

大同DC225インデックスファンド

◆ファンドの特色

・主な投資対象	国内株式(マザーファンドによる投資)
・ベンチマーク	日経平均株価
・目標とする投資成果	ベンチマークと連動する投資成果を目指します

元本確保型の商品ではありません

◆基準価額、純資産総額

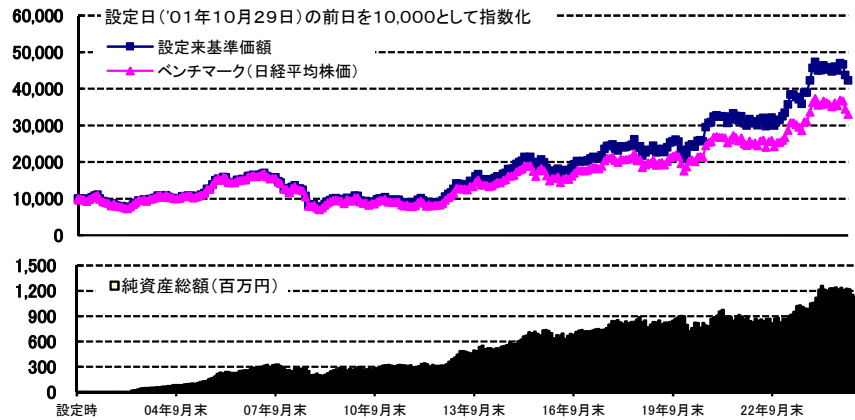
基準価額	42,279円
純資産総額	1,117百万円

◆資産構成

株式	49.29%
東証プライム	49.29%
東証スタンダード	—
東証グロース	—
その他	—
株式先物	50.55%
株式実質	99.84%
現金等	50.71%

※ ベビーファンドの実質組入比率

◆基準価額の推移グラフ(月末ベース)



◆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)	-10.07%	-5.43%	-10.67%	10.06%	14.92%	7.79%	6.45%
ベンチマーク収益率	-10.72%	-6.07%	-11.77%	8.58%	13.49%	6.37%	5.41%
差異	0.65%	0.64%	1.10%	1.48%	1.43%	1.41%	1.04%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	11.04%	15.04%	15.62%	16.41%	18.01%
ベンチマークリスク	-----	-----	11.22%	15.28%	15.71%	16.50%	18.07%

※ 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、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。

※ 当資料の百分率は、原則として表示桁数未満を四捨五入していますので、合計の数値とは必ずしも一致しません。

◆株式組入上位10業種

業種	ファンドの ウェイト	ベンチマークの ウェイト
1 電気機器	12.11%	24.29%
2 小売業	6.39%	14.03%
3 情報・通信業	5.98%	12.00%
4 医薬品	2.95%	5.92%
5 化学	2.94%	5.90%
6 サービス業	2.35%	4.41%
7 機械	2.30%	4.61%
8 輸送用機器	2.07%	4.15%
9 精密機器	1.88%	3.78%
10 卸売業	1.56%	3.13%

※ ベビーファンドの実質組入比率

◆株式組入上位10銘柄

(組入銘柄数 225)

銘柄名	ファンドの ウェイト	ベンチマークの ウェイト
1 ファーストリテイリング	4.87%	10.98%
2 東京エレクトロン	2.78%	5.57%
3 アドバンテスト	2.38%	4.78%
4 ソフトバンクグループ	2.07%	4.14%
5 KDDI	1.30%	2.61%
6 TDK	1.07%	2.14%
7 リクルートホールディングス	1.06%	2.12%
8 テルモ	1.03%	2.07%
9 信越化学工業	0.97%	1.96%
10 中外製薬	0.94%	1.88%

※ ベビーファンドの実質組入比率

◆過去3ヵ月間のパフォーマンス分析

1月の日経平均株価は、前半は、堅調な米経済指標を受けた米長期金利上昇などを背景に米国株式市場が下落したことや、米政権がAI(人工知能)向け先端半導体を巡る輸出規制の見直し案を発表したことなどが嫌気され、下落しました。後半は、中国企業が開発した生成AIへの警戒が半導体関連株を中心に重荷となる局面もありましたが、米長期金利上昇が一服し米国株式市場が上昇したことや、トランプ米大統領が就任初日の中国を標的にした追加関税発表を見送ったことなどが好感され、上昇する展開となりました。2月は、上旬は、トランプ米大統領がメキシコなどに対して追加関税を課す大統領令に署名したことが嫌気され下落した後、メキシコとカナダへの追加関税の発動を先送りすると発表したことにより下げ幅を狭める展開となりました。中旬は、欧州株式市場の上昇などを受けて上昇する局面もありましたが、日銀による追加利上げ観測を背景に為替市場で円高が進んだことなどが重荷となり、下落しました。下旬は、AI需要の先行きに対する警戒や、トランプ米大統領の関税政策をめぐる不透明感が重荷となり、下落しました。3月は、上旬は、前月末にトランプ米大統領の関税政策をめぐる不透明感から下落した反動で、自律反発狙いの買いが入り上昇する局面もありましたが、為替市場での円高進行などが重荷となり、下落しました。中旬は、米景気の先行き懸念が重荷となるなか、ウクライナを巡る地政学リスクが後退したことや、米著名投資家による日本の商社株買い増し報道が好感されたことから、上昇しました。下旬は、トランプ米大統領が輸入自動車に追加関税をかけると表明したことや、米景気の後退とインフレ再燃への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが重荷となり、下落しました。

当ファンドは、225インデックスマザーファンドを主に組入れることにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指しています。この3ヵ月につきましては、同マザーファンドを高位に組入れることにより、先物を含めた株式の実質組入比率を高位に保ちました。以上の運用の結果、基準価額の3ヵ月間騰落率騰落率は10.07%の下落となり、10.72%下落した日経平均株価を0.65ポイント上回りました。この乖離は、主に当ファンドが投資している225インデックスマザーファンドが保有する先物と現物との値動きの違いや、株式の配当金等のプラス要因と信託報酬等のマイナス要因の差額により発生しています。

■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。■「大同DC225インデックスファンド」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法第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、加入者のみなさまに対して、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、元本および投資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、T & D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。■①「日経平均株価(日経平均)」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」自体及び「日経平均」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有する。②「日経」及び「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属する。③本件投資信託は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び本件受益権の取引に関して、一切の責任を負わない。④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均」の構成銘柄、計算方法、その他、「日経平均」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。