

# ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン

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、ヘッジ無し・円ベース)
- ・目標とする運用成果 ..... ベンチマークの動きに連動した投資成果の獲得を目指します。

設定日: 2002年3月8日  
 信託期間: 無期限  
 決算日: 2月20日  
 信託報酬: 純資産総額が100億円以下の部分に対して年率0.605% (税抜 0.55%)、100億円を超える部分に対して年率0.594% (税抜 0.54%)

## ◆基準価額、純資産総額

基準価額	20,197円
純資産総額	159.88億円

## ◆資産構成

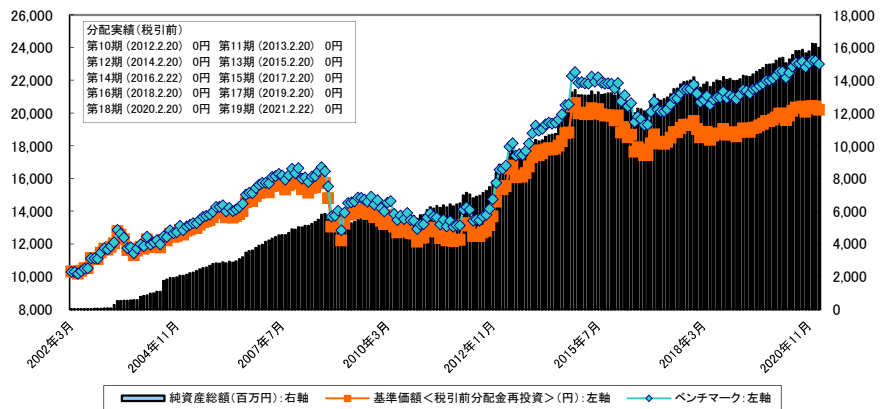
債券	99.83%
債券先物	0.00%
債券実質	99.83%
現金等	0.17%

\* 比率はマザーファンド純資産総額対比

## ◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	0.00%
---------	-------

## ◆基準価額の推移グラフ



## ◆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)	8.96	8.88
修正デュレーション(年)	7.83	7.81
複利回り(%)	0.59	0.59

\*当ファンドのベンチマークは前日のFTSE世界国債インデックス(除く日本)を当日TTM為替レートで円換算しています。  
 \*ファンド、ベンチマークとも、設定日(2002/3/8)の終値を10,000として指数化しています。  
 \*基準価額<税引前分配金再投資>は、信託報酬(後述の「ファンドにかかる手数料について」参照)控除後の値です。

\*ファンド及びベンチマークプロフィールデータは、イールド・ブック・モデルを用いて算出しています。

## ◆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)	-0.35%	-0.53%	1.22%	2.94%	1.43%	5.01%	3.62%
ベンチマーク収益率	-0.19%	-0.21%	2.01%	3.63%	2.10%	5.70%	4.33%
差異	-0.16%	-0.31%	-0.79%	-0.69%	-0.67%	-0.69%	-0.71%
ファンドリスク(分配金再投資)			3.91%	3.72%	5.50%	7.72%	8.65%
ベンチマークリスク			3.85%	3.68%	5.51%	7.73%	8.65%

\*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、その税引前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ありません。

## ◆公社債通貨別構成比

通貨	ファンドのウェイト
1 米ドル	42.78%
2 ユーロ	41.72%
3 英ポンド	6.68%
4 豪ドル	2.77%
5 カナダドル	1.97%

## ◆公社債残存別構成比

残存年数	ウェイト
1年未満	0.60%
1~3年	23.87%
3~7年	33.44%
7~10年	13.78%
10年以上	28.15%

## ◆外国公社債上位銘柄

(組入れ銘柄数: 524)

銘柄名	ファンドのウェイト	通貨	残存年数
1 アメリカ国債 1.625% 2022/11/15	0.79%	USD	1.72
2 アメリカ国債 2.000% 2022/11/30	0.74%	USD	1.76
3 アメリカ国債 2.000% 2025/2/15	0.65%	USD	3.97
4 アメリカ国債 1.500% 2026/8/15	0.63%	USD	5.47
5 アメリカ国債 2.000% 2022/2/15	0.60%	USD	0.97
6 アメリカ国債 0.625% 2030/8/15	0.57%	USD	9.47
7 アメリカ国債 1.625% 2022/8/31	0.54%	USD	1.51
8 アメリカ国債 2.375% 2024/8/15	0.53%	USD	3.47
9 アメリカ国債 2.625% 2025/3/31	0.53%	USD	4.09
10 アメリカ国債 0.875% 2030/11/15	0.51%	USD	9.72

\*ファンドのウェイトはマザーファンドの純資産総額対比

■ 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。■ 「ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法(昭和23年法律第25号)第5条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、株式・公社債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、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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。■ 上記「基準価額」は、信託報酬控除後のものです。■ 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジ無し・円ベース)」に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。また、同社は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

# ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン／月次運用報告書

追加型投信／海外／債券／インデックス型

設定・運用:

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第345号

加入協会:一般社団法人日本投資顧問業協会、

一般社団法人投資信託協会、日本証券業協会

## 受益者限定資料

### ファンドの特徴

- 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。  
「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。
- マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界主要国の国債および政府機関債券等に投資対象します。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目指します。  
公社債への投資は原則として高位を維持します。
- 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
したがって投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

### 投資リスク

当ファンドは、マザーファンド等への投資を通じて、主に日本を除く世界主要国の公社債等に分散投資を行いますが、主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合があります、損失を被ることや投資元金が割り込むことがあります。

当ファンドの主なリスクは以下の通りです。

#### 1. 金利変動リスク

公社債等の価格は、一般に金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します(価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。)。従って、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

#### 2. 信用リスク

公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって公社債等の価格は変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合(債務不履行)、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します(利息および償還金が支払われないこともあります。)。従って、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、当ファンドの資産をコール・ローン、譲渡性預金等の短期金融商品で運用する場合(マザーファンドへの投資を通じて実質的に運用する場合を含む)にも、債務不履行などにより損失が発生することがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。また、金融商品取引の相手方や受託者の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。

#### 3. 為替変動リスク

当ファンドの実質的な主要投資対象である日本を除く世界主要国の国債および政府機関債等は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。

#### 4. 流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことにより解約金の支払いに対応する場合があります、その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

### ファンドにかかる手数料について

- ◆信託報酬・・・ファンドの純資産総額100億円以下の部分に対して年0.605% (税抜年0.55%)  
ファンドの純資産総額100億円超の部分に対して年0.594% ((税抜年0.54%)の率を乗じて得た額とします。
- ◆信託財産留保額・・・解約請求時に、解約請求日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額とします。
- ◆監査費用・・・ファンドの純資産総額に年0.055% (税抜年0.05%)の率を乗じて得た額とします。
- ◆その他の費用・・・信託事務の処理等に要する諸費用、有価証券等売買時の売買委託手数料、資産を海外で保管する場合の費用等(その他費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません)

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

○本資料は金融商品取引法上及び投信法上の開示書類ではありません。  
○本資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下「弊社」とします)が当ファンドの情報提供を目的として作成したものであり、投資の勧誘を目的とするものではありません。  
○本資料中の過去の運用実績に関するグラフ・数値等は将来の成果をお約束するものではありません。また、市場概況等は本資料作成時点の弊社の見解であり、将来の動向や結果を保証するものではありません。  
○本資料の内容は作成日現在のものであり、将来予告なく変更することがあります。

# ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン／月次運用報告書

追加型投信／海外／債券／インデックス型

設定・運用:

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第345号

加入協会:一般社団法人日本投資顧問業協会、

一般社団法人投資信託協会、日本証券業協会

## 受益者限定資料

### 収益分配金に関する留意事項

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、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になります。また、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。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、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。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

#### <ベンチマークについて>

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

※詳しくは投資信託説明書(交付目論見書)をご覧ください。

○本資料は金融商品取引法上及び投信法上の開示書類ではありません。

○本資料は、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社(以下「弊社」とします)が当ファンドの情報提供を目的として作成したものであり、投資の勧誘を目的とするものではありません。

○本資料中の過去の運用実績に関するグラフ・数値等は将来の成果をお約束するものではありません。また、市場概況等は本資料作成時点の弊社の見解であり、将来の動向や結果を保証するものではありません。

○本資料の内容は作成日現在のものであり、将来予告なく変更することがあります。