

日本債券コア・アクティブファンド

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…………… 国内債券を主要投資対象とする「RM日本債券コア・アクティブマザーファンド」受益証券に投資します。
- ・ベンチマーク…………… NOMURA-BPI総合
- ・目標とする運用成果… NOMURA-BPI総合を中長期的に上回る投資成果を目指して運用を行います。

◆基準価額、純資産総額

| | |
|-------|--------|
| 基準価額 | 9,041円 |
| 純資産総額 | 2.4億円 |

◆資産構成

| | ファンド |
|-----|--------|
| 債券 | 97.9% |
| 先物 | 0.2% |
| 現金等 | 1.9% |
| 合計 | 100.0% |

※比率は、マザーファンドの純資産総額対比です。
※先物にはオプション取引を含みます。
※現金等には未収、未払項目が含まれるため、マイナスとなる場合があります。

◆基準価額の推移



※基準価額(分配金再投資)とベンチマークは設定時(2022/12/28)を10,000として指数化したものです。

◆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) | -1.52% | -3.30% | -5.36% | -3.95% | ----- | ----- | -2.99% |
| ベンチマーク収益率 | -1.67% | -3.84% | -5.37% | -4.11% | ----- | ----- | -3.15% |
| 差異 | 0.15% | 0.54% | 0.01% | 0.16% | ----- | ----- | 0.16% |
| ファンドリスク(分配金再投資) | ----- | ----- | 3.37% | 3.01% | ----- | ----- | 3.18% |
| ベンチマークリスク | ----- | ----- | 3.44% | 3.12% | ----- | ----- | 3.24% |

※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換算しています。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。
※リスクは期間が1年以上の場合は年率換算して表示しています。期間が1年未満のものについては表示していません。

◆ポートフォリオプロフィール

| | |
|------------|-------|
| 平均残存年数* | 9.53 |
| 最終利回り | 2.34% |
| 直接利回り | 1.92% |
| 修正デュレーション* | 7.22 |

※個別銘柄の組入比率で加重平均した値です。
* 繰上償還条項が付与されている銘柄は、次回の繰上償還可能日を基準に算出しています。

◆組入上位10銘柄

| | 銘柄名 | クーポン | 償還日 | ファンドウェイト |
|----|-------------------------|--------|------------|----------|
| 1 | 第183回利付国債(5年) | 1.600% | 2030/12/20 | 12.7% |
| 2 | 第89回利付国債(30年) | 3.400% | 2055/12/20 | 6.6% |
| 3 | 第381回利付国債(10年) | 2.100% | 2035/12/20 | 3.2% |
| 4 | 第194回利付国債(20年) | 2.700% | 2045/9/20 | 2.9% |
| 5 | アメリカン・インターナショナル・グループ | 1.580% | 2028/2/22 | 2.6% |
| 6 | 第22回株式会社三井住友フィナンシャルグループ | 2.254% | 9998/12/31 | 2.4% |
| 7 | 第468回利付国債(2年) | 0.600% | 2027/1/1 | 2.0% |
| 8 | 第25回みずほフィナンシャルグループ(劣) | 2.741% | 9998/12/31 | 1.9% |
| 9 | 第27回ピー・ピー・シー・イー・エス・エ | 1.558% | 2029/7/4 | 1.9% |
| 10 | 第27回ルノー円貨社債 | 2.170% | 2028/11/14 | 1.8% |

※ファンドウェイトはマザーファンドの純資産総額対比です。

●当資料は、当商品の内容を説明するために作成したものであり、当商品の勧誘を目的とするものではありません。また、当資料は金融商品取引法に基づく開示書類ではありません。●投資信託は、値動きのある有価証券等(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、投資信託を購入されたお客さまに帰属します。●当資料は、りそな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。●基準価額(1万円当たり)は、運用管理費用(信託報酬)控除後のものです。●資産構成は、マザーファンドの純資産総額に対する比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。●「NOMURA-BPI総合」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が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の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ています。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は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。