

## ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

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 ..... 国内債券
- ・ベンチマーク ..... ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数
- ・目標とする運用成果 .. ベンチマークの動きに連動させる運用を目指します。

## ◆基準価額・純資産総額

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 11,221円 |
| 純資産総額 | 73.28億円 |

\* 既出分配金累計：50円

## ◆資産構成

|      |        |
|------|--------|
| 債券   | 98.96% |
| 債券先物 | 0.00%  |
| 債券実質 | 98.96% |
| 現金等  | 1.04%  |

\* 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。）

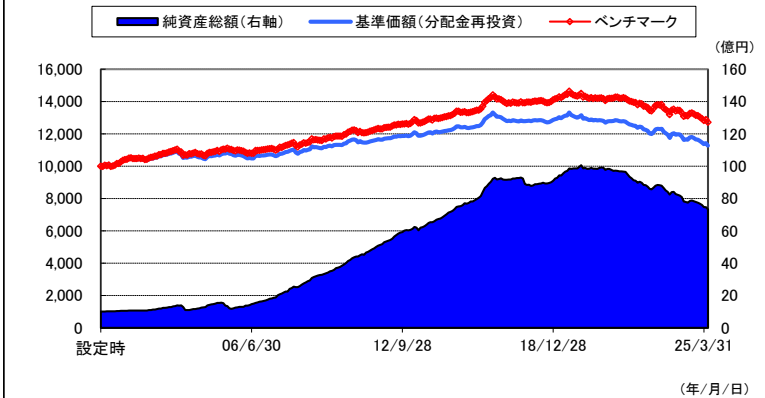
## ◆ポートフォリオプロフィール

|            | ファンド  | ベンチマーク |
|------------|-------|--------|
| 残存年数(年)    | 9.28  | 9.24   |
| デュレーション(年) | 8.26  | 8.23   |
| 複利利回り      | 1.43% | 1.43%  |

\* 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（2000/4/28）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。



## ◆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） | -1.76% | -3.29% | -3.03% | -3.36% | -2.67% | -0.92% | 0.48%  |
| ベンチマーク収益率       | -1.71% | -3.18% | -2.80% | -2.98% | -2.25% | -0.46% | 0.97%  |
| 差異              | -0.05% | -0.11% | -0.23% | -0.37% | -0.43% | -0.47% | -0.49% |
| ファンドリスク（分配金再投資） | -----  | -----  | 2.43%  | 3.03%  | 2.48%  | 2.35%  | 2.09%  |
| ベンチマークリスク       | -----  | -----  | 2.45%  | 3.05%  | 2.49%  | 2.36%  | 2.10%  |

\* 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。

## ◆公社債種別構成比

| 種別    | ファンドウェイト |
|-------|----------|
| 国債    | 84.57%   |
| 事業債   | 7.28%    |
| 地方債   | 5.54%    |
| 政府保証債 | 1.10%    |
| 円建外債  | 0.38%    |
| その他   | 0.08%    |

\* 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       | 0.00%    |
| 1年以上～3年未満  | 21.72%   |
| 3年以上～7年未満  | 29.62%   |
| 7年以上～10年未満 | 17.37%   |
| 10年以上      | 31.30%   |

\* 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10銘柄

（組入銘柄数 435）

|    | 銘柄名       | ファンドウェイト | 残存年数 |
|----|-----------|----------|------|
| 1  | 370 10年国債 | 1.12%    | 7.8  |
| 2  | 150 5年国債  | 1.06%    | 1.6  |
| 3  | 365 10年国債 | 1.04%    | 6.6  |
| 4  | 158 5年国債  | 0.98%    | 2.8  |
| 5  | 360 10年国債 | 0.95%    | 5.3  |
| 6  | 349 10年国債 | 0.94%    | 2.6  |
| 7  | 364 10年国債 | 0.92%    | 6.3  |
| 8  | 154 5年国債  | 0.90%    | 2.3  |
| 9  | 368 10年国債 | 0.89%    | 7.3  |
| 10 | 149 5年国債  | 0.87%    | 1.3  |

\* 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

債券価格が下落（金利は上昇）したことなどがマイナス要因となり、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。■ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。