

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                             |
|--------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 商品分類         | 追加型投信／海外／債券／インデックス型                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                             |
| 信託期間         | 約14年7カ月間（2013年12月2日～2028年7月5日）                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                             |
| 運用方針         | 投資成果をＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。                                                                                                                                                                                                                                       |                             |
| 主要投資対象       | ベビーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券 |
|              | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 新興国通貨建ての債券                  |
| マザーファンドの運用方法 | ①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。<br>②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |                             |
| 組入制限         | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 無制限                         |
|              | マザーファンドの株式組入上限比率                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 純資産総額の10%以下                 |
| 分配方針         | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。                                                                                                                                                                                               |                             |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・インデックス  
セレクト 新興国債券

運用報告書(全体版)  
第 2 期

(決算日 2015年7月6日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9：00～17：00）  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

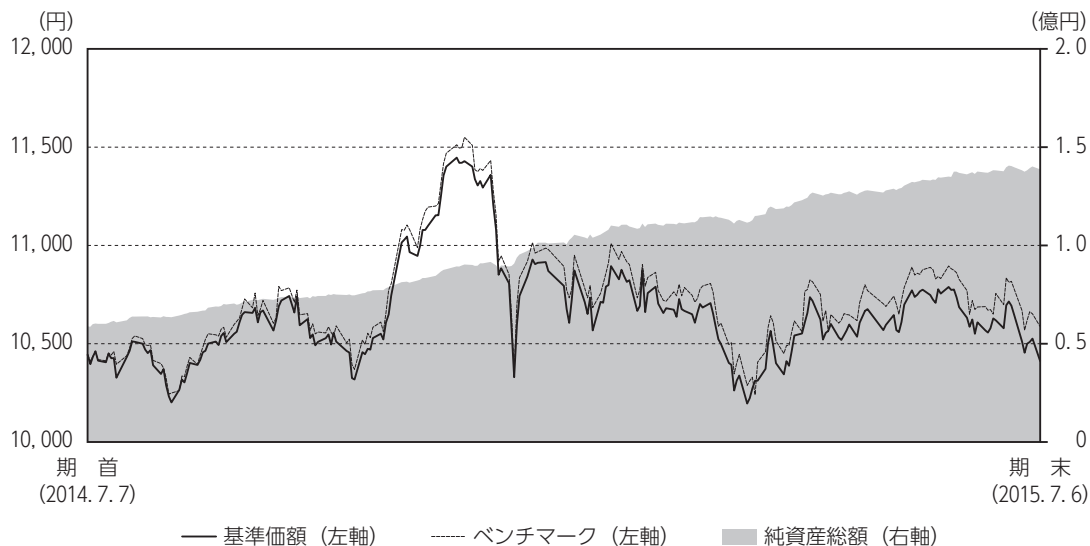
設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準 価 額  |         |         | J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)<br>(ベンチマーク) |         | 公 社 債<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|---------------------|----------|---------|---------|-------------------------------------------------------------------------|---------|---------------|--------------|
|                     |          | 税 込 配 金 | 期 騰 落 率 |                                                                         | 期 騰 落 率 |               |              |
| 1 期末(2014年 7 月 7 日) | 円 10,445 | 円 0     | % 4.5   | 10,494                                                                  | % 4.9   | % 96.9        | 百万円 58       |
| 2 期末(2015年 7 月 6 日) | 10,411   | 0       | △ 0.3   | 10,637                                                                  | 1.4     | 96.8          | 138          |

- (注 1) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) を円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.
- (注 2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注 3) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
- (注 4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\*ベンチマークは、ＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) です。

### ■基準価額・騰落率

期 首：10,445円

期 末：10,411円

騰落率：△0.3%

### ■基準価額の主な変動要因

投資している債券の値下がりや通貨の為替相場が円に対して下落したことが、基準価額の値下がり要因となりました。

| 年 月 日              | 基 準 価 額 |        | J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン<br>デックスーエマージング・マーケット<br>グローバル ダイバーシファイド (円換算) |       | 公 社 債<br>組入比率 |
|--------------------|---------|--------|--------------------------------------------------------------------|-------|---------------|
|                    |         | 騰 落 率  | (ベンチマーク)                                                           | 騰 落 率 |               |
|                    | 円       | %      |                                                                    | %     | %             |
| (期首) 2014年 7 月 7 日 | 10, 445 | —      | 10, 494                                                            | —     | 96. 9         |
| 7 月末               | 10, 467 | 0. 2   | 10, 542                                                            | 0. 5  | 95. 2         |
| 8 月末               | 10, 508 | 0. 6   | 10, 582                                                            | 0. 8  | 95. 5         |
| 9 月末               | 10, 529 | 0. 8   | 10, 618                                                            | 1. 2  | 95. 7         |
| 10月末               | 10, 746 | 2. 9   | 10, 857                                                            | 3. 5  | 96. 6         |
| 11月末               | 11, 429 | 9. 4   | 11, 605                                                            | 10. 6 | 96. 6         |
| 12月末               | 10, 870 | 4. 1   | 11, 031                                                            | 5. 1  | 96. 7         |
| 2015年 1 月末         | 10, 823 | 3. 6   | 10, 954                                                            | 4. 4  | 96. 4         |
| 2 月末               | 10, 684 | 2. 3   | 10, 844                                                            | 3. 3  | 97. 6         |
| 3 月末               | 10, 411 | △ 0. 3 | 10, 540                                                            | 0. 4  | 96. 2         |
| 4 月末               | 10, 667 | 2. 1   | 10, 851                                                            | 3. 4  | 96. 2         |
| 5 月末               | 10, 755 | 3. 0   | 10, 883                                                            | 3. 7  | 94. 8         |
| 6 月末               | 10, 454 | 0. 1   | 10, 618                                                            | 1. 2  | 95. 7         |
| (期末) 2015年 7 月 6 日 | 10, 411 | △ 0. 3 | 10, 637                                                            | 1. 4  | 96. 8         |

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

### ○新興国債券市況

原油価格の下落からインフレ見通しが世界的に後退していることを背景に、金利は低下する局面もありましたが、米国の金融政策が正常化へ向かうとの思惑から米国の債券市場が金利上昇の影響を受けて、金利が上昇する国が多くなりました。個別の国では、通貨下落阻止のために大幅な政策金利の引上げを行なったロシアや、政治情勢への懸念が高まったトルコの金利が上昇しました。

### ○為替相場

日銀の金融緩和等を背景に円安が進展する局面もありましたが、米国の金融政策が正常化に向けて前進する中、新興国からの資金流出懸念を背景に対円で下落する通貨が多くなりました。個別の通貨では、ウクライナ情勢の悪化や原油価格の下落を背景にロシア・ルーブルが下落したほか、政治情勢および財政状況への懸念の高まりからブラジル・レアルが下落しました。

## 前期における「今後の運用方針」

主として「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資することを通じて、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ポートフォリオについて

### ○当ファンド

期を通じて「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組入れ、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行ないました。

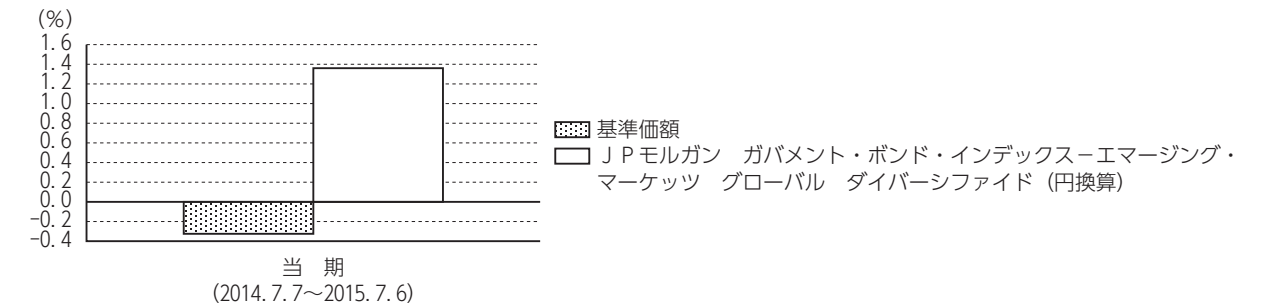
### ○ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

当期におきましては、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△0.3%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、ベンチマークとファンドが投資しているユニバースの差異によるものや、債券売買に伴うコスト（債券売買価格と評価値の差、税金等）、外国証券取引口座の管理費用、信託報酬などが主な要因です。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったことから、収益分配を見送らせていただきました。  
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目                   | 当 期                     |
|-----------------------|-------------------------|
|                       | 2014年7月8日<br>～2015年7月6日 |
| 当 期 分 配 金（税 込 み）(円)   | —                       |
| 対 基 準 価 額 比 率 (%)     | —                       |
| 当 期 の 収 益 (円)         | —                       |
| 当 期 の 収 益 以 外 (円)     | —                       |
| 翌 期 繰 越 分 配 対 象 額 (円) | 446                     |

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。  
(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。  
(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

## 《今後の運用方針》

### ○当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、引続き、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ○ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

今後もファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

1 万口当りの費用の明細

| 項 目     | 当 期                     |          | 項 目 の 概 要                                                          |
|---------|-------------------------|----------|--------------------------------------------------------------------|
|         | (2014. 7. 8～2015. 7. 6) |          |                                                                    |
|         | 金 額                     | 比 率      |                                                                    |
| 信託報酬    | 69円                     | 0. 646%  | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br><b>期中の平均基準価額は10, 651円です。</b>               |
| (投信会社)  | (33)                    | (0. 307) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価             |
| (販売会社)  | (33)                    | (0. 307) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価                    |
| (受託銀行)  | (3)                     | (0. 032) | 受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                                     |
| 売買委託手数料 | —                       | —        | 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 有価証券取引税 | —                       | —        | 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金   |
| その他費用   | 26                      | 0. 244   | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数                                          |
| (保管費用)  | (25)                    | (0. 235) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用                 |
| (監査費用)  | (1)                     | (0. 008) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                        |
| (その他)   | (0)                     | (0. 001) | 信託事務の処理等に関するその他の費用                                                 |
| 合 計     | 95                      | 0. 890   |                                                                    |

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2014年7月8日から2015年7月6日まで)

|                                | 設 定     |         | 解 約    |        |
|--------------------------------|---------|---------|--------|--------|
|                                | 口 数     | 金 額     | 口 数    | 金 額    |
|                                | 千口      | 千円      | 千口     | 千円     |
| ダイワ新興国債券<br>インデックス・<br>マザーファンド | 61, 376 | 86, 288 | 3, 559 | 4, 968 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類                        | 期 首     |          |          | 当 期 末 |       |
|----------------------------|---------|----------|----------|-------|-------|
|                            | 口 数     | 口 数      | 口 数      | 口 数   | 評 価 額 |
|                            | 千口      | 千口       | 千口       | 千口    | 千円    |
| ダイワ新興国債券<br>インデックス・マザーファンド | 42, 852 | 100, 668 | 138, 631 |       |       |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年7月6日現在

| 項 目                    | 当 期 末    |        |
|------------------------|----------|--------|
|                        | 評 価 額    | 比 率    |
|                        | 千円       | %      |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 138, 631 | 99. 6  |
| コール・ローン等、その他           | 493      | 0. 4   |
| 投資信託財産総額               | 139, 124 | 100. 0 |

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝122.49円、1トルコ・リラ＝45.16円、1メキシコ・ペソ＝7.76円、1フィリピン・ペソ＝2.72円、100コロンビア・ペソ＝4.65円、100インドネシア・ルピア＝0.92円、1ブラジル・レアル＝39.09円、1ルーマニア・レイ＝30.01円、1ロシア・ルーブル＝2.19円、1マレーシア・リングギット＝32.18円、1南アフリカ・ランド＝9.91円、1タイ・バーツ＝3.62円、1ペルー・ヌエボソル＝38.57円、100ナイジェリア・ナイラ＝61.58円、1ポーランド・ズロチ＝32.13円、100ハンガリー・フォリント＝42.67円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(3,091,200千円)の投資信託財産総額(3,260,043千円)に対する比率は、94.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年7月6日現在

| 項 目                         | 当 期 末          |
|-----------------------------|----------------|
| (A) 資産                      | 139, 124, 463円 |
| コール・ローン等                    | 493, 407       |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額) | 138, 631, 056  |
| (B) 負債                      | 397, 270       |
| 未払解約金                       | 1, 991         |
| 未払信託報酬                      | 390, 482       |
| その他未払費用                     | 4, 797         |
| (C) 純資産総額 (A－B)             | 138, 727, 193  |
| 元本                          | 133, 254, 300  |
| 次期繰越損益金                     | 5, 472, 893    |
| (D) 受益権総口数                  | 133, 254, 300口 |
| 1万口当り基準価額 (C／D)             | 10, 411円       |

\* 期首における元本額は56,373,184円、当期中における追加設定元本額は86,105,135円、同解約元本額は9,224,019円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,411円です。

■損益の状況

当期 自2014年7月8日 至2015年7月6日

| 項 目               | 当 期            |
|-------------------|----------------|
| (A) 配当等収益         | 8円             |
| 受取利息              | 8              |
| (B) 有価証券売買損益      | △ 1, 626, 702  |
| 売買益               | 67, 504        |
| 売買損               | △ 1, 694, 206  |
| (C) 信託報酬等         | △ 649, 984     |
| (D) 当期損益金 (A＋B＋C) | △ 2, 276, 678  |
| (E) 前期繰越損益金       | 2, 256, 445    |
| (F) 追加信託差損益金      | 5, 493, 126    |
| (配当等相当額)          | ( 3, 691, 157) |
| (売買損益相当額)         | ( 1, 801, 969) |
| (G) 合計 (D＋E＋F)    | 5, 472, 893    |
| 次期繰越損益金 (G)       | 5, 472, 893    |
| 追加信託差損益金          | 5, 493, 126    |
| (配当等相当額)          | ( 3, 691, 157) |
| (売買損益相当額)         | ( 1, 801, 969) |
| 分配準備積立金           | 2, 256, 445    |
| 繰越損益金             | △ 2, 276, 678  |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は9ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目                        | 当 期          |
|----------------------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益            | 0円           |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益        | 0            |
| (c) 収益調整金                  | 3,691,157    |
| (d) 分配準備積立金                | 2,256,445    |
| (e) 当期分配対象額（a + b + c + d） | 5,947,602    |
| (f) 分配金                    | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額（e - f）       | 5,947,602    |
| (h) 受益権総口数                 | 133,254,300口 |

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

●運用報告書（全体版）の電子交付について

2014年12月1日施行の法改正により、運用報告書は「交付運用報告書」と「運用報告書（全体版）」（本書）の2種類になりましたが、「運用報告書（全体版）」については、交付に代えて電子交付する旨を信託約款に定めました。

●書面決議手続きの改正について

重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。

- ・書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。
- ・投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。
- ・書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託（当ファンドは該当します。）には適用されなくなりました。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第5期 (決算日 2015年7月6日)

(計算期間 2014年7月8日～2015年7月6日)

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第5期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | 投資成果をＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。                                                                                                                                                                                                                                       |
| 主要投資対象 | 新興国通貨建ての債券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 運用方法   | ①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をＪＰモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行いません。<br>②運用の効率化をはかるため、債券先物取引等や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産の組入総額ならびに外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。<br>③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

## 大和投資信託

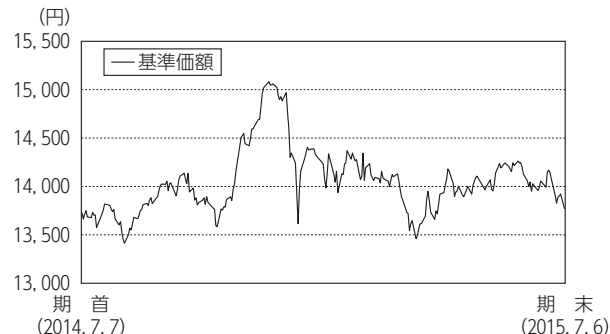
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## ■当期中の基準価額と市況の推移



| 年 月 日              | 基 準 価 額 |     | JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク) |      | 公社債組入比率 |
|--------------------|---------|-----|-----------------------------------------------------------------------|------|---------|
|                    | 円       | %   | 円                                                                     | %    |         |
| (期首) 2014年 7 月 7 日 | 13,726  | —   | 14,299                                                                | —    | 97.0    |
| 7 月末               | 13,761  | 0.3 | 14,364                                                                | 0.5  | 95.3    |
| 8 月末               | 13,822  | 0.7 | 14,420                                                                | 0.8  | 95.5    |
| 9 月末               | 13,858  | 1.0 | 14,468                                                                | 1.2  | 95.8    |
| 10 月末              | 14,151  | 3.1 | 14,794                                                                | 3.5  | 96.7    |
| 11 月末              | 15,060  | 9.7 | 15,813                                                                | 10.6 | 96.7    |
| 12 月末              | 14,330  | 4.4 | 15,031                                                                | 5.1  | 96.8    |
| 2015年 1 月末         | 14,277  | 4.0 | 14,927                                                                | 4.4  | 96.4    |
| 2 月末               | 14,100  | 2.7 | 14,777                                                                | 3.3  | 97.6    |
| 3 月末               | 13,748  | 0.2 | 14,362                                                                | 0.4  | 96.1    |
| 4 月末               | 14,093  | 2.7 | 14,786                                                                | 3.4  | 96.2    |
| 5 月末               | 14,217  | 3.6 | 14,829                                                                | 3.7  | 94.8    |
| 6 月末               | 13,827  | 0.7 | 14,468                                                                | 1.2  | 95.7    |
| (期末) 2015年 7 月 6 日 | 13,771  | 0.3 | 14,494                                                                | 1.4  | 96.9    |

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) を円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

(注 3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注 4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

## 《運用経過》

### 【基準価額・騰落率】

期首：13,726円 期末：13,771円 騰落率：0.3%

### 【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入が、基準価額の値上がりに寄与しました。

### ◆投資環境について

#### ○新興国債券市況

原油価格の下落からインフレ見通しが世界的に後退していることを背景に、金利は低下する局面もありましたが、米国の金融政策が正常化へ向かうとの思惑から米国の債券市場が金利上昇の影響を受けて、金利が上昇する国が多くなりました。個別の国では、通貨下落阻止のために大幅な政策金利の引上げを行なったロシアや、政治情勢への懸念が高まったトルコの金利が上昇しました。

#### ○為替相場

日銀の金融緩和等を背景に円安が進展する局面もありましたが、米国の金融政策が正常化に向けて前進する中、新興国からの資金流出懸念を背景に対円で下落する通貨が多くなりました。個別の通貨では、ウクライナ情勢の悪化や原油価格の下落を背景にロシア・ルーブルが下落したほか、政治情勢および財政状況への懸念の高まりからブラジル・レアルが下落しました。

### ◆前期における「今後の運用方針」

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ◆ポートフォリオについて

当期におきましては、ファンドの通貨の比率をベンチマーク (J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

### ◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は0.3%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、ベンチマークとファンドが投資しているユニバースの差異によるものや、債券売買に伴うコスト (債券売買価格と評価値の差、税金等)、外国証券取引口座の管理費用などが主な要因です。

## 《今後の運用方針》

今後もファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

■ 1 万口当りの費用の明細

| 項 目             | 当 期         |
|-----------------|-------------|
| 売買委託手数料         | —円          |
| 有価証券取引税         | —           |
| その他費用<br>(保管費用) | 33<br>( 33) |
| (その他)           | ( 0)        |
| 合 計             | 33          |

(注 1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出方法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2014年 7 月 8 日から2015年 7 月 6 日まで)

|     |        | 買 付 額                     | 売 付 額                          |
|-----|--------|---------------------------|--------------------------------|
| 外 国 | トルコ    | 千トルコ・リラ<br>4,011          | 千トルコ・リラ<br>1,877<br>( —)       |
|     | メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>18,061        | 千メキシコ・ペソ<br>5,471<br>( —)      |
|     | コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>5,494,148    | 千コロンビア・ペソ<br>3,201,000<br>( —) |
|     | インドネシア | 千インドネシア・ルピア<br>11,179,125 | 千インドネシア・ルピア<br>370,000<br>( —) |
|     | ブラジル   | 千ブラジル・レアル<br>5,237        | 千ブラジル・レアル<br>2,563<br>( —)     |
|     | ルーマニア  | 千ルーマニア・レイ<br>1,735        | 千ルーマニア・レイ<br>544<br>( —)       |
|     | ロシア    | 千ロシア・ルーブル<br>23,867       | 千ロシア・ルーブル<br>11,416<br>( —)    |
|     | マレーシア  | 千マレーシア・リンギット<br>3,718     | 千マレーシア・リンギット<br>1,312<br>( —)  |
|     | 南アフリカ  | 千南アフリカ・ランド<br>14,951      | 千南アフリカ・ランド<br>7,077<br>( —)    |
|     | タイ     | 千タイ・バーツ<br>23,824         | 千タイ・バーツ<br>6,653<br>( —)       |
|     | ペルー    | 千ペルー・ヌエボソル<br>516         | 千ペルー・ヌエボソル<br>( —)             |
|     | ナイジェリア | 千ナイジェリア・ナイラ<br>33,736     | 千ナイジェリア・ナイラ<br>( —)            |
|     | ポーランド  | 千ポーランド・ズロチ<br>5,092       | 千ポーランド・ズロチ<br>2,293<br>( —)    |
|     | ハンガリー  | 千ハンガリー・フォリント<br>123,189   | 千ハンガリー・フォリント<br>62,014<br>( —) |

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■主要な売買銘柄  
公 社 債

(2014年7月8日から2015年7月6日まで)

| 当                                                            |   |        | 期                                                              |   |        |
|--------------------------------------------------------------|---|--------|----------------------------------------------------------------|---|--------|
| 買付                                                           |   | 金 額    | 売付                                                             |   | 金 額    |
| 銘                                                            | 柄 |        | 銘                                                              | 柄 |        |
|                                                              |   | 千円     |                                                                |   | 千円     |
| Colombian TES (コロンビア) 10% 2024/7/24                          |   | 64,540 | Colombia Government International Bond (コロンビア) 12% 2015/10/22  |   | 60,509 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1            |   | 40,455 | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2016/1/1              |   | 48,479 |
| Colombian TES (コロンビア) 7.25% 2016/6/15                        |   | 36,369 | Colombia Government International Bond (コロンビア) 7.75% 2021/4/14 |   | 36,731 |
| Colombian TES (コロンビア) 11% 2020/7/24                          |   | 33,225 | Colombian TES (コロンビア) 7.25% 2016/6/15                          |   | 32,504 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/7/1            |   | 30,299 | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2016/7/1              |   | 27,031 |
| Colombian TES (コロンビア) 6% 2028/4/28                           |   | 27,849 | Poland Government Bond (ポーランド) 2016/1/25                       |   | 26,273 |
| Colombian TES (コロンビア) 7% 2019/9/11                           |   | 26,812 | Turkey Government Bond (トルコ) 9% 2016/1/27                      |   | 25,031 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2021/1/1 |   | 26,405 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.25% 2017/9/15               |   | 21,766 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1 |   | 26,371 | Mexican Bonos (メキシコ) 6.25% 2016/6/16                           |   | 21,662 |
| Turkey Government Bond (トルコ) 7.4% 2020/2/5                   |   | 26,331 | Colombia Government International Bond (コロンビア) 9.85% 2027/6/28 |   | 20,608 |

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

| 区 分    | 当 期                       |                           |           |      | 未                  |           |      |      |
|--------|---------------------------|---------------------------|-----------|------|--------------------|-----------|------|------|
|        | 額 面 金 額                   | 評 価 額                     |           | 組入比率 | うちBB格<br>以下組入<br>率 | 残存期間別組入比率 |      |      |
|        |                           | 外 貨 建 金 額                 | 邦貨換算金額    |      |                    | 5年以上      | 2年以上 | 2年未満 |
|        |                           |                           | 千円        | %    | %                  | %         | %    | %    |
| トルコ    | 千トルコ・リラ<br>6,700          | 千トルコ・リラ<br>6,539          | 295,338   | 9.5  | —                  | 3.8       | 4.7  | 0.9  |
| メキシコ   | 千メキシコ・ペソ<br>35,610        | 千メキシコ・ペソ<br>39,498        | 306,508   | 9.8  | —                  | 6.1       | 2.7  | 1.1  |
| フィリピン  | 千フィリピン・ペソ<br>5,000        | 千フィリピン・ペソ<br>5,237        | 14,246    | 0.5  | —                  | 0.5       | —    | —    |
| コロンビア  | 千コロンビア・ペソ<br>4,080,000    | 千コロンビア・ペソ<br>4,303,649    | 200,119   | 6.4  | —                  | 5.1       | 1.3  | —    |
| インドネシア | 千インドネシア・ルピア<br>29,680,000 | 千インドネシア・ルピア<br>29,886,303 | 274,953   | 8.8  | —                  | 7.8       | 0.8  | 0.3  |
| ブラジル   | 千ブラジル・レアル<br>9,560        | 千ブラジル・レアル<br>7,762        | 303,433   | 9.7  | —                  | 3.2       | 3.5  | 3.0  |
| ルーマニア  | 千ルーマニア・レイ<br>2,320        | 千ルーマニア・レイ<br>2,538        | 76,188    | 2.4  | —                  | 0.8       | 1.1  | 0.5  |
| ロシア    | 千ロシア・ルーブル<br>82,940       | 千ロシア・ルーブル<br>72,887       | 159,622   | 5.1  | —                  | 2.0       | 2.0  | 1.1  |
| マレーシア  | 千マレーシア・リンギット<br>9,400     | 千マレーシア・リンギット<br>9,468     | 304,705   | 9.8  | —                  | 4.6       | 4.2  | 1.0  |
| 南アフリカ  | 千南アフリカ・ランド<br>31,460      | 千南アフリカ・ランド<br>30,332      | 300,594   | 9.6  | —                  | 7.7       | 2.0  | —    |
| タイ     | 千タイ・バーツ<br>62,350         | 千タイ・バーツ<br>66,538         | 240,870   | 7.7  | —                  | 4.1       | 2.3  | 1.3  |
| ペルー    | 千ペルー・ヌエボソル<br>1,400       | 千ペルー・ヌエボソル<br>1,405       | 54,218    | 1.7  | —                  | 1.7       | 0.0  | —    |
| ナイジェリア | 千ナイジェリア・ナイラ<br>86,800     | 千ナイジェリア・ナイラ<br>86,408     | 53,210    | 1.7  | 1.7                | 0.8       | 0.3  | 0.6  |
| ポーランド  | 千ポーランド・ズロチ<br>8,730       | 千ポーランド・ズロチ<br>9,299       | 298,791   | 9.6  | —                  | 3.8       | 4.6  | 1.2  |
| ハンガリー  | 千ハンガリー・フォリント<br>284,400   | 千ハンガリー・フォリント<br>322,911   | 137,786   | 4.4  | 4.4                | 2.1       | 1.9  | 0.4  |
| 合計     | —                         | —                         | 3,020,589 | 96.9 | 6.1                | 54.1      | 31.3 | 11.4 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。  
(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。  
(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

|       |                                          | 当 期  |         |                     | 未 評 価 額             |              |            |
|-------|------------------------------------------|------|---------|---------------------|---------------------|--------------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                                      | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額             | 外 貨 建 金 額           | 邦貨換算金額       | 償還年月日      |
| トルコ   | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 10.5000 | 千トルコ・リラ<br>350      | 千トルコ・リラ<br>366      | 千円<br>16,568 | 2020/01/15 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 9.5000  | 390                 | 394                 | 17,797       | 2022/01/12 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 9.0000  | 370                 | 368                 | 16,634       | 2017/03/08 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.5000  | 390                 | 375                 | 16,969       | 2022/09/14 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 6.3000  | 400                 | 372                 | 16,804       | 2018/02/14 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 7.1000  | 560                 | 496                 | 22,406       | 2023/03/08 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.3000  | 470                 | 457                 | 20,673       | 2018/06/20 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.8000  | 680                 | 662                 | 29,925       | 2023/09/27 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.8000  | 580                 | 571                 | 25,799       | 2018/11/14 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 10.4000 | 370                 | 382                 | 17,268       | 2019/03/27 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 10.4000 | 270                 | 288                 | 13,046       | 2024/03/20 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.5000  | 530                 | 517                 | 23,348       | 2019/07/10 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 9.0000  | 430                 | 424                 | 19,185       | 2024/07/24 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 8.2000  | 280                 | 276                 | 12,464       | 2016/11/16 |
|       | Turkey Government Bond                   | 国債証券 | 7.4000  | 630                 | 585                 | 26,445       | 2020/02/05 |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金 額                               | 15銘柄 |         | 6,700               | 6,539               | 295,338      |            |
| メキシコ  | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 5.0000  | 千メキシコ・ペソ<br>1,200   | 千メキシコ・ペソ<br>1,190   | 千円<br>9,237  | 2019/12/11 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.0000  | 1,400               | 1,581               | 12,273       | 2023/12/07 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 10.0000 | 3,320               | 4,250               | 32,980       | 2024/12/05 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.5000  | 2,180               | 2,394               | 18,580       | 2027/06/03 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.2500  | 3,100               | 3,251               | 25,231       | 2016/12/15 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500  | 2,180               | 2,356               | 18,284       | 2017/12/14 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 10.0000 | 870                 | 1,188               | 9,223        | 2036/11/20 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.5000  | 1,380               | 1,643               | 12,750       | 2029/05/31 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.5000  | 2,300               | 2,562               | 19,886       | 2018/12/13 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.5000  | 1,950               | 2,318               | 17,994       | 2038/11/18 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 8.0000  | 1,340               | 1,502               | 11,662       | 2020/06/11 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 6.5000  | 2,650               | 2,769               | 21,493       | 2021/06/10 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500  | 2,250               | 2,504               | 19,434       | 2031/05/29 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 6.5000  | 1,590               | 1,649               | 12,798       | 2022/06/09 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500  | 2,290               | 2,530               | 19,637       | 2042/11/13 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 5.0000  | 1,010               | 1,028               | 7,982        | 2017/06/15 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 4.7500  | 3,150               | 3,163               | 24,546       | 2018/06/14 |
|       | Mexican Bonos                            | 国債証券 | 7.7500  | 1,450               | 1,612               | 12,510       | 2034/11/23 |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金 額                               | 18銘柄 |         | 35,610              | 39,498              | 306,508      |            |
| フィリピン | Philippine Government International Bond | 国債証券 | 4.9500  | 千フィリピン・ペソ<br>5,000  | 千フィリピン・ペソ<br>5,237  | 千円<br>14,246 | 2021/01/15 |
| 通貨小計  | 銘柄数<br>金 額                               | 1銘柄  |         | 5,000               | 5,237               | 14,246       |            |
| コロンビア | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | 9.8500  | 千コロンビア・ペソ<br>50,000 | 千コロンビア・ペソ<br>61,125 | 千円<br>2,842  | 2027/06/28 |
|       | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | 7.7500  | 45,000              | 49,522              | 2,302        | 2021/04/14 |
|       | Colombia Government International Bond   | 国債証券 | 4.3750  | 25,000              | 22,550              | 1,048        | 2023/03/21 |
|       | Colombian TES                            | 国債証券 | 5.0000  | 350,000             | 346,374             | 16,106       | 2018/11/21 |
|       | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.0000  | 500,000             | 520,555             | 24,205       | 2019/09/11 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

|        |                                          | 当 期  |         |             | 末           |         |            |
|--------|------------------------------------------|------|---------|-------------|-------------|---------|------------|
| 区 分    | 銘 柄                                      | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額     | 評 価 額       |         | 償還年月日      |
|        |                                          |      |         |             | 外 貨 建 金 額   | 邦貨換算金額  |            |
|        |                                          |      | %       | 千コロンビア・ペソ   | 千コロンビア・ペソ   | 千円      |            |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 11.0000 | 530,000     | 639,031     | 29,714  | 2020/07/24 |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.0000  | 450,000     | 454,725     | 21,144  | 2022/05/04 |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 10.0000 | 1,010,000   | 1,189,194   | 55,297  | 2024/07/24 |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 6.0000  | 590,000     | 502,337     | 23,358  | 2028/04/28 |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.5000  | 330,000     | 323,162     | 15,027  | 2026/08/26 |
|        | Colombian TES                            | 国債証券 | 7.7500  | 200,000     | 195,072     | 9,070   | 2030/09/18 |
| 通貨小計   | 銘柄数                                      | 11銘柄 |         |             |             |         |            |
|        | 金 額                                      |      |         | 4,080,000   | 4,303,649   | 200,119 |            |
|        |                                          |      | %       | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア | 千円      |            |
| インドネシア | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 10.0000 | 250,000     | 260,122     | 2,393   | 2017/07/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 11.0000 | 700,000     | 786,177     | 7,232   | 2020/11/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 12.8000 | 400,000     | 486,592     | 4,476   | 2021/06/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 11.0000 | 1,200,000   | 1,422,720   | 13,089  | 2025/09/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 10.5000 | 780,000     | 922,412     | 8,486   | 2030/08/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.2500  | 1,560,000   | 1,572,214   | 14,464  | 2021/07/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 9.5000  | 1,300,000   | 1,427,335   | 13,131  | 2031/07/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 7.3750  | 250,000     | 250,067     | 2,300   | 2016/09/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.3750  | 620,000     | 627,681     | 5,774   | 2026/09/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.2500  | 1,320,000   | 1,304,635   | 12,002  | 2032/06/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 7.0000  | 690,000     | 624,663     | 5,746   | 2027/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 7.0000  | 1,160,000   | 1,090,574   | 10,033  | 2022/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 6.2500  | 660,000     | 644,107     | 5,925   | 2017/04/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 5.6250  | 910,000     | 776,257     | 7,141   | 2023/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 6.1250  | 1,200,000   | 998,808     | 9,189   | 2028/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 6.6250  | 1,340,000   | 1,121,057   | 10,313  | 2033/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 5.2500  | 870,000     | 812,797     | 7,477   | 2018/05/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.3750  | 3,730,000   | 3,728,470   | 34,301  | 2034/03/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 8.3750  | 5,290,000   | 5,347,713   | 49,198  | 2024/03/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 9.0000  | 3,850,000   | 4,082,039   | 37,554  | 2029/03/15 |
|        | Indonesia Treasury Bond                  | 国債証券 | 7.8750  | 1,600,000   | 1,599,856   | 14,718  | 2019/04/15 |
| 通貨小計   | 銘柄数                                      | 21銘柄 |         |             |             |         |            |
|        | 金 額                                      |      |         | 29,680,000  | 29,886,303  | 274,953 |            |
|        |                                          |      | %       | 千ブラジル・レアル   | 千ブラジル・レアル   | 千円      |            |
| ブラジル   | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 870         | 828         | 32,405  | 2017/01/01 |
|        | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 1,160       | 1,047       | 40,956  | 2021/01/01 |
|        | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 190         | 178         | 6,984   | 2018/01/01 |
|        | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 880         | 779         | 30,461  | 2023/01/01 |
|        | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 390         | 362         | 14,151  | 2019/01/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 730         | 602         | 23,547  | 2017/01/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 800         | 623         | 24,358  | 2017/07/01 |
|        | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 850         | 739         | 28,896  | 2025/01/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 820         | 604         | 23,639  | 2018/01/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 870         | 606         | 23,693  | 2018/07/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 390         | 331         | 12,947  | 2016/10/01 |
|        | Brazil Letras do Tesouro Nacional        | 国債証券 | —       | 1,610       | 1,058       | 41,392  | 2019/01/01 |
| 通貨小計   | 銘柄数                                      | 12銘柄 |         |             |             |         |            |
|        | 金 額                                      |      |         | 9,560       | 7,762       | 303,433 |            |
|        |                                          |      | %       | 千ルーマニア・レイ   | 千ルーマニア・レイ   | 千円      |            |
| ルーマニア  | Romania Government Bond                  | 国債証券 | 5.9000  | 300         | 324         | 9,746   | 2017/07/26 |

|       |                                 | 当 期  |        |              | 未 期          |         |            |
|-------|---------------------------------|------|--------|--------------|--------------|---------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                             | 種 類  | 年利率    | 額 面 金 額      | 評 価 額        |         | 償還年月日      |
|       |                                 |      |        |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額  |            |
|       |                                 |      | %      | 千ルーマニア・レイ    | 千ルーマニア・レイ    | 千円      |            |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 4.7500 | 270          | 280          | 8,417   | 2016/08/29 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 5.8500 | 350          | 392          | 11,790  | 2023/04/26 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 4.7500 | 240          | 259          | 7,773   | 2019/06/24 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 5.6000 | 280          | 309          | 9,292   | 2018/11/28 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 5.9500 | 240          | 273          | 8,202   | 2021/06/11 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 6.7500 | 250          | 273          | 8,198   | 2017/06/11 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 5.7500 | 220          | 247          | 7,414   | 2020/04/29 |
|       | Romania Government Bond         | 国債証券 | 4.7500 | 170          | 178          | 5,352   | 2025/02/24 |
| 通貨小計  | 銘柄数                             | 9銘柄  |        |              |              |         |            |
|       | 金 額                             |      |        | 2,320        | 2,538        | 76,188  |            |
| ロシア   |                                 |      | %      | 千ロシア・ルーブル    | 千ロシア・ルーブル    | 千円      |            |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.5000 | 4,200        | 3,912        | 8,567   | 2018/03/15 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.9000 | 4,100        | 3,960        | 8,673   | 2016/08/03 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.4000 | 6,750        | 6,426        | 14,072  | 2017/06/14 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.6000 | 4,580        | 3,984        | 8,726   | 2021/04/14 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.5000 | 6,730        | 6,120        | 13,404  | 2019/02/27 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 8.1500 | 6,660        | 5,594        | 12,251  | 2027/02/03 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.4000 | 6,250        | 5,975        | 13,085  | 2017/04/19 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.6000 | 4,610        | 3,918        | 8,581   | 2022/07/20 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.8000 | 5,400        | 4,676        | 10,241  | 2019/12/11 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0000 | 4,800        | 3,900        | 8,541   | 2023/01/25 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0500 | 6,260        | 4,757        | 10,419  | 2028/01/19 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.2000 | 4,600        | 4,151        | 9,091   | 2018/01/31 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 6.7000 | 5,600        | 4,933        | 10,804  | 2019/05/15 |
|       | Russian Federal Bond - OFZ      | 国債証券 | 7.0000 | 7,400        | 5,945        | 13,021  | 2023/08/16 |
|       | Russian Foreign Bond - Eurobond | 国債証券 | 7.8500 | 5,000        | 4,630        | 10,139  | 2018/03/10 |
| 通貨小計  | 銘柄数                             | 15銘柄 |        |              |              |         |            |
|       | 金 額                             |      |        | 82,940       | 72,887       | 159,622 |            |
| マレーシア |                                 |      | %      | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円      |            |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.2620 | 370          | 375          | 12,081  | 2016/09/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.2400 | 510          | 520          | 16,754  | 2018/02/07 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 5.7340 | 410          | 443          | 14,274  | 2019/07/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.3780 | 700          | 722          | 23,237  | 2019/11/29 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.0120 | 370          | 376          | 12,118  | 2017/09/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.4980 | 350          | 364          | 11,745  | 2030/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1600 | 410          | 417          | 13,431  | 2021/07/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.3920 | 340          | 350          | 11,288  | 2026/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.5800 | 410          | 411          | 13,256  | 2018/09/28 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4180 | 440          | 427          | 13,761  | 2022/08/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.8920 | 300          | 294          | 9,468   | 2027/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1270 | 190          | 187          | 6,039   | 2032/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.3140 | 480          | 481          | 15,484  | 2017/10/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4920 | 330          | 327          | 10,548  | 2020/03/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.2600 | 460          | 457          | 14,735  | 2018/03/01 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.4800 | 470          | 457          | 14,735  | 2023/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.8440 | 320          | 302          | 9,727   | 2033/04/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.7330 | 140          | 133          | 4,306   | 2028/06/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 3.8890 | 160          | 161          | 5,205   | 2020/07/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT            | 国債証券 | 4.1810 | 390          | 395          | 12,729  | 2024/07/15 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

|       |                          | 当 期  |         |              | 末            |         |            |
|-------|--------------------------|------|---------|--------------|--------------|---------|------------|
| 区 分   | 銘 柄                      | 種 類  | 年利率     | 額 面 金 額      | 評 価 額        |         | 償還年月日      |
|       |                          |      |         |              | 外 貨 建 金 額    | 邦貨換算金額  |            |
|       |                          |      | %       | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | 千円      |            |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.3940  | 560          | 563          | 18,128  | 2017/03/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 4.0480  | 400          | 404          | 13,028  | 2021/09/30 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.6540  | 290          | 290          | 9,347   | 2019/10/31 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.9550  | 150          | 149          | 4,821   | 2025/09/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.6590  | 100          | 100          | 3,230   | 2020/10/15 |
|       | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 国債証券 | 3.7950  | 350          | 348          | 11,217  | 2022/09/30 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 26銘柄 |         |              |              |         |            |
|       | 金 額                      |      |         | 9,400        | 9,468        | 304,705 |            |
|       |                          |      | %       | 千南アフリカ・ランド   | 千南アフリカ・ランド   | 千円      |            |
| 南アフリカ | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500  | 2,280        | 2,327        | 23,069  | 2017/09/15 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000  | 1,600        | 1,622        | 16,083  | 2018/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.2500  | 2,340        | 2,297        | 22,763  | 2020/01/15 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10.5000 | 5,010        | 5,836        | 57,841  | 2026/12/21 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.2500  | 2,520        | 1,910        | 18,928  | 2036/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.7500  | 2,460        | 2,331        | 23,103  | 2021/03/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.5000  | 2,210        | 1,685        | 16,702  | 2041/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.0000  | 2,480        | 2,122        | 21,032  | 2031/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.7500  | 1,580        | 1,547        | 15,334  | 2023/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500  | 2,430        | 2,386        | 23,650  | 2048/02/28 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.5000  | 2,400        | 2,315        | 22,942  | 2037/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000  | 2,650        | 2,506        | 24,836  | 2030/01/31 |
|       | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500  | 1,500        | 1,443        | 14,304  | 2032/03/31 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 13銘柄 |         |              |              |         |            |
|       | 金 額                      |      |         | 31,460       | 30,332       | 300,594 |            |
|       |                          |      | %       | 千タイ・バーツ      | 千タイ・バーツ      | 千円      |            |
| タイ    | Thailand Government Bond | 国債証券 | 5.1250  | 3,000        | 3,269        | 11,836  | 2018/03/13 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.8750  | 11,600       | 12,364       | 44,758  | 2019/06/13 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 4.7500  | 1,600        | 1,838        | 6,656   | 2024/12/20 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 4.8750  | 5,400        | 6,302        | 22,813  | 2029/06/22 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 4.1250  | 2,300        | 2,380        | 8,618   | 2016/11/18 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.6250  | 7,300        | 7,696        | 27,860  | 2023/06/16 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.8000  | 1,900        | 1,949        | 7,058   | 2017/10/10 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.8500  | 4,000        | 4,328        | 15,668  | 2025/12/12 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.6500  | 11,000       | 11,666       | 42,231  | 2021/12/17 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.2500  | 8,800        | 9,084        | 32,886  | 2017/06/16 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.4500  | 2,200        | 2,301        | 8,332   | 2019/03/08 |
|       | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.5800  | 3,250        | 3,355        | 12,147  | 2027/12/17 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 12銘柄 |         |              |              |         |            |
|       | 金 額                      |      |         | 62,350       | 66,538       | 240,870 |            |
|       |                          |      | %       | 千ペルー・ヌエボソル   | 千ペルー・ヌエボソル   | 千円      |            |
| ペルー   | Peru Government Bond     | 国債証券 | 5.7000  | 190          | 179          | 6,927   | 2024/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 8.2000  | 230          | 254          | 9,823   | 2026/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 7.8400  | 240          | 265          | 10,252  | 2020/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 6.9000  | 150          | 142          | 5,486   | 2037/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 6.9500  | 340          | 329          | 12,714  | 2031/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 8.6000  | 20           | 21           | 844     | 2017/08/12 |
|       | Peru Government Bond     | 国債証券 | 5.2000  | 230          | 211          | 8,169   | 2023/09/12 |
| 通貨小計  | 銘柄数                      | 7銘柄  |         |              |              |         |            |
|       | 金 額                      |      |         | 1,400        | 1,405        | 54,218  |            |

|        |     | 当 期                     |      |         | 未                      |                        |              |            |
|--------|-----|-------------------------|------|---------|------------------------|------------------------|--------------|------------|
| 区 分    |     | 銘 柄                     | 種 類  | 年 利 率   | 額 面 金 額                | 評 価 額                  |              | 償 還 年 月 日  |
|        |     |                         |      |         |                        | 外 貨 建 金 額              | 邦 貨 換 算 金 額  |            |
| ナイジェリア |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 16.0000 | 千ナイジェリア・ナイラ<br>9,000   | 千ナイジェリア・ナイラ<br>9,315   | 千円<br>5,736  | 2019/06/29 |
|        |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 16.3900 | 16,800                 | 17,942                 | 11,048       | 2022/01/27 |
|        |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 7.0000  | 4,500                  | 3,410                  | 2,099        | 2019/10/23 |
|        |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 15.1000 | 16,500                 | 16,648                 | 10,252       | 2017/04/27 |
|        |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 14.2000 | 25,000                 | 24,287                 | 14,956       | 2024/03/14 |
|        |     | Nigeria Government Bond | 国債証券 | 13.0500 | 15,000                 | 14,805                 | 9,116        | 2016/08/16 |
| 通貨小計   | 銘柄数 | 6銘柄                     |      |         |                        |                        |              |            |
|        | 金 額 |                         |      |         | 86,800                 | 86,408                 | 53,210       |            |
| ポーランド  |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 5.7500  | 千ポーランド・ズロチ<br>660      | 千ポーランド・ズロチ<br>778      | 千円<br>24,999 | 2022/09/23 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 5.2500  | 700                    | 752                    | 24,182       | 2017/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 5.5000  | 820                    | 921                    | 29,603       | 2019/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | —       | 300                    | 288                    | 9,278        | 2017/07/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 1.5000  | 570                    | 542                    | 17,418       | 2020/04/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 5.2500  | 800                    | 902                    | 28,983       | 2020/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 5.7500  | 450                    | 525                    | 16,887       | 2021/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 4.7500  | 720                    | 748                    | 24,049       | 2016/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 4.7500  | 410                    | 431                    | 13,851       | 2017/04/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 4.0000  | 830                    | 885                    | 28,442       | 2023/10/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 3.7500  | 510                    | 532                    | 17,110       | 2018/04/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 2.5000  | 720                    | 726                    | 23,344       | 2018/07/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 3.2500  | 660                    | 680                    | 21,872       | 2019/07/25 |
|        |     | Poland Government Bond  | 国債証券 | 3.2500  | 580                    | 584                    | 18,767       | 2025/07/25 |
|        |     | 通貨小計                    | 銘柄数  | 14銘柄    |                        |                        |              |            |
| 金 額    |     |                         |      |         | 8,730                  | 9,299                  | 298,791      |            |
| ハンガリー  |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.5000  | 千ハンガリー・フォリント<br>24,000 | 千ハンガリー・フォリント<br>24,693 | 千円<br>10,536 | 2020/06/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 7.5000  | 33,500                 | 40,967                 | 17,480       | 2020/11/12 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 6.7500  | 21,400                 | 24,003                 | 10,242       | 2017/11/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 6.7500  | 18,000                 | 19,571                 | 8,351        | 2017/02/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 6.0000  | 43,000                 | 49,821                 | 21,259       | 2023/11/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 6.5000  | 42,000                 | 48,176                 | 20,556       | 2019/06/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 7.0000  | 34,000                 | 41,007                 | 17,497       | 2022/06/24 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 5.5000  | 7,000                  | 7,455                  | 3,181        | 2016/12/22 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 5.5000  | 15,000                 | 16,599                 | 7,082        | 2018/12/20 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 4.0000  | 26,000                 | 27,372                 | 11,679       | 2018/04/25 |
|        |     | Hungary Government Bond | 国債証券 | 5.5000  | 20,500                 | 23,242                 | 9,917        | 2025/06/24 |
|        |     | 通貨小計                    | 銘柄数  | 11銘柄    |                        |                        |              |            |
| 金 額    |     |                         |      |         | 284,400                | 322,911                | 137,786      |            |
| 合 計    | 銘柄数 | 191銘柄                   |      |         |                        |                        |              |            |
|        | 金 額 |                         |      |         |                        |                        | 3,020,589    |            |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2015年7月6日現在

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評 価 額     | 比 率   |
|              | 千円        | %     |
| 公社債          | 3,020,589 | 92.7  |
| コール・ローン等、その他 | 239,453   | 7.3   |
| 投資信託財産総額     | 3,260,043 | 100.0 |

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
- (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=122.49円、1トルコ・リラ=45.16円、1メキシコ・ペソ=7.76円、1フィリピン・ペソ=2.72円、100コロンビア・ペソ=4.65円、100インドネシア・ルピア=0.92円、1ブラジル・レアル=39.09円、1ルーマニア・レイ=30.01円、1ロシア・ルーブル=2.19円、1マレーシア・リンギット=32.18円、1南アフリカ・ランド=9.91円、1タイ・バーツ=3.62円、1ペルー・ヌエボソル=38.57円、100ナイジェリア・ナイラ=61.58円、1ポーランド・ズロチ=32.13円、100ハンガリー・フォリント=42.67円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産 (3,091,200千円) の投資信託財産総額 (3,260,043千円) に対する比率は、94.8% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年7月6日現在

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
| (A)資産           | 3,284,618,973円 |
| コール・ローン等        | 185,094,497    |
| 公社債 (評価額)       | 3,020,589,740  |
| 未収入金            | 25,462,294     |
| 未収利息            | 40,855,028     |
| 前払費用            | 12,617,414     |
| (B)負債           | 166,075,146    |
| 未払金             | 165,575,146    |
| 未払解約金           | 500,000        |
| (C)純資産総額 (A－B)  | 3,118,543,827  |
| 元本              | 2,264,504,559  |
| 次期繰越損益金         | 854,039,268    |
| (D)受益権総口数       | 2,264,504,559口 |
| 1万口当り基準価額 (C／D) | 13,771円        |

- \* 期首における元本額は1,647,688,099円、当期中における追加設定元本額は769,642,371円、同解約元本額は152,825,911円です。
- \* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ新興国債券インデックスファンド (適格機関投資家専用) 489,506,556円、D－I's 新興国債券インデックス17,927,097円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド1,656,402,068円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券100,668,838円です。
- \* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,771円です。

■損益の状況

当期 自2014年7月8日 至2015年7月6日

| 項 目                    | 当 期           |
|------------------------|---------------|
| (A) 配当等収益              | 159,206,336円  |
| 受取利息                   | 159,206,336   |
| (B) 有価証券売買損益           | △ 155,470,939 |
| 売買益                    | 75,301,556    |
| 売買損                    | △ 230,772,495 |
| (C) その他費用              | △ 5,945,407   |
| (D) 当期損益金 (A + B + C)  | △ 2,210,010   |
| (E) 前期繰越損益金            | 613,928,268   |
| (F) 解約差損益金             | △ 62,119,919  |
| (G) 追加信託差損益金           | 304,440,929   |
| (H) 合計 (D + E + F + G) | 854,039,268   |
| 次期繰越損益金 (H)            | 854,039,268   |

- (注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

《お知らせ》

●書面決議手続きの改正について

重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。

- 書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。
- 投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。
- 書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託 (当ファンドは該当します。) には適用されなくなりました。