

インデックスファンド海外新興国(エマージング)債券(1年決算型)  
(愛称:DC インデックス海外新興国債券)

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 … 新興国の公社債
- ・ベンチマーク … JPMorgan・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・ディバーシファイド(円ヘッジなし・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めざします。

◆基準価額と純資産総額

|       |         |
|-------|---------|
| 基準価額  | 12,220円 |
| 純資産総額 | 63.25億円 |

◆資産構成

|       |        |
|-------|--------|
| 債券    | 96.99% |
| 債券先物  | 0.00%  |
| 債券実質  | 96.99% |
| 現金その他 | 3.01%  |

※当ファンドの実質の組入比率です。

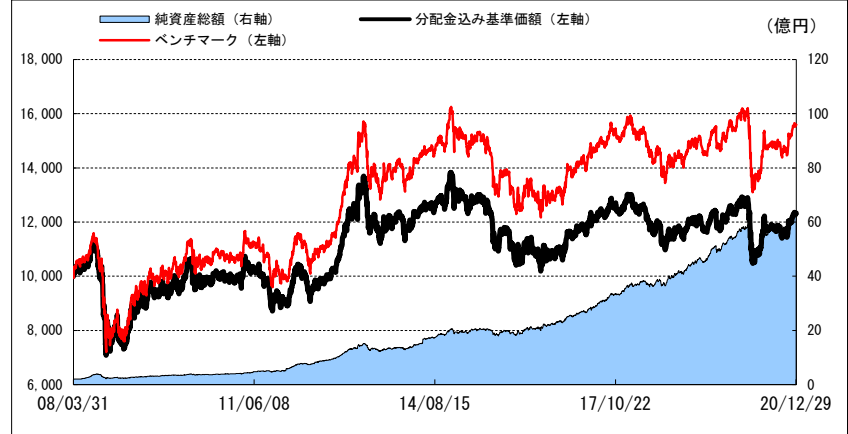
◆為替ヘッジ

|        |       |
|--------|-------|
| 為替ヘッジ率 | 0.00% |
|--------|-------|

◆ベンチマークデータ

|         | ベンチマーク |
|---------|--------|
| 残存年数    | 7.27年  |
| デュレーション | 5.37年  |
| 複利回り    | 4.21%  |

◆基準価額の推移グラフ



※基準価額、ベンチマークは設定日(2008年4月1日)の前営業日を10,000として指数化しています。

◆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ヵ月間   | 6ヵ月間   | 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) | 7.45%  | 4.92%  | -3.78% | -1.15% | 1.97%  | 2.35%  | 1.45%  |
| ベンチマーク収益率       | 7.74%  | 5.55%  | -2.70% | 0.06%  | 3.28%  | 4.04%  | 3.18%  |
| 差異              | -0.28% | -0.63% | -1.08% | -1.21% | -1.31% | -1.69% | -1.73% |
| ファンドリスク(分配金再投資) |        |        | 16.96% | 12.99% | 11.49% | 12.69% | 14.12% |
| ベンチマークリスク       |        |        | 17.23% | 13.09% | 11.59% | 12.96% | 14.41% |

※収益率は、1年以上の場合、年率ベースで、1年未満(3ヵ月間、6ヵ月間)は、年率換算していません。

※ファンド(分配金再投資)の収益率は、当ファンド決算時に分配金があった場合の分配金を再購入(再投資)し、算出しています。

※収益率・リスクともに月次の収益率より算出しています。設定日が月中の場合、設定日が属する月は含んでいません。

※上記表およびグラフ使用のベンチマークは、前日(土、日等を除く)のドルベースインデックスを当日のファンドで採用しているレートで円換算しており、投資信託の基準価額算出方式に合わせています。

◆公社債通貨構成比

| 通貨          | ウェイト   |
|-------------|--------|
| 1 インドネシアルピア | 9.26%  |
| 2 メキシコペソ    | 9.04%  |
| 3 中国元       | 8.68%  |
| 4 ブラジルレアル   | 8.35%  |
| 5 タイバーツ     | 8.26%  |
| その他         | 53.41% |

※ウェイトはマザー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  | ウェイト   |
|-------|--------|
| 1年未満  | 0.00%  |
| 1~3年  | 21.82% |
| 3~7年  | 36.31% |
| 7~10年 | 17.62% |
| 10年以上 | 21.25% |

※ウェイトはマザーファンドの対純資産総額比です。

◆公社債組入上位10銘柄(組入銘柄数 241銘柄)

| 銘柄名                        | 種別 | クーポン  | ウェイト  | 通貨       | 残存年数   |
|----------------------------|----|-------|-------|----------|--------|
| 1 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債 | 10.5% | 1.47% | 南アフリカランド | 5.98年  |
| 2 LETRA TESOURO NACIONAL   | 国債 | 0%    | 1.42% | ブラジルレアル  | 2.50年  |
| 3 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10%   | 1.35% | ブラジルレアル  | 2.01年  |
| 4 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10%   | 1.27% | ブラジルレアル  | 4.01年  |
| 5 NOTA DO TESOURO NACIONAL | 国債 | 10%   | 1.00% | ブラジルレアル  | 6.01年  |
| 6 MEX BONOS DESARR FIX RT  | 国債 | 8.5%  | 0.96% | メキシコペソ   | 8.42年  |
| 7 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債 | 8%    | 0.94% | 南アフリカランド | 9.09年  |
| 8 POLAND GOVERNMENT BOND   | 国債 | 2.5%  | 0.94% | ポーランドズロチ | 5.57年  |
| 9 REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債 | 8.75% | 0.94% | 南アフリカランド | 27.18年 |
| 10 TITULOS DE TESORERIA B  | 国債 | 7.5%  | 0.93% | コロンビアペソ  | 5.66年  |

※ウェイトはマザーファンドの対純資産総額比です。

■当資料は、金融商品取引法に基づく開示資料ではありません。■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、債券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。特に投資する新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。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、日興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。■「JPMorgan・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・ディバーシファイド(円ヘッジなし・円ベース)」に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、JPMorgan Chase & Co.に帰属します。

確定拠出年金向け説明資料

基準日 2020年12月30日

運営管理機関：ソニー生命保険株式会社

インデックスファンド海外新興国(エマージング)債券(1年決算型)  
(愛称:DC インデックス海外新興国債券)

< リターン実績表 >

単位%

設定日 2008年4月1日

| 年月       | リターン   | 年月       | リターン  | 年月       | リターン  | 年月       | リターン  |
|----------|--------|----------|-------|----------|-------|----------|-------|
| 2020年12月 | 2.60   | 2017年12月 | 2.60  | 2014年12月 | -4.94 | 2011年12月 | -0.19 |
| 2020年11月 | 4.99   | 2017年11月 | 0.43  | 2014年11月 | 6.47  | 2011年11月 | -4.47 |
| 2020年10月 | -0.25  | 2017年10月 | -2.13 | 2014年10月 | 2.02  | 2011年10月 | 5.88  |
| 2020年9月  | -2.39  | 2017年9月  | 1.39  | 2014年9月  | 0.13  | 2011年9月  | -9.66 |
| 2020年8月  | 0.05   | 2017年8月  | 1.45  | 2014年8月  | 0.37  | 2011年8月  | -1.65 |
| 2020年7月  | -0.02  | 2017年7月  | 0.48  | 2014年7月  | 0.81  | 2011年7月  | -2.27 |
| 2020年6月  | 0.94   | 2017年6月  | 1.70  | 2014年6月  | 0.28  | 2011年6月  | 0.16  |
| 2020年5月  | 6.19   | 2017年5月  | 1.33  | 2014年5月  | 1.73  | 2011年5月  | -2.72 |
| 2020年4月  | 2.03   | 2017年4月  | -0.10 | 2014年4月  | 0.90  | 2011年4月  | 3.03  |
| 2020年3月  | -13.33 | 2017年3月  | 1.68  | 2014年3月  | 3.20  | 2011年3月  | 3.91  |
| 2020年2月  | -2.03  | 2017年2月  | 1.33  | 2014年2月  | 2.11  | 2011年2月  | 0.85  |
| 2020年1月  | -1.24  | 2017年1月  | -0.65 | 2014年1月  | -6.39 | 2011年1月  | -0.33 |
| 2019年12月 | 3.74   | 2016年12月 | 5.68  | 2013年12月 | 1.94  |          |       |
| 2019年11月 | -1.48  | 2016年11月 | 0.11  | 2013年11月 | -0.69 |          |       |
| 2019年10月 | 3.77   | 2016年10月 | 2.39  | 2013年10月 | 4.78  |          |       |
| 2019年9月  | 2.68   | 2016年9月  | -0.64 | 2013年9月  | 3.16  |          |       |
| 2019年8月  | -4.83  | 2016年8月  | -0.06 | 2013年8月  | -4.19 |          |       |
| 2019年7月  | 1.59   | 2016年7月  | 1.04  | 2013年7月  | -0.83 |          |       |
| 2019年6月  | 4.42   | 2016年6月  | -2.21 | 2013年6月  | -7.56 |          |       |
| 2019年5月  | -2.53  | 2016年5月  | -3.15 | 2013年5月  | -2.09 |          |       |
| 2019年4月  | 0.42   | 2016年4月  | -0.49 | 2013年4月  | 7.20  |          |       |
| 2019年3月  | -1.82  | 2016年3月  | 7.67  | 2013年3月  | 0.56  |          |       |
| 2019年2月  | 2.15   | 2016年2月  | -4.41 | 2013年2月  | 1.51  |          |       |
| 2019年1月  | 2.43   | 2016年1月  | -1.46 | 2013年1月  | 5.27  |          |       |
| 2018年12月 | -1.87  | 2015年12月 | -3.47 | 2012年12月 | 7.43  |          |       |
| 2018年11月 | 2.88   | 2015年11月 | -0.10 | 2012年11月 | 4.31  |          |       |
| 2018年10月 | -1.66  | 2015年10月 | 5.58  | 2012年10月 | 2.69  |          |       |
| 2018年9月  | 4.75   | 2015年9月  | -5.21 | 2012年9月  | 2.13  |          |       |
| 2018年8月  | -6.57  | 2015年8月  | -6.92 | 2012年8月  | -0.44 |          |       |
| 2018年7月  | 3.02   | 2015年7月  | -1.41 | 2012年7月  | 2.42  |          |       |
| 2018年6月  | -2.13  | 2015年6月  | -2.65 | 2012年6月  | 3.41  |          |       |
| 2018年5月  | -5.35  | 2015年5月  | 0.69  | 2012年5月  | -9.30 |          |       |
| 2018年4月  | -0.45  | 2015年4月  | 2.46  | 2012年4月  | -0.73 |          |       |
| 2018年3月  | -0.25  | 2015年3月  | -2.50 | 2012年3月  | -0.19 |          |       |
| 2018年2月  | -1.39  | 2015年2月  | -1.27 | 2012年2月  | 8.83  |          |       |
| 2018年1月  | 0.02   | 2015年1月  | -0.63 | 2012年1月  | 4.84  |          |       |

※リターンは、分配金込み基準価額の月次騰落率を掲載しています。

■当資料は、金融商品取引法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、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、債券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。特に投資する新興国の債券は、先進国の債券に比べて価格変動が大きくなる傾向があり、基準価額にも大きな影響を与える場合があります。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、購入者に帰属します。■当資料は、日興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運営管理機関によっ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。