確定拠出年金向け説明資料

基　準　日：2025年03月31日
大和アセットマネジメント株式会社

# ＤＣダイワ外国債券インデックス

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　・・・・・・・・　FTSE世界国債インデックス（除く日本、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目指します。

## ◆基準価額、純資産総額

| | |
|---|---|
| 基準価額 | 23,648円 |
| 純資産総額 | 1,887.82億円 |

＊既出分配金累計：0円

## ◆資産構成

| | |
|---|---|
| 債券 | 97.60% |
| 債券先物 | 0.00% |
| 債券実質 | 97.60% |
| 現金等 | 2.40% |

＊比率は純資産総額対比です。
（ベ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。

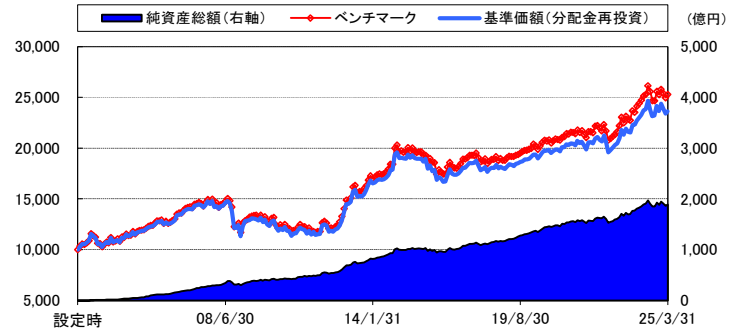
## ◆ポートフォリオプロフィール

| | ファンド | ベンチマーク |
|---|---|---|
| 残存年数（年） | 8.21 | 8.91 |
| ﾃﾞｭﾚｰｼｮﾝ（年） | 6.32 | 6.28 |
| 複利利回り | 3.52% | 3.52% |

＊ファンドの数値はベ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。

## ◆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(2002/12/2)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、投資信託の基準価額算出方法に合わせ、1営業日遅らせたデータを使用しています。




## ◆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） | −3.03% | 1.94% | 1.56% | 4.79% | 4.07% | 2.22% | 3.79% |
| ベンチマーク収益率 | −2.10% | 2.51% | 2.25% | 5.36% | 4.58% | 2.58% | 4.10% |
| 差異 | −0.94% | −0.57% | −0.69% | −0.56% | −0.51% | −0.36% | −0.31% |
| ファンドリスク（分配金再投資） | ------- | ------- | 9.07% | 7.85% | 6.74% | 6.38% | 8.42% |
| ベンチマークリスク | ------- | ------- | 8.02% | 7.56% | 6.41% | 6.02% | 8.30% |

＊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おりません。

## ◆通貨別構成比

| 通貨 | ﾌｧﾝﾄﾞ ｳｴｰﾄ |
|---|---|
| 米ドル | 47.20% |
| ユーロ | 29.54% |
| オフショア人民元 | 11.18% |
| 英ポンド | 5.27% |
| カナダ・ドル | 1.97% |
| その他 | 4.84% |

＊ファンドウエー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 | ﾌｧﾝﾄﾞ ｳｴｰﾄ |
|---|---|
| １年未満 | 1.15% |
| １年以上～３年未満 | 27.93% |
| ３年以上～７年未満 | 34.64% |
| ７年以上～１０年未満 | 13.29% |
| １０年以上 | 23.00% |

＊ファンドウエー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 1044）

| | 銘柄名 | ﾌｧﾝﾄﾞｳｴｰﾄ | 通貨 | 残存年数 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | CHINA GOVERNMENT BOND | 0.52% | オフショア人民元 | 2.13 |
| 2 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.48% | 米ドル | 8.38 |
| 3 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.45% | 米ドル | 8.63 |
| 4 | CHINA GOVERNMENT BOND | 0.45% | オフショア人民元 | 4.04 |
| 5 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.45% | 米ドル | 9.38 |
| 6 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.44% | 米ドル | 8.88 |
| 7 | United States Treasury Note/Bond | 0.40% | 米ドル | 5.88 |
| 8 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.40% | 米ドル | 9.63 |
| 9 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.38% | 米ドル | 6.38 |
| 10 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.38% | 米ドル | 7.38 |

＊ファンドウエー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

債券市場で金利は低下したものの、為替市場で円高が進んだため、当ファンドの基準価額は過去３ヶ月間で下落しました。

■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、今後の成果を保証・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。■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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

確定拠出年金向け説明資料

基　準　日 : 2025年03月31日
運営管理機関:株式会社千葉銀行

# ＤＣダイワ外国債券インデックス

## <リターン実績表>

（単位:%）

設定日:2002年12月2日

| | リターン |
|---|---|
| 2025年3月 | 1.05 |
| 2025年2月 | -1.97 |
| 2025年1月 | -2.11 |
| 2024年12月 | 3.11 |
| 2024年11月 | -2.05 |
| 2024年10月 | 4.10 |
| 2024年9月 | 0.21 |
| 2024年8月 | -2.58 |
| 2024年7月 | -3.65 |
| 2024年6月 | 3.44 |
| 2024年5月 | 0.52 |
| 2024年4月 | 1.86 |

| | リターン |
|---|---|
| 2022年3月 | 3.28 |
| 2022年2月 | -1.82 |
| 2022年1月 | -1.74 |
| 2021年12月 | 0.60 |
| 2021年11月 | -1.13 |
| 2021年10月 | 2.14 |
| 2021年9月 | -0.70 |
| 2021年8月 | -0.05 |
| 2021年7月 | 0.67 |
| 2021年6月 | -0.19 |
| 2021年5月 | 1.32 |
| 2021年4月 | -0.05 |

| | リターン |
|---|---|
| 2019年3月 | 1.31 |
| 2019年2月 | 1.39 |
| 2019年1月 | -0.64 |
| 2018年12月 | -0.65 |
| 2018年11月 | 0.88 |
| 2018年10月 | -1.83 |
| 2018年9月 | 1.64 |
| 2018年8月 | -0.08 |
| 2018年7月 | 0.72 |
| 2018年6月 | 1.46 |
| 2018年5月 | -2.59 |
| 2018年4月 | 1.19 |

| | リターン |
|---|---|
| 2016年3月 | 1.76 |
| 2016年2月 | -5.17 |
| 2016年1月 | 1.57 |
| 2015年12月 | -1.44 |
| 2015年11月 | -0.06 |
| 2015年10月 | 0.07 |
| 2015年9月 | -0.35 |
| 2015年8月 | -1.50 |
| 2015年7月 | 1.30 |
| 2015年6月 | -1.52 |
| 2015年5月 | 1.93 |
| 2015年4月 | -0.06 |

| | |
|---|---|
| 2024年3月 | 1.23 |
| 2024年2月 | 1.27 |
| 2024年1月 | 1.75 |
| 2023年12月 | 0.09 |
| 2023年11月 | 3.48 |
| 2023年10月 | -0.14 |
| 2023年9月 | -1.50 |
| 2023年8月 | 2.70 |
| 2023年7月 | -2.18 |
| 2023年6月 | 3.98 |
| 2023年5月 | 2.56 |
| 2023年4月 | 0.71 |

| | |
|---|---|
| 2021年3月 | 2.18 |
| 2021年2月 | -0.91 |
| 2021年1月 | -0.16 |
| 2020年12月 | 0.81 |
| 2020年11月 | 1.01 |
| 2020年10月 | -1.51 |
| 2020年9月 | 0.45 |
| 2020年8月 | -0.13 |
| 2020年7月 | 0.98 |
| 2020年6月 | 1.57 |
| 2020年5月 | 1.44 |
| 2020年4月 | -1.93 |

| | |
|---|---|
| 2018年3月 | 0.65 |
| 2018年2月 | -2.59 |
| 2018年1月 | -2.49 |
| 2017年12月 | 1.23 |
| 2017年11月 | 0.06 |
| 2017年10月 | -0.02 |
| 2017年9月 | 1.10 |
| 2017年8月 | 1.41 |
| 2017年7月 | -0.07 |
| 2017年6月 | 1.87 |
| 2017年5月 | 1.47 |
| 2017年4月 | 0.59 |

| | |
|---|---|
| 2023年3月 | 1.23 |
| 2023年2月 | 1.20 |
| 2023年1月 | 1.15 |
| 2022年12月 | -4.91 |
| 2022年11月 | -3.04 |
| 2022年10月 | 2.93 |
| 2022年9月 | -0.89 |
| 2022年8月 | -1.20 |
| 2022年7月 | 0.66 |
| 2022年6月 | 2.37 |
| 2022年5月 | -0.61 |
| 2022年4月 | 0.19 |

| | |
|---|---|
| 2020年3月 | 0.12 |
| 2020年2月 | 1.16 |
| 2020年1月 | 0.78 |
| 2019年12月 | 0.44 |
| 2019年11月 | 0.03 |
| 2019年10月 | 0.96 |
| 2019年9月 | 0.46 |
| 2019年8月 | 0.64 |
| 2019年7月 | 0.28 |
| 2019年6月 | 1.28 |
| 2019年5月 | -0.82 |
| 2019年4月 | -0.30 |

| | |
|---|---|
| 2017年3月 | -0.01 |
| 2017年2月 | -0.54 |
| 2017年1月 | -2.42 |
| 2016年12月 | 3.10 |
| 2016年11月 | 4.00 |
| 2016年10月 | 0.15 |
| 2016年9月 | -1.93 |
| 2016年8月 | -0.75 |
| 2016年7月 | 1.61 |
| 2016年6月 | -5.56 |
| 2016年5月 | 0.85 |
| 2016年4月 | -3.19 |

※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、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、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、今後の成果を保証・約束するものではありません。