DIAM国内債券パッシブ・ファンド

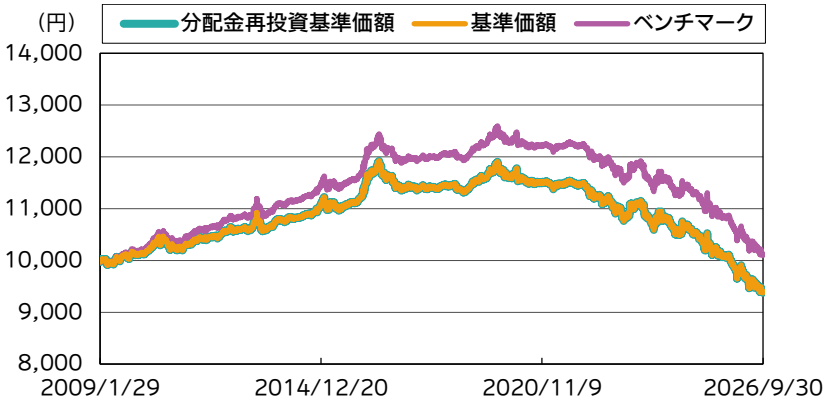
マンスリーレポート
2026年9月30日基準

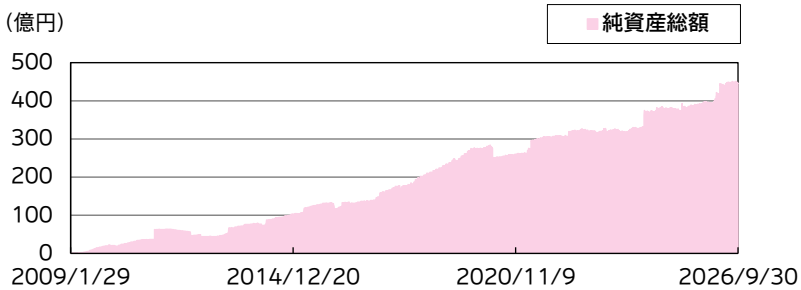
追加型投信／国内／債券／インデックス型

運用実績

運用実績の推移

（設定日：2009年1月30日）





※基準価額は、信託報酬控除後の価額です。ベンチマークを含め、設定前営業日を10,000円として指数化しています。なお、信託報酬率は「ファンドの費用」をご覧ください。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
※ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。指数についての詳細は後掲の「指数の著作権などについて」をご参照ください。

基準価額・純資産総額

	当月末	前月末
基準価額（円）	9,394	9,438
純資産総額（百万円）	44,687	44,733

※基準価額は、1万口当たり。

	基準価額（円）	基準日
設定来高値	11,923	2016/07/06
設定来安値	9,376	2026/09/28

※同一の基準価額が複数ある場合、直近の日付を表示しています。

騰落率（税引前分配金再投資）（%）

	ファンド	ベンチマーク	差
1ヵ月	-0.5	-0.5	-0.0
3ヵ月	-1.9	-1.9	-0.0
6ヵ月	-3.1	-3.0	-0.1
1年	-6.9	-6.7	-0.2
3年	-12.8	-12.2	-0.6
5年	-18.1	-17.2	-0.9
10年	-19.3	-16.8	-2.5
設定来	-6.1	1.2	-7.2

※騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとして算出していますので、実際の投資家利回りとは異なります。
※各期間は、基準日から過去に遡っています。また、設定来の騰落率については、設定当初の投資元本を基に計算しています。

分配金の実績（税引前）（直近3年分）

期	決算日	分配金（円）
第15期	2023/10/12	0
第16期	2024/10/15	0
第17期	2025/10/14	0
設定来累計分配金		0

※分配金は、1万口当たりの金額です。
※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。

ポートフォリオ構成（%）

債券現物	99.6
現金等	0.4
合計	100.0
債券先物	-
債券実質組入（現物＋先物）	99.6

※組入比率は、純資産総額に対する実質的な割合です。
※現金等の中には未払金等が含まれるため、比率が一時的にマイナスとなる場合があります。

当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、
投資信託説明書（交付目論見書）ではありません。
「投資信託に関する留意点」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

Asset Management One　アセットマネジメントOne

DIAM国内債券パッシブ・ファンド

ポートフォリオの状況

最終利回り(%)	2.73
平均クーポン(%)	1.01
平均残存期間(年)	8.79
修正デュレーション(年)	7.63

※組入債券の各データを純資産総額に対する実質的な割合で加重平均しています。
※修正デュレーションは、債券価格の金利変動に対する感応度を示す指標です。この値が大きいほど、金利が変化した際の債券の価格変動が大きくなります。
※将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

種別組入比率（%）

種別	組入比率
国債	87.5
地方債	5.1
金融債	-
政保債	0.9
社債	5.2
円建外債	-
MBS	0.8
ABS	-
現金等	0.4
合計	100.0

※組入比率は、純資産総額に対する実質的な割合です。

組入上位10銘柄（組入銘柄数 600）

	銘柄	クーポン(%)	償還日	格付け	組入比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	0.100	2028/03/20	AAA	1.3
2	369回 利付国庫債券(10年)	0.500	2032/12/20	AAA	1.3
3	371回 利付国庫債券(10年)	0.400	2033/06/20	AAA	1.0
4	351回 利付国庫債券(10年)	0.100	2028/06/20	AAA	1.0
5	354回 利付国庫債券(10年)	0.100	2029/03/20	AAA	1.0
6	368回 利付国庫債券(10年)	0.200	2032/09/20	AAA	1.0
7	374回 利付国庫債券(10年)	0.800	2034/03/20	AAA	1.0
8	377回 利付国庫債券(10年)	1.200	2034/12/20	AAA	1.0
9	379回 利付国庫債券(10年)	1.500	2035/06/20	AAA	0.9
10	381回 利付国庫債券(10年)	2.100	2035/12/20	AAA	0.9

※組入比率は、純資産総額に対する実質的な割合です。
※格付けについては、格付機関(R&IおよびJCR)による格付けの上位のものを採用し、＋・－等の符号は省略して表示しています。(表記方法はS&Pに準拠)

※当資料中の各数値については、表示桁未満の数値がある場合、原則、四捨五入して表示しています。
※当資料中の各数値等は過去の実績であり、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

当資料は、ファンドの運用状況に関する情報提供を目的としてアセットマネジメントOneが作成した資料であり、
投資信託説明書(交付目論見書)ではありません。
「投資信託に関する留意点」、「当資料のお取扱いについてのご注意」をよくお読みください。

投資信託に関する留意点

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、アセットマネジメントOne株式会社が作成した販売用資料です。

●当資料はファンドラップにおいて投資対象となる投資信託の情報提供を目的とするものであり、投資家に対する当ファンドの投資勧誘を目的とするものではありません。

●投資信託は、株式や債券等の値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります）に投資をしますので、市場環境、組入有価証券の発行者に係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、投資者のみなさまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益は全て投資者のみなさまに帰属します。また、投資信託は預貯金とは異なります。

●当資料は、アセットマネジメントOne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、その内容の完全性、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。

●当資料における内容は作成時点のものであり、今後予告なく変更される場合があります。

◆収益分配金に関する留意事項◆

●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になります。

委託会社およびファンドの関係法人

＜委託会社＞アセットマネジメントOne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：一般社団法人資産運用業協会
＜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

アセットマネジメントOne株式会社
コールセンター　0120-104-694
（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）
ホームページ　URL https://www.am-one.co.jp/

販売会社一覧（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。

2026年10月9日現在

商号	登録番号等	日本証券業協会	一般社団法人資産運用業協会	一般社団法人金融先物取引業協会	一般社団法人第二種金融商品取引業協会	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。
ファンドラップのみのお取扱いとなりますのでご注意ください。
＜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。
※4 一般社団法人日本STO協会にも加入しています。

（原則、金融機関コード順）

指数の著作権などについて

NOMURA-BPI総合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。なお、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、同指数の正確性、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。