

## DIAM国内債券パッシブ・ファンド

追加型投信 / 国内 / 債券(インデックス型)

月次運用レポート  
2012年5月

### 商品の特色(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

主に「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に投資を行い、「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

原則として、マザーファンドの組入比率は高位を維持します。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### 主なリスクと費用(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)

**投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、下記の主な変動要因により、基準価額が下落し、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。当ファンドの運用による損益は全て投資者の皆さまに帰属します。また、投資信託は預貯金と異なります。**

なお、基準価額の変動要因は、下記に限定されるものではありません。その他の留意点など、くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

**金利リスク...** 金利リスクとは、金利の変動を受けて債券の価格が変動するリスクをいいます。一般的に金利が上昇した場合には、債券の価格は下落します。当ファンドは実質的に債券に投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

**信用リスク...** 有価証券等への実質的投資にあたっては、発行者において利払いや償還金の支払いが遅延したり、支払いが滞るリスクが生じることがあります。

またこうした状況に陥ると予想される場合等には、当ファンドの基準価額の下落要因となる可能性があります。

当ファンドへの投資に伴う主な費用は、信託報酬などです。

費用の詳細につきましては、当資料中の「お客様にご負担いただく費用について」および投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

**当資料は4枚ものです。P.4の「当資料のお取扱いについてのご注意」を必ずご確認ください。**

設定・運用は

DIAMアセットマネジメント



商号等:

DIAMアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第324号

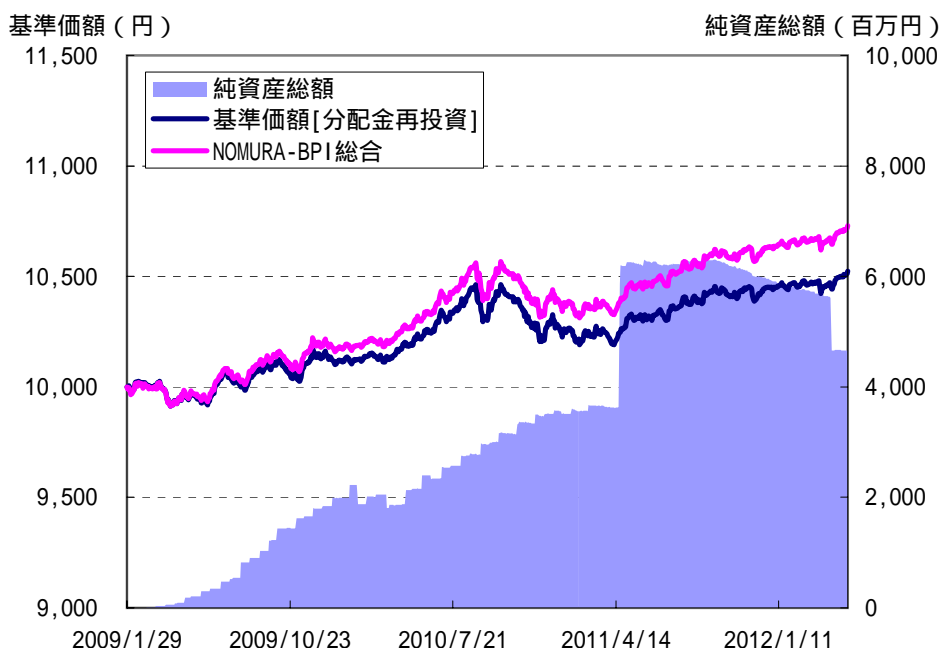
加入協会:

社団法人投資信託協会

社団法人日本証券投資顧問業協会

**DIAM国内債券パッシブ・ファンド  
追加型投信 / 国内 / 債券(インデックス型)  
月次運用レポート (2012年5月)**

**運用実績の推移**



NOMURA-BPI総合は2009年1月29日の終値を10,000として指数化しています。  
 基準価額[分配金再投資]は、税引前の分配金を再投資したものと計算していますので、実際の基準価額とは異なります。  
 $\text{基準価額[分配金再投資]} = \text{前日基準価額[分配金再投資]} \times (\text{当日基準価額} \div \text{前日基準価額})$   
 ( 決算日の当日基準価額は税引前分配金込み )  
 基準価額は信託報酬控除後です。なお、信託報酬率は「お客様にご負担いただく費用について」をご覧ください。  
 (設定日：2009年1月30日)  
 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。

**基準価額・純資産総額**

|       |           |
|-------|-----------|
| 基準価額  | 10,523 円  |
| 解約価額  | 10,523 円  |
| 純資産総額 | 4,662 百万円 |

**ポートフォリオ構成**

|          |        |
|----------|--------|
| 実質組入比率   | 99.6 % |
| 内現物等組入比率 | 99.6 % |
| 内先物等組入比率 | 0.0 %  |
| 現金等比率    | 0.4 %  |
| 組入銘柄数    | 616    |

比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

**分配金情報(税引前) 直近3年分**

|                      |     |
|----------------------|-----|
| 第1期 (2009.10.13) 分配金 | 0 円 |
| 第2期 (2010.10.12) 分配金 | 0 円 |
| 第3期 (2011.10.12) 分配金 | 0 円 |
| 累計分配金                | 0 円 |

- 1 分配金は1万口当たり
- 2 上記の分配金は過去の実績であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 3 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決めます。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

**騰落率(税引前分配金再投資)**

|              | 1ヵ月<br>(2012/03/30) | 3ヵ月<br>(2012/01/31) | 6ヵ月<br>(2011/10/31) | 1年<br>(2011/04/28) | 2年<br>(2010/04/30) | 3年<br>(2009/04/30) |
|--------------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 当ファンド        | 0.49%               | 0.55%               | 1.19%               | 2.45%              | 3.24%              | 5.60%              |
| NOMURA-BPI総合 | 0.52%               | 0.69%               | 1.49%               | 3.07%              | 4.46%              | 7.64%              |

- 1 当ファンドの騰落率は、税引前の分配金を再投資したものと算出しておりますので、実際の投資家利回りとは異なります。
- 2 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等をお約束するものではありません。

**ポートフォリオの状況**

|           | 当ファンド |
|-----------|-------|
| 平均複利利回り   | 0.67% |
| 平均クーポン    | 1.46% |
| 平均残存期間    | 8.29  |
| 修正デュレーション | 7.24  |

純資産総額を元に計算しております。

**組入債券セクター別構成比**

|      | 当ファンド  |
|------|--------|
| 国債   | 77.89% |
| 地方債  | 6.77%  |
| 金融債  | 1.24%  |
| 政保債  | 4.19%  |
| 社債   | 8.61%  |
| 円建外債 | 0.24%  |
| MBS  | 0.70%  |
| ABS  | 0.00%  |
| 合計   | 99.65% |

- 1 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。
- 2 当ファンドの社債構成比率には、転換社債を含む場合があります。

当資料は4枚ものです。  
 P.4の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。

**DIAM国内債券バッシブ・ファンド**  
**追加型投信 / 国内 / 債券(インデックス型)**  
 月次運用レポート(2012年5月)

**お申込みメモ(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)**

|                    |  |
|--------------------|--|
| 購入単位               | 各販売会社が定める単位(当初元本:1口=1円)  |
| 購入価額               | お申込日の基準価額とします。   |
| 購入代金               | お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに購入代金を販売会社に支払うものとします。  |
| 換金単位               | 各販売会社が定める単位  |
| 換金価額               | 換金のお申込日の基準価額とします。  |
| 換金代金               | 原則として換金のお申込日より起算して4営業日目から支払います。  |
| 申込締切時間             | 原則として販売会社の毎営業日の午後2時までとします。   |
| 換金制限               | 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金請求に制限を設ける場合があります。   |
| 購入・換金申込受付の中止および取消し | 金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情等があるときは、購入・換金のお申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた購入・換金のお申込みの受付を取り消す場合があります。  |
| 信託期間               | 無期限です。(設定日:2009年1月30日)   |
| 繰上償還               | 次のいずれかに該当する場合等には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し、当該信託を終了する場合があります。<br>受益権口数が10億口を下回ることとなった場合。<br>受益者のために有利であると認めるとき。<br>対象インデックスが改廃された場合。<br>やむを得ない事情が発生したとき。 |
| 決算日                | 原則として毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日)   |
| 収益分配               | 年1回、毎決算日に、収益分配方針に基づき、収益分配を行います。<br>「分配金受取コース」の場合、決算日から起算して原則として5営業日までにお支払いを開始します。<br>「分配金自動引き落とし投資コース」の場合、税引後、無手数料で自動的に全額が再投資されます。               |
| 課税関係               | 当ファンドは課税上は株式投資信託として取り扱われます。<br>原則として、分配時の普通分配金ならびに換金時の値上がり益および償還時の償還差益に対して課税されます。<br>税法が改正された場合等には、上記内容が変更となることがあります。                            |

**お客様にご負担いただく費用について(くわしくは投資信託説明書(交付目論見書)を必ずご覧ください)**

以下の手数料等の合計額については、保有期間などに応じて異なりますので、表示することができません。  
 詳細については、投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

**購入時**

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| 購入時手数料                      | <b>ありません。</b>   |
| <b>換金時</b>                  |   |
| 換金手数料                       | <b>ありません。</b>   |
| 信託財産留保額                     | <b>ありません。</b>   |
| 保有期間中(信託財産から間接的にご負担いただきます。) |   |
| 運用管理費用<br>(信託報酬)            | <b>信託財産の純資産総額に対して年率0.525%(税抜0.50%)を日々ご負担いただきます。</b>   |
| その他費用・手数料                   | 組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、監査費用等が信託財産から支払われます。<br>(その他費用・手数料については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。) |

当資料は4枚ものです。

P.4の「当資料のお取扱いについてのご注意」をご確認ください。

設定・運用は

**DIAMアセットマネジメント**



**DIAM国内債券バシブ・ファンド**  
**追加型投信 / 国内 / 債券(インデックス型)**  
 月次運用レポート(2012年5月)

**投資信託ご購入の注意**

投資信託は、

預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

購入金額については元本保証および利回り保証のいずれもありません。

投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合がありますが、これによる損失は購入者が負担することとなります。

**当資料のお取扱いについてのご注意**

当資料は、DIAMアセットマネジメント株式会社が作成した販売用資料です。

お申込みに際しては、販売会社からお渡しする投資信託説明書(交付目論見書)の内容を必ずご確認のうえ、ご自身でご判断ください。

当資料はDIAM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データにより作成しておりますが、その情報の完全性、正確性について、同社が保証するものではありません。また、掲載データは過去の実績であり、将来の運用成果を保証するものではありません。

当資料に記載されている運用実績は税引前分配金を再投資したものとする基準価額の変化を示したものであり、税金および手数料は計算に含まれておりません。

当資料における内容は作成時点(2012年5月11日)のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

当ファンドは、実質的に公社債等の値動きのある有価証券に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者にかかる信用状況等の変化により基準価額は変動します。このため、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

**分配金に関する留意点**

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、受益者毎に異なります。

分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することとなります。

**ファンドの関係法人**

- < 委託会社 > DIAMアセットマネジメント株式会社
- < 受託会社 > みずほ信託銀行株式会社
- < 販売会社 > 販売会社一覧をご覧ください

**委託会社の照会先**

DIAMアセットマネジメント株式会社  
 コールセンター 0120-506-860  
 (受付時間: 営業日の午前9時～午後5時)  
 ホームページ URL <http://www.diam.co.jp/>

**販売会社(お申込み、投資信託説明書(交付目論見書)のご請求は、以下の販売会社へお申し出ください)**

印は協会への加入を意味します。

2012年5月11日現在

| 商号       | 登録番号等                    | 日本証券<br>業協会 | 社団法人<br>日本証券<br>投資顧問<br>業協会 | 一般社団<br>法人金融<br>先物取引<br>業協会 | 一般社団<br>法人第二<br>種金融商<br>品取引業<br>協会 | 備考 |
|----------|--------------------------|-------------|-----------------------------|-----------------------------|------------------------------------|----|
| 水戸証券株式会社 | 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第181号 |             |                             |                             |                                    |    |

その他にもお取扱いを行っている販売会社がある場合があります。

また、上記の販売会社は今後変更となる場合があるため、販売会社または委託会社の照会先までお問い合わせください。

< 備考欄について >

- 1 新規募集の取扱いおよび販売業務を行っておりません。
- 2 備考欄に記載されている日付からのお取扱いとなりますのでご注意ください。
- 3 備考欄に記載されている日付からお取扱いを行いませんのでご注意ください。

(原則、金融機関コード順)

当資料は4枚ものです。

設定・運用は

**DIAMアセットマネジメント**

