

## ダイワ投信倶楽部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  | 30,315円  |
| 純資産総額 | 221.03億円 |

\* 既出分配金累計：50円

## ◆資産構成

|      |        |
|------|--------|
| 債券   | 97.00% |
| 債券先物 | 0.00%  |
| 債券実質 | 97.00% |
| 現金等  | 3.00%  |

\* 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。

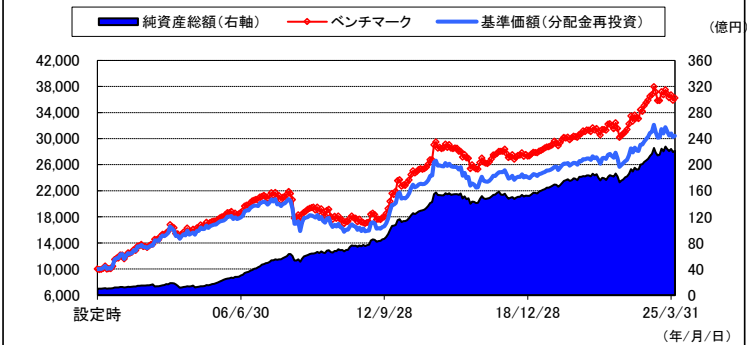
## ◆ポートフォリオプロフィール

|            | ファンド  | ベンチマーク |
|------------|-------|--------|
| 残存年数(年)    | 8.18  | 8.90   |
| デュレーション(年) | 6.30  | 6.25   |
| 複利利回り      | 3.46% | 3.46%  |

\* 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(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。
- ・ベンチマークは、投資信託の基準価額算出方法に合わせ、一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) | -0.19% | -1.24% | -2.03% | 4.21%  | 3.55%  | 1.49%  | 4.54%  |
| ベンチマーク収益率       | -0.12% | -1.27% | -1.39% | 5.03%  | 4.28%  | 2.20%  | 5.31%  |
| 差異              | -0.07% | 0.03%  | -0.64% | -0.82% | -0.73% | -0.72% | -0.77% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | -----  | -----  | 9.02%  | 7.90%  | 6.69%  | 6.37%  | 8.66%  |
| ベンチマークリスク       | -----  | -----  | 8.25%  | 7.71%  | 6.44%  | 6.05%  | 8.54%  |

\* 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       | ファンド ウェイト |
|----------|-----------|
| 米ドル      | 45.76%    |
| ユーロ      | 30.26%    |
| オフショア人民元 | 11.37%    |
| 英ポンド     | 5.53%     |
| カナダ・ドル   | 1.95%     |
| その他      | 5.13%     |

\* ファンドウェイトは当ファンドの対純資産総額比です。

## ◆組入上位銘柄

(組入銘柄数 1045)

|    | 銘柄名                              | ファンドウェイト | 通貨       | 残存年数 |
|----|----------------------------------|----------|----------|------|
| 1  | CHINA GOVERNMENT BOND            | 0.51%    | オフショア人民元 | 1.96 |
| 2  | United States Treasury Note/Bond | 0.48%    | 米ドル      | 2.96 |
| 3  | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.46%    | 米ドル      | 8.22 |
| 4  | CHINA GOVERNMENT BOND            | 0.44%    | オフショア人民元 | 3.88 |
| 5  | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.43%    | 米ドル      | 8.46 |
| 6  | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.43%    | 米ドル      | 9.22 |
| 7  | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.43%    | 米ドル      | 8.72 |
| 8  | United States Treasury Note/Bond | 0.39%    | 米ドル      | 5.72 |
| 9  | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.38%    | 米ドル      | 9.46 |
| 10 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND | 0.37%    | 米ドル      | 9.72 |

\* 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       | 1.18%     |
| 1年以上～3年未満  | 27.85%    |
| 3年以上～7年未満  | 34.68%    |
| 7年以上～10年未満 | 13.58%    |
| 10年以上      | 22.70%    |

\* 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。

## ◆過去3ヶ月間のパフォーマンス分析

債券市場で金利は上昇し、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。