

明治安田DC外国債券オープン (愛称:DC夢実現)

◆ファンドの特色

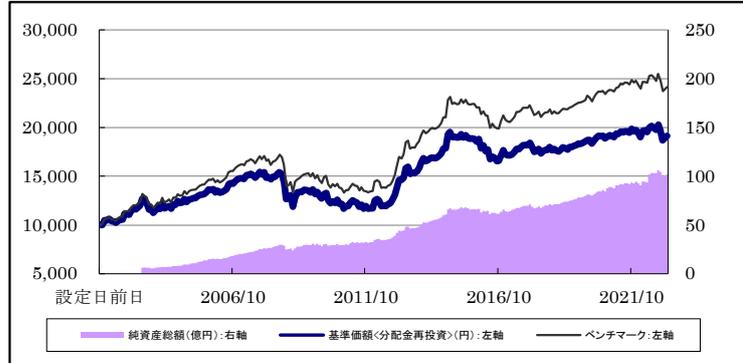
元本確保型の商品ではありません

- ・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を上回る運用成果を目指します

◆基準価額、純資産総額

| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 19,062円 |
| 純資産総額 | 101億円 |

◆基準価額の推移グラフ



※基準価額 (分配金再投資) は信託報酬控除後のものであり、ファンド設定時を10,000円としてスタートし分配金を再投資したものと算出しています。ベンチマークは、設定日前日を10000円として指数化しています。

◆資産構成

| | |
|------|-------|
| 債券 | 98.3% |
| 債券先物 | — |
| 債券実質 | 98.3% |
| 現金等 | 1.7% |

※比率は純資産総額対比

◆為替ヘッジ

| | |
|---------|---|
| 為替ヘッジ比率 | — |
|---------|---|

◆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 | 8.67年 | 9.07年 |
| デュレーション | 6.61年 | 6.82年 |
| 複利回り | 3.98% | 3.95% |

※マザーファンドベース

◆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カ月間 | 6カ月間 | 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) | -2.80% | -4.16% | 0.53% | 0.68% | 1.80% | 2.71% | 3.10% |
| ベンチマーク収益率 | -2.49% | -3.81% | 0.60% | 1.26% | 2.58% | 3.68% | 4.18% |
| 差異 | -0.31% | -0.35% | -0.07% | -0.58% | -0.78% | -0.97% | -1.08% |
| ファンドリスク (分配金再投資) | ----- | ----- | 8.35% | 5.75% | 4.98% | 6.72% | 8.37% |
| ベンチマークリスク | ----- | ----- | 7.78% | 5.41% | 4.74% | 6.60% | 8.38% |

※ファンド (分配金再投資) の収益率とは、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、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。

◆公社債通貨別構成比

| | 通貨 | ウェイト |
|---|-----------|--------|
| 1 | 米ドル | 49.90% |
| 2 | ユーロ | 33.19% |
| 3 | 中国元 | 4.29% |
| 4 | ポンド | 4.27% |
| 5 | オーストラリアドル | 1.88% |
| | その他 | 4.81% |

※ウェイトは純資産総額対比

◆分配金の実績

| 第17期 | 第18期 | 第19期 | 第20期 | 第21期 | 設定来 |
|------|------|------|------|------|-----|
| 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 40円 |

※分配金は10,000円あたりの金額 (円)。分配金は増減したり、支払われないことがあります。

◆公社債組入上位10銘柄

(組入銘柄数72銘柄)

| | 銘柄名 | ウェイト | 通貨 | 残存年数 |
|----|---------------------------------|-------|-----|--------|
| 1 | US TREASURY N/B 2.75% 27/4/30 | 8.56% | 米ドル | 4.17年 |
| 2 | DEUTSCHLAND REP 6.25% 24/1/4 | 6.51% | ユーロ | 0.85年 |
| 3 | US TREASURY N/B 1.875% 41/2/15 | 5.10% | 米ドル | 17.97年 |
| 4 | US TREASURY N/B 0.625% 30/5/15 | 4.22% | 米ドル | 7.21年 |
| 5 | US TREASURY N/B 2.625% 23/12/31 | 4.02% | 米ドル | 0.84年 |
| 6 | US TREASURY N/B 2% 24/5/31 | 3.82% | 米ドル | 1.25年 |
| 7 | CHINA GOVT BOND 3.02% 31/5/27 | 2.92% | 中国元 | 8.24年 |
| 8 | US TREASURY N/B 2.5% 24/5/15 | 2.69% | 米ドル | 1.21年 |
| 9 | US TREASURY N/B 2.625% 29/2/15 | 2.68% | 米ドル | 5.97年 |
| 10 | US TREASURY N/B 2.75% 32/8/15 | 2.68% | 米ドル | 9.46年 |

※ウェイトは純資産総額対比

◆過去3カ月間のパフォーマンス分析

当ファンドとベンチマークの過去3カ月間の収益率の差異は-0.31%となりました。12月~2月の投資行動を戦略的に説明します。ベンチマークに対して、デュレーションは国別には機動的に調整しつつ、ポートフォリオ全体で2月末は小幅に短期化としました。通貨別配分は11月末は米ドル、ユーロ、ノルウェークローネをオーバーウェイト、ポンド、デンマーククローネ、ニュージーランドドルをアンダーウェイトとしましたが、2月末は米ドル、ユーロ、オーストラリアドルをオーバーウェイト、ポンド、カナダドル、デンマーククローネ、ニュージーランドドルをアンダーウェイトとしました。パフォーマンスについては、プラス要因として金利選択、通貨選択などが、マイナス要因として銘柄選択、ベンチマークと基準価額算定時の適用為替レートの差異、ファンド運用上の諸コストなどが挙げられます。

■当資料は、法令に基づく開示資料ではありません。■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、加入者のみなさまに対して、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、株式など値動きのある証券等 (外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。) に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金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、明治安田アセットマネジメントが信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、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。■FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

明治安田DC外国債券オープン (愛称: DC夢実現)

＜リターン実績表＞ 単位%

設定日2001年11月30日

| | リターン | | リターン | | リターン | | リターン |
|----------|-------|----------|-------|----------|-------|----------|-------|
| 2023年 2月 | 1.09 | 2020年 2月 | 1.07 | 2017年 2月 | -0.67 | 2014年 2月 | 0.59 |
| 2023年 1月 | 1.25 | 2020年 1月 | 0.75 | 2017年 1月 | -2.36 | 2014年 1月 | -1.72 |
| 2022年12月 | -5.03 | 2019年12月 | 0.36 | 2016年12月 | 2.92 | 2013年12月 | 2.44 |
| 2022年11月 | -3.01 | 2019年11月 | -0.05 | 2016年11月 | 3.48 | 2013年11月 | 3.40 |
| 2022年10月 | 2.67 | 2019年10月 | 0.87 | 2016年10月 | 0.12 | 2013年10月 | 2.46 |
| 2022年 9月 | -0.99 | 2019年 9月 | 0.36 | 2016年 9月 | -2.01 | 2013年 9月 | 1.32 |
| 2022年 8月 | -0.97 | 2019年 8月 | 0.61 | 2016年 8月 | -0.71 | 2013年 8月 | -0.45 |
| 2022年 7月 | 0.88 | 2019年 7月 | 0.21 | 2016年 7月 | 1.68 | 2013年 7月 | 0.66 |
| 2022年 6月 | 2.24 | 2019年 6月 | 1.27 | 2016年 6月 | -5.66 | 2013年 6月 | -4.42 |
| 2022年 5月 | -0.75 | 2019年 5月 | -0.77 | 2016年 5月 | 0.92 | 2013年 5月 | 1.02 |
| 2022年 4月 | 0.08 | 2019年 4月 | -0.34 | 2016年 4月 | -3.24 | 2013年 4月 | 6.77 |
| 2022年 3月 | 3.39 | 2019年 3月 | 1.11 | 2016年 3月 | 1.77 | 2013年 3月 | 1.23 |
| 2022年 2月 | -1.86 | 2019年 2月 | 1.28 | 2016年 2月 | -5.03 | | |
| 2022年 1月 | -1.70 | 2019年 1月 | -0.67 | 2016年 1月 | 1.35 | | |
| 2021年12月 | 0.64 | 2018年12月 | -0.80 | 2015年12月 | -1.42 | | |
| 2021年11月 | -1.38 | 2018年11月 | 0.73 | 2015年11月 | -0.22 | | |
| 2021年10月 | 1.97 | 2018年10月 | -1.76 | 2015年10月 | 0.18 | | |
| 2021年 9月 | -0.52 | 2018年 9月 | 1.67 | 2015年 9月 | -0.46 | | |
| 2021年 8月 | -0.10 | 2018年 8月 | -0.16 | 2015年 8月 | -1.58 | | |
| 2021年 7月 | 0.48 | 2018年 7月 | 0.68 | 2015年 7月 | 1.33 | | |
| 2021年 6月 | -0.24 | 2018年 6月 | 1.48 | 2015年 6月 | -1.68 | | |
| 2021年 5月 | 1.09 | 2018年 5月 | -2.61 | 2015年 5月 | 1.62 | | |
| 2021年 4月 | -0.11 | 2018年 4月 | 1.19 | 2015年 4月 | 0.01 | | |
| 2021年 3月 | 2.02 | 2018年 3月 | 0.53 | 2015年 3月 | -0.37 | | |
| 2021年 2月 | -0.81 | 2018年 2月 | -2.64 | 2015年 2月 | 0.25 | | |
| 2021年 1月 | -0.32 | 2018年 1月 | -2.45 | 2015年 1月 | -2.65 | | |
| 2020年12月 | 0.77 | 2017年12月 | 1.20 | 2014年12月 | 1.00 | | |
| 2020年11月 | 0.97 | 2017年11月 | 0.04 | 2014年11月 | 8.34 | | |
| 2020年10月 | -1.51 | 2017年10月 | -0.02 | 2014年10月 | 0.05 | | |
| 2020年 9月 | 0.25 | 2017年 9月 | 1.02 | 2014年 9月 | 2.73 | | |
| 2020年 8月 | -0.10 | 2017年 8月 | 1.38 | 2014年 8月 | 1.45 | | |
| 2020年 7月 | 1.02 | 2017年 7月 | -0.14 | 2014年 7月 | 1.06 | | |
| 2020年 6月 | 1.60 | 2017年 6月 | 1.80 | 2014年 6月 | 0.33 | | |
| 2020年 5月 | 1.55 | 2017年 5月 | 1.47 | 2014年 5月 | -0.32 | | |
| 2020年 4月 | -1.86 | 2017年 4月 | 0.55 | 2014年 4月 | 0.37 | | |
| 2020年 3月 | -0.20 | 2017年 3月 | 0.01 | 2014年 3月 | 1.38 | | |

※月末の基準価額にて算出

※リターンは月次の騰落率を掲載

※基準価額は、分配金を再投資して算出

■当資料は、法令に基づく開示資料ではありません。■「明治安田DC外国債券オープン」の受益権の募集については、委託会社は、法令の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■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、加入者のみなさまに対して、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、株式など値動きのある証券等（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金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、明治安田アセットマネジメントが信頼できると判断した諸データに基づいてジャパン・ペンション・ナビゲーター株式会社が作成しましたが、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。