

明治安田DC日本債券オープン(愛称:DCLあわせ宣言)

◆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・・・国内債券
- ・ベンチマーク・・・NOMURA-BPI総合指数
- ・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
- ・信託報酬率・・・純資産総額の年0.66%(税抜 0.6%)以内 当期(第24期):年0.55%(税抜 0.5%)

◆基準価額、純資産総額

基準価額	11,952円
純資産総額	161億円

◆資産構成

債券	98.1%
債券先物	—
債券実質	98.1%
現金等	1.9%

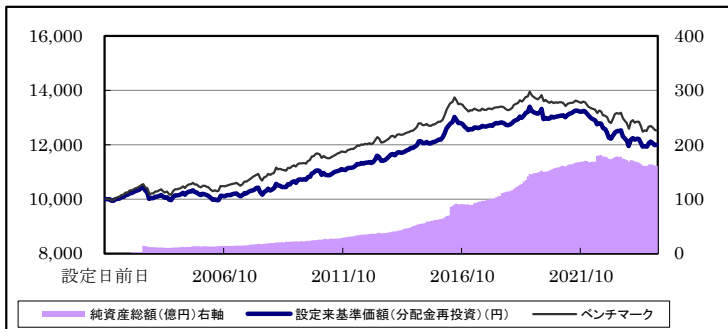
※上記数値はマザーファンドへの投資を通じた純資産総額の比率です。

◆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	10.62年	10.26年
デュレーション	8.80年	8.71年
複利回り	1.92%	1.10%

※繰上償還条項が付与されている場合、最初の繰上償還可能日を基準に計算

◆基準価額の推移グラフ



※ベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)は設定日前日(2001年11月29日)を10,000として指数化  
※設定来基準価額(分配金再投資)は信託報酬控除後のものであり、分配金を再投資したものと算出  
※グラフは月末値

◆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)	-1.03%	0.38%	-2.04%	-3.19%	-1.80%	-0.11%	0.79%
ベンチマーク収益率	-1.31%	0.03%	-2.92%	-2.58%	-1.73%	-0.20%	0.98%
差異	0.28%	0.35%	0.88%	-0.61%	-0.07%	0.09%	-0.19%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	2.36%	2.83%	2.68%	2.36%	2.15%
ベンチマークリスク	-----	-----	2.57%	2.89%	2.50%	2.27%	2.08%

※ファンド(分配金再投資)、ベンチマークの収益率は、原則として年換算して表示しますが、1年に満たないものについては年換算していません。  
※ファンド(分配金再投資)の収益率は、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。

◆公社債種別構成比

種別	組入比率
国債	36.98%
政保債	—
地方債	—
金融債	—
事業債等	61.56%

※組入比率はマザーファンドの純資産総額に対する比率です。

◆分配金の実績

第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	設定来
0円	0円	0円	0円	0円	40円

※分配金は10,000口あたりの金額(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

銘柄名	組入比率	残存年数
1 第376回利付国債10年	6.14%	9.72年
2 第83回利付国債30年	4.03%	29.47年
3 第2回武田薬品工業無担保社債(劣後特約付)	3.90%	4.48年
4 第3回野村ホールディングス無担保永久社債(劣後特約付)	3.88%	1.54年
5 第1回住友化学無担保社債(劣後特約付)	3.63%	4.95年
6 第9回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債(劣後特約付)	3.56%	1.96年
7 第18回光通信無担保社債	2.87%	8.23年
8 第366回利付国債10年	2.80%	7.22年
9 第174回利付国債5年	2.55%	4.72年
10 2015第1回ソシエテジェネラル円貨社債(劣後特約付)	2.51%	0.45年

※組入比率はマザーファンドの純資産総額に対する比率です。  
※残存年数は、繰上償還条項が付与されている場合、最初の繰上償還可能日を基準に計算

◆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+0.28%となりました。10月~12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、デュレーション(投資元本の平均回収期間)は10月末および11月末は短期化、12月末は小幅に長期化としました。保有債券の年限別構成は年限間の割高・割安に着目したポートフォリオ構成としました。種別選択は事業債・円建外債などをオーバ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(11月~12月)、種別選択(10月~12月)、銘柄選択(10月~12月)などが、マイナス要因として、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。■「明治安田DC日本債券オープン」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。■NOMURA-BPIに関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

明治安田DC日本債券オープン（愛称：DCLしあわせ宣言）

	リターン
設定来	19.99

設定日2001年11月30日

＜リターン実績表＞ 単位%

	リターン
2024年12月	0.06
2024年11月	-0.57
2024年10月	-0.51
2024年 9月	0.52
2024年 8月	1.03
2024年 7月	-0.13
2024年 6月	0.25
2024年 5月	-1.45
2024年 4月	-0.98
2024年 3月	-0.08
2024年 2月	0.35
2024年 1月	-0.52

	リターン
2021年12月	-0.16
2021年11月	0.22
2021年10月	-0.07
2021年 9月	-0.23
2021年 8月	-0.06
2021年 7月	0.46
2021年 6月	0.29
2021年 5月	0.14
2021年 4月	0.37
2021年 3月	0.66
2021年 2月	-0.58
2021年 1月	-0.05

	リターン
2018年12月	0.56
2018年11月	0.37
2018年10月	0.23
2018年 9月	-0.14
2018年 8月	-0.45
2018年 7月	-0.27
2018年 6月	0.09
2018年 5月	0.18
2018年 4月	-0.07
2018年 3月	0.28
2018年 2月	0.51
2018年 1月	-0.09

	リターン
2015年12月	0.68
2015年11月	-0.02
2015年10月	0.36
2015年 9月	0.27
2015年 8月	0.16
2015年 7月	0.34
2015年 6月	0.02
2015年 5月	-0.48
2015年 4月	0.39
2015年 3月	-0.02
2015年 2月	-0.55
2015年 1月	0.02

2023年12月	0.49
2023年11月	1.96
2023年10月	-1.57
2023年 9月	-0.74
2023年 8月	-0.58
2023年 7月	-1.77
2023年 6月	0.19
2023年 5月	0.05
2023年 4月	0.28
2023年 3月	1.03
2023年 2月	0.91
2023年 1月	-0.34

2020年12月	0.21
2020年11月	0.25
2020年10月	-0.04
2020年 9月	0.30
2020年 8月	-0.25
2020年 7月	0.53
2020年 6月	0.09
2020年 5月	-0.29
2020年 4月	0.31
2020年 3月	-2.77
2020年 2月	0.90
2020年 1月	0.49

2017年12月	0.09
2017年11月	0.26
2017年10月	0.02
2017年 9月	-0.27
2017年 8月	0.48
2017年 7月	0.11
2017年 6月	-0.09
2017年 5月	-0.06
2017年 4月	0.54
2017年 3月	-0.02
2017年 2月	0.26
2017年 1月	-0.49

2022年12月	-1.60
2022年11月	-0.91
2022年10月	-0.25
2022年 9月	-1.25
2022年 8月	-0.16
2022年 7月	0.32
2022年 6月	-1.16
2022年 5月	-0.26
2022年 4月	-0.32
2022年 3月	-0.54
2022年 2月	-0.68
2022年 1月	-0.65

2019年12月	-0.22
2019年11月	-0.31
2019年10月	-0.33
2019年 9月	-1.12
2019年 8月	1.46
2019年 7月	0.20
2019年 6月	0.74
2019年 5月	0.69
2019年 4月	-0.29
2019年 3月	0.73
2019年 2月	0.22
2019年 1月	0.33

2016年12月	-0.59
2016年11月	-0.65
2016年10月	-0.33
2016年 9月	0.05
2016年 8月	-0.92
2016年 7月	-0.79
2016年 6月	1.39
2016年 5月	0.39
2016年 4月	0.76
2016年 3月	0.75
2016年 2月	1.45
2016年 1月	1.24

※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日本債券オープン」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。■NOMURA-BPIIに関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。