス分析

多くの投資対象国の債券価格が上昇(金利は低下)したことや、債券からの利息収入がプラスに寄与した結果、基準価額は上昇しました。

■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、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は大きく変動します。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、大和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、今後の成果を保障・約束するものではありません。■上記「基準価額」は、運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。■JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J. P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J. P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J. P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.