

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・エマージング・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 | 13,805円 |
| 純資産総額 | 82.78億円 |

* 既出分配金累計：0円

◆資産構成

| | |
|------|--------|
| 債券 | 95.79% |
| 債券先物 | 0.00% |
| 債券実質 | 95.79% |
| 現金等 | 4.21% |

* 比率は純資産総額対比です。
(ベビーフ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。

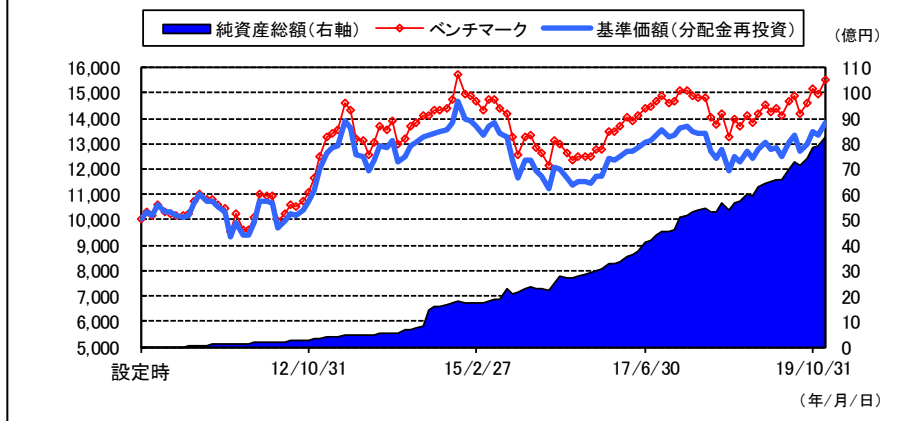
◆ポートフォリオプロフィール

| | ファンド | ベンチマーク |
|------------|-------|--------|
| 残存年数(年) | 7.76 | 7.60 |
| デュレーション(年) | 5.45 | 5.36 |
| 複利回り | 5.09% | 5.18% |

* ファンドの数値はベビーフ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(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・エマージング・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、大和証券投資信託委託株式会社が計算したものです。



◆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) | 6.12% | 5.49% | 11.10% | 3.63% | -0.22% | - | 3.15% |
| ベンチマーク収益率 | 6.06% | 5.98% | 12.20% | 4.73% | 0.73% | - | 4.45% |
| 差異 | 0.06% | -0.48% | -1.10% | -1.10% | -0.95% | - | -1.30% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | ----- | ----- | 10.16% | 9.29% | 10.46% | - | 12.17% |
| ベンチマークリスク | ----- | ----- | 9.78% | 9.30% | 10.50% | - | 12.32% |

* 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。

◆通貨別構成比

| 通貨 | ファンドウエート |
|------------|----------|
| ブラジル・リアル | 10.01% |
| メキシコ・ペソ | 10.00% |
| インドネシア・ルピア | 9.76% |
| 南アフリカ・ランド | 9.45% |
| タイ・バーツ | 9.33% |
| その他 | 51.46% |

* 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 | ファンドウエート |
|------------|----------|
| 1年未満 | 0.00% |
| 1年以上～3年未満 | 20.23% |
| 3年以上～7年未満 | 36.07% |
| 7年以上～10年未満 | 18.38% |
| 10年以上 | 25.32% |

* 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。

◆過去3ヶ月間のパフォーマンス分析

債券価格は投資対象国ごとにまちまちの動きとなりました。債券からの利息収入や、多くの投資対象国の通貨が対円で上昇したことがプラスに寄与した結果、基準価額は上昇しました。

◆組入上位銘柄

(組入銘柄数 208)

| 銘柄名 | ファンドウエート | 通貨 | 残存年数 |
|--|----------|-----------|-------|
| 1 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1.70% | 南アフリカ・ランド | 6.98 |
| 2 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 1.58% | ブラジル・リアル | 3.00 |
| 3 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 1.48% | ブラジル・リアル | 7.00 |
| 4 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 1.27% | ブラジル・リアル | 5.00 |
| 5 Brazil Letras do Tesouro Nacional | 1.24% | ブラジル・リアル | 3.50 |
| 6 Poland Government Bond | 1.19% | ポーランド・ズロチ | 6.57 |
| 7 Colombian TES | 1.15% | コロンビア・ペソ | 4.57 |
| 8 Brazil Letras do Tesouro Nacional | 1.13% | ブラジル・リアル | 2.01 |
| 9 Poland Government Bond | 1.11% | ポーランド・ズロチ | 8.32 |
| 10 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1.05% | 南アフリカ・ランド | 28.16 |

* ファンドウエートは当ファンドの対純資産総額比です。

■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、大和証券投資信託委託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。■JPモルガン 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 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.