

★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。 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。 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 5 期

(決算日 2018年 7 月 5 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5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

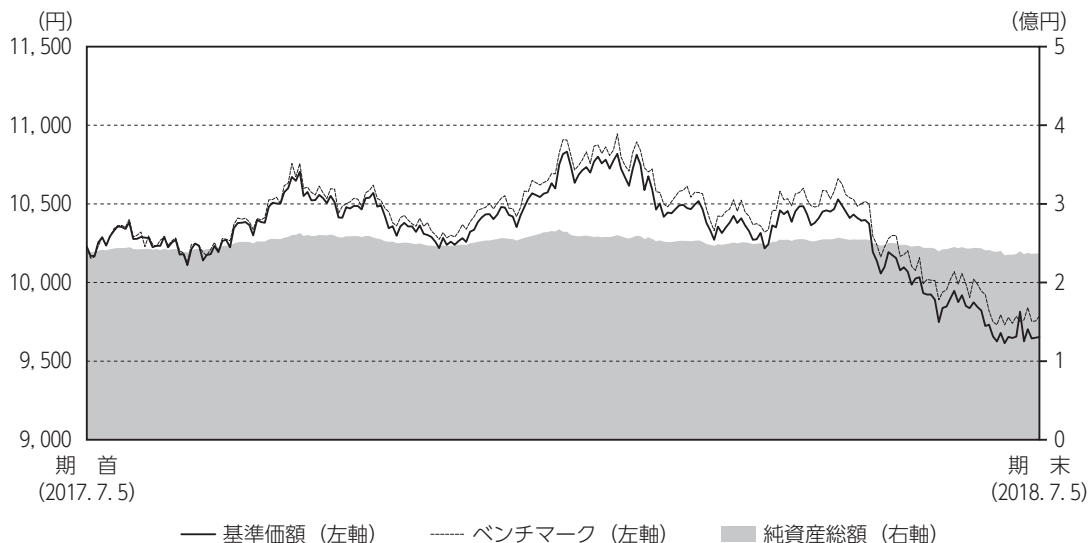
決 算 期	基 準 価 額			J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公 社 債 組入比率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末 (2014年 7 月 7 日)	10,445	0	4.5	10,494	4.9	96.9	58
2 期末 (2015年 7 月 6 日)	10,411	0	△ 0.3	10,637	1.4	96.8	138
3 期末 (2016年 7 月 5 日)	8,864	0	△ 14.9	9,109	△ 14.4	96.4	162
4 期末 (2017年 7 月 5 日)	10,228	0	15.4	10,631	16.7	97.1	239
5 期末 (2018年 7 月 5 日)	9,653	0	△ 5.6	10,172	△ 4.3	96.7	237

- (注 1) 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) をもとに円換算し、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・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 2016, 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) です。

基準価額・騰落率

期 首：10,228円

期 末：9,653円

騰落率：△5.6%

基準価額の主な変動要因

投資している債券の利息収入はプラス要因となったものの、債券価格の下落（金利は上昇）および新興国通貨の対円為替レート下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	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)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
	円	%		%	%
(期首)2017年 7 月 5 日	10, 228	—	10, 631	—	97. 1
7 月末	10, 225	△ 0. 0	10, 646	0. 1	95. 8
8 月末	10, 378	1. 5	10, 820	1. 8	96. 5
9 月末	10, 524	2. 9	10, 971	3. 2	96. 8
10月末	10, 297	0. 7	10, 769	1. 3	96. 5
11月末	10, 336	1. 1	10, 828	1. 9	96. 4
12月末	10, 598	3. 6	11, 112	4. 5	93. 3
2018年 1 月末	10, 615	3. 8	11, 129	4. 7	96. 1
2 月末	10, 466	2. 3	10, 980	3. 3	95. 6
3 月末	10, 435	2. 0	10, 939	2. 9	96. 4
4 月末	10, 394	1. 6	10, 915	2. 7	96. 1
5 月末	9, 839	△ 3. 8	10, 329	△ 2. 8	96. 6
6 月末	9, 626	△ 5. 9	10, 147	△ 4. 5	95. 8
(期末)2018年 7 月 5 日	9, 653	△ 5. 6	10, 172	△ 4. 3	96. 7

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.7.6～2018.7.5)

■新興国債券市況

新興国債券市況は、個別国要因でまちまちの展開となりました。

米国の利上げを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。国別では、財政難が懸念されたアルゼンチン、外国投資家による国債保有比率が高いインドネシア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ、NAFTA（北米自由貿易協定）再交渉が停滞しているメキシコの国債が売られ、金利は上昇しました。南アフリカは政権交代が好感されたことから国債が買われ、金利は低下しました。

■為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で下落しました。

米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことに加えて、米ドル円の円高傾向も、新興国通貨の下落要因になりました。通貨別では、財政難が懸念されたアルゼンチン・ペソ、資金流出懸念が高まったインドネシア・ルピア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ・リラ、NAFTA再交渉が停滞しているメキシコ・ペソ、年金改革の頓挫に加えてトラック運転手によるストライキの影響が経済に幅広く悪影響を与えたブラジル・レアル、米国による経済制裁が強化されたロシア・ルーブルなどが下落しました。

前期における「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、「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み入れ、ベンチマーク（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））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（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））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

(2017. 7. 6 ~ 2018. 7. 5)

■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み入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

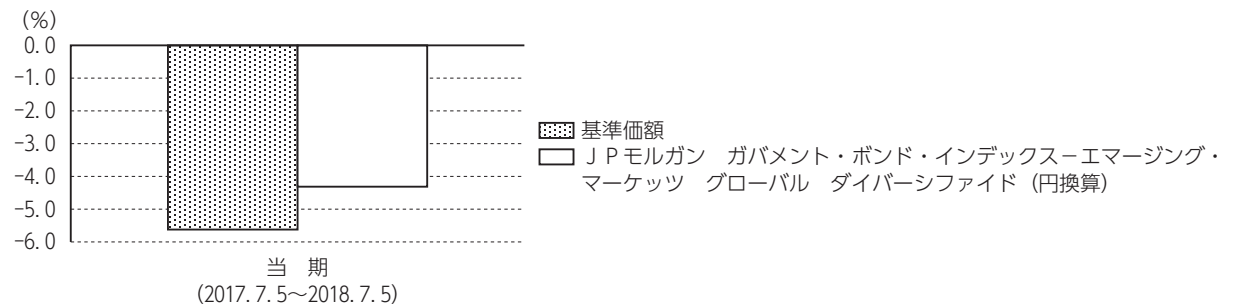
■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

当期のベンチマークの騰落率は△4.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.6%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金や売買に伴う費用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ため、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（1万口当たり）

項 目		当 期
		2017年7月6日 ～2018年7月5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)	678

(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、引き続き、「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み入れ、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 (2017.7.6～2018.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	67円	0.648%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,331円です。
(投 信 会 社)	(32)	(0.308)	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)	(32)	(0.308)	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／期中の平均受益権口数 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 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	19	0.182	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)	(18)	(0.170)	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)	(0.004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	86	0.830	

(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、このファンドが組み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

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	35,180	49,037	27,919	39,115

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	174,677	181,938	237,047

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年7月5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	237,047	99.6
コール・ローン等、その他	1,060	0.4
投資信託財産総額	238,107	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5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝110.43円、1トルコ・リラ＝23.61円、1メキシコ・ペソ＝5.68円、1フィリピン・ペソ＝2.07円、1アルゼンチン・ペソ＝3.93円、100チリ・ペソ＝16.93円、100コロンビア・ペソ＝3.80円、100インドネシア・ルピア＝0.77円、1ブラジル・レアル＝28.22円、1チェコ・コルナ＝4.95円、1ルーマニア・レイ＝27.63円、1ロシア・ルーブル＝1.74円、1マレーシア・リンギット＝27.31円、1南アフリカ・ランド＝8.06円、1タイ・バーツ＝3.33円、1ペルー・ソル＝33.55円、1ポーランド・ズロチ＝29.38円、100ハンガリー・フォリント＝39.58円、1ウルグアイ・ペソ＝3.52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(9,125,733千円)の投資信託財産総額(9,398,391千円)に対する比率は、97.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	238,107,774円
コール・ローン等	1,060,234
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド(評価額)	237,047,540
(B) 負債	834,547
未払解約金	19,288
未払信託報酬	805,248
その他未払費用	10,011
(C) 純資産総額(A－B)	237,273,227
元本	245,793,974
次期繰越損益金	△ 8,520,747
(D) 受益権総口数	245,793,974口
1万口当り基準価額(C／D)	9,653円

* 期首における元本額は234,441,315円、当期中における追加設定元本額は69,154,075円、同解約元本額は57,801,416円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,653円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は8,520,747円です。

■損益の状況

当期 自 2017年7月6日 至 2018年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 281円
受取利息	21
支払利息	△ 302
(B) 有価証券売買損益	△ 13,374,357
売買益	1,408,267
売買損	△ 14,782,624
(C) 信託報酬等	△ 1,645,747
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 15,020,385
(E) 前期繰越損益金	5,818,935
(F) 追加信託差損益金	680,703
(配当等相当額)	(10,869,050)
(売買損益相当額)	(△ 10,188,347)
(G) 合計(D＋E＋F)	△ 8,520,747
次期繰越損益金(G)	△ 8,520,747
追加信託差損益金	680,703
(配当等相当額)	(10,869,050)
(売買損益相当額)	(△ 10,188,347)
分配準備積立金	5,819,467
繰越損益金	△ 15,020,917

(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)」の表をご参照ください。

■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	10,869,050
(d) 分配準備積立金	5,819,467
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	16,688,517
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e − f）	16,688,517
(h) 受益権総口数	245,793,974口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」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。

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 8 期（決算日 2018年 7 月 5 日）

（計算期間 2017年 7 月 6 日～2018年 7 月 5 日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第 8 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 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ないます。
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 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ないます。 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。 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

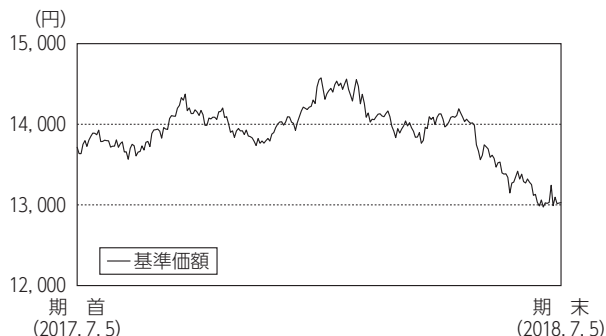
Daiwa Asset Management

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) 2017年 7 月 5 日	13,715	—	14,485	—	97.1
7 月末	13,717	0.0	14,506	0.1	95.9
8 月末	13,930	1.6	14,743	1.8	96.6
9 月末	14,134	3.1	14,950	3.2	96.9
10 月末	13,837	0.9	14,673	1.3	96.6
11 月末	13,897	1.3	14,755	1.9	96.5
12 月末	14,257	4.0	15,141	4.5	93.4
2018年 1 月末	14,288	4.2	15,165	4.7	96.2
2 月末	14,094	2.8	14,962	3.3	95.7
3 月末	14,060	2.5	14,906	2.9	96.4
4 月末	14,012	2.2	14,873	2.7	96.2
5 月末	13,272	△ 3.2	14,075	△ 2.8	96.7
6 月末	12,991	△ 5.3	13,827	△ 4.5	95.9
(期末) 2018年 7 月 5 日	13,029	△ 5.0	13,861	△ 4.3	96.8

(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) をもとに円換算し、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 2016, 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：13,715円 期末：13,029円 騰落率：△5.0%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入はプラス要因となったものの、債券価格の下落 (金利は上昇) および新興国通貨の対円為替レート下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○新興国債券市場

新興国債券市場は、個別国要因でまちまちの展開となりました。

米国の利上げを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。国別では、財政難が懸念されたアルゼンチン、外国投資家による国債保有比率が高いインドネシア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ、NAFTA (北米自由貿易協定) 再交渉が停滞しているメキシコの国債が売られ、金利は上昇しました。南アフリカは政権交代が好感されたことから国債が買われ、金利は低下しました。

○為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で下落しました。

米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことに加えて、米ドル円の円高傾向も、新興国通貨の下落要因となりました。通貨別では、財政難が懸念されたアルゼンチン・ペソ、資金流出懸念が高まったインドネシア・ルピア、高インフレ率と中央銀行の独立性が脅かされる懸念が高まったトルコ・リラ、NAFTA 再交渉が停滞しているメキシコ・ペソ、年金改革の頓挫に加えてトラック運転手によるストライキの影響が経済に幅広く悪影響を与えたブラジル・レアル、米国による経済制裁が強化されたロシア・ルーブルなどが下落しました。

◆前期における「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 (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す。

◆ポートフォリオについて

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した。

◆ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は△4.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.0%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金や売買に伴う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 (保管費用)	24 (23)
(その他)	(1)
合 計	24

(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

(2017 年 7 月 6 日から 2018 年 7 月 5 日まで)

		買 付 額	売 付 額
外	トルコ	千トルコ・リラ 12, 593	千トルコ・リラ 2, 125 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 87, 209	千メキシコ・ペソ 7, 510 (—)
	フィリピン	千フィリピン・ペソ 5, 000	千フィリピン・ペソ — (—)
	アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 12, 765	千アルゼンチン・ペソ — (—)
	チリ	千チリ・ペソ 1, 465, 129	千チリ・ペソ 706, 251 (—)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 8, 819, 017	千コロンビア・ペソ 847, 944 (—)
国	インドネシア	千インドネシア・ルピア 54, 665, 440	千インドネシア・ルピア 5, 441, 540 (—)
	ブラジル	千ブラジル・レアル 21, 690	千ブラジル・レアル 7, 313 (—)
	チェコ	千チェコ・コルナ 44, 230	千チェコ・コルナ 990 (—)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 5, 052	千ルーマニア・レイ 1, 630 (—)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 233, 406	千ロシア・ルーブル 31, 040 (—)

		買 付 額	売 付 額
外	マレーシア	千マレーシア・リンギット 12, 442	千マレーシア・リンギット 7, 462 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 39, 957	千南アフリカ・ランド 3, 230 (—)
	タイ	千タイ・バーツ 117, 256	千タイ・バーツ 26, 835 (—)
	ペルー	千ペルー・ソル 4, 169	千ペルー・ソル — (—)
国	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 13, 057	千ポーランド・ズロチ 3, 622 (—)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 509, 503	千ハンガリー・フォリント 88, 042 (—)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 5, 373	千ウルグアイ・ペソ — (—)

(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

(2017年7月6日から2018年7月5日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	174,075	Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5	112,427
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2021/7/1	118,736	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	75,625
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	79,801	Thailand Government Bond (タイ) 3.875% 2019/6/13	63,441
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	78,228	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1	58,048
Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.7% 2033/3/23	74,288	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1	41,060
Colombian TES (コロンビア) 7.5% 2026/8/26	72,745	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/7/1	40,131
BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 5% 2035/3/1	70,798	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2018/12/13	40,109
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	69,410	Poland Government Bond (ポーランド) 2018/10/25	38,774
Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2021/6/10	68,353	Poland Government Bond (ポーランド) 3.25% 2019/7/25	37,452
BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 4.5% 2026/3/1	65,818	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7.875% 2019/4/15	31,229

(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)

作 成 期	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 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
区 分			千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 25,910	千トルコ・リラ 19,824	468,052	5.1	—	2.0	2.5	0.6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 163,040	千メキシコ・ペソ 164,808	936,112	10.2	—	5.8	2.8	1.6
フィリピン	千フィリピン・ペソ 15,000	千フィリピン・ペソ 14,947	30,941	0.3	—	—	0.3	—
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 21,900	千アルゼンチン・ペソ 19,795	77,795	0.8	0.8	0.7	0.2	—
チリ	千チリ・ペソ 1,330,000	千チリ・ペソ 1,368,734	231,726	2.5	—	1.8	0.7	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 17,515,000	千コロンビア・ペソ 18,749,500	712,481	7.7	—	5.0	2.2	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 107,949,000	千インドネシア・ルピア 107,170,158	825,210	9.0	—	7.0	1.9	—
ブラジル	千ブラジル・レアル 36,400	千ブラジル・レアル 32,046	904,358	9.8	—	2.1	4.0	3.8
チェコ	千チェコ・コルナ 73,900	千チェコ・コルナ 77,219	382,238	4.2	—	2.3	1.5	0.4
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 8,210	千ルーマニア・レイ 8,184	226,137	2.5	—	0.8	1.2	0.4
ロシア	千ロシア・ルーブル 388,310	千ロシア・ルーブル 389,810	678,270	7.4	—	4.6	2.2	0.6
マレーシア	千マレーシア・リンギット 19,040	千マレーシア・リンギット 18,948	517,475	5.6	—	3.0	1.3	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 100,940	千南アフリカ・ランド 92,765	747,686	8.1	—	6.9	0.8	0.4
タイ	千タイ・バーツ 205,160	千タイ・バーツ 215,352	717,123	7.8	—	4.0	3.1	0.7

作 成 期	当 期 末							
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	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
ペルー	千ペルー・ソル 7, 210	千ペルー・ソル 7, 758	千円 260, 309	% 2. 8	% —	% 2. 7	% 0. 1	% —
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 26, 390	千ポーランド・ズロチ 26, 948	791, 753	8. 6	—	3. 1	4. 5	1. 0
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 912, 600	千ハンガリー・フォリント 961, 505	380, 563	4. 1	—	2. 0	1. 8	0. 4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 5, 100	千ウルグアイ・ペソ 4, 681	16, 478	0. 2	—	0. 1	0. 1	—
合計	—	—	8, 904, 714	96. 8	0. 8	53. 9	31. 1	11. 8

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売相場の中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。
(注 4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

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	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	% 10. 5000	千トルコ・リラ 680	千トルコ・リラ 607	千円 14, 344	2020/01/15
	Turkey Government Bond	国債証券	9. 5000	1, 660	1, 300	30, 715	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8. 5000	790	583	13, 765	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7. 1000	1, 280	862	20, 359	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8. 8000	1, 390	987	23, 317	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10. 4000	680	511	12, 065	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9. 0000	1, 630	1, 138	26, 881	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	7. 4000	2, 070	1, 761	41, 590	2020/02/05
	Turkey Government Bond	国債証券	8. 0000	1, 490	962	22, 715	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	9. 4000	1, 180	999	23, 608	2020/07/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10. 7000	1, 610	1, 353	31, 945	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10. 6000	2, 570	1, 865	44, 039	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9. 2000	1, 010	790	18, 659	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11. 0000	1, 400	1, 141	26, 955	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11. 0000	1, 470	1, 072	25, 318	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10. 7000	1, 900	1, 516	35, 815	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10. 5000	1, 700	1, 198	28, 305	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12. 2000	1, 400	1, 171	27, 649	2023/01/18
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		25, 910	19, 824	468, 052	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5. 0000	千メキシコ・ペソ 9, 800	千メキシコ・ペソ 9, 432	53, 573	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5. 7500	10, 400	9, 267	52, 637	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8. 0000	4, 500	4, 619	26, 237	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7. 2500	5, 000	4, 928	27, 991	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8. 0000	4, 250	4, 309	24, 475	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10. 0000	18, 350	20, 560	116, 785	2024/12/05

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	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	10,230	10,140	57,599	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,026	51,269	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	7,230	7,681	43,632	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	4,100	4,409	25,045	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,990	17,088	97,062	2020/06/11
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	21,950	21,253	120,721	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,950	7,994	45,410	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	19,450	18,656	105,969	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	11,320	11,297	64,170	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,130	4,142	23,529	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			163,040	164,808	936,112	
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ	
				15,000	14,947	30,941	2021/01/15
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			15,000	14,947	30,941	
アルゼンチン		REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	千アルゼンチン・ペソ	千アルゼンチン・ペソ	
				4,700	4,110	16,152	2021/10/03
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	9,400	8,470	33,289	2023/10/17
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	7,800	7,214	28,352	2026/10/17
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金 額			21,900	19,795	77,795	
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ	
				325,000	331,899	56,190	2021/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	370,000	369,315	62,525	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	325,000	324,662	54,965	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	260,000	290,901	49,249	2043/01/01
	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	50,000	51,956	8,796	2020/08/05
通貨小計	銘柄数	5銘柄					
	金 額			1,330,000	1,368,734	231,726	
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	
				90,000	113,134	4,299	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	100,386	3,814	2021/04/14
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,982	1,633	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,235,000	1,266,418	48,123	2019/09/11
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,865,000	2,080,892	79,073	2020/07/24
	Colombian TES	国債証券	7.0000	2,935,000	3,074,588	116,834	2022/05/04
	Colombian TES	国債証券	10.0000	2,650,000	3,165,902	120,304	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	1,290,000	1,242,695	47,222	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,310,000	3,529,585	134,124	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	1,700,000	1,838,635	69,868	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,800,000	1,798,110	68,328	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	500,000	496,170	18,854	2025/11/26
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			17,515,000	18,749,500	712,481	

区 分		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
							千円
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア 5,750,000	千インドネシア・ルピア 5,672,605	43,679
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,174,960	32,147
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	2,800,000	2,619,680	20,171
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	4,300,000	4,031,078	31,039
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,580,648	19,870
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	1,600,000	1,819,056	14,006
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,700,000	1,981,571	15,258
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,533,988	19,511
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	7,210,000	7,342,808	56,539
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,251,615	25,037
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	10,478,782	80,686
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,715,610	36,310
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	7,330,000	6,910,797	53,213
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	6,160,000	6,039,264	46,502
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	5,910,000	5,447,956	41,949
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	7,769,100	59,822
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	4,975,000	4,326,459	33,313
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,020,000	9,996,352	76,971
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	9,150,000	9,306,648	71,661
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	5,820,000	6,171,178	47,518
通貨小計		銘柄数	20銘柄				
		金 額			107,949,000	107,170,158	825,210
ブラジル		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 3,030	千ブラジル・レアル 3,075	86,801
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,410	4,334	122,322
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,990	3,804	107,366
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,750	2,572	72,583
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500	461	13,025
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	3,650	3,240	91,439
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	9,640	8,151	230,037
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,030	3,819	107,797
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,400	1,719	48,522
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,000	866	24,462
通貨小計		銘柄数	10銘柄				
		金 額			36,400	32,046	904,358
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	千チェコ・コルナ 6,500	千チェコ・コルナ 6,857	33,945
		Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,885	43,983
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	10,600	10,925	54,080
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,621	52,576
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	6,000	6,045	29,925
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,565	57,250
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	6,100	6,308	31,224
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	4,900	4,539	22,468
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	5,000	4,260	21,089
		Czech Republic Government Bond	国債証券	—	1,900	1,882	9,316

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	
			%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	2,900	2,736	13,543	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,592	12,832	2027/02/10
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			73,900	77,219	382,238	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	1,430	1,493	41,263	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.7500	940	977	26,997	2021/06/11
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	770	793	21,918	2020/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,150	1,132	31,291	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	630	612	16,911	2021/03/22
	Romania Government Bond	国債証券	2.2500	700	729	20,161	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	700	681	18,840	2020/02/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,090	1,034	28,573	2022/12/19
	Romania Government Bond	国債証券		800	730	20,180	2024/04/29
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			8,210	8,184	226,137	
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	14,880	15,092	26,260	2021/04/14
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	31,760	32,912	57,267	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	11,910	12,057	20,980	2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	10,800	10,801	18,793	2019/12/11
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	14,400	14,239	24,777	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	36,160	34,931	60,781	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	22,100	21,898	38,102	2020/05/27
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	24,300	24,037	41,824	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	29,300	29,645	51,583	2021/08/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	24,000	25,670	44,667	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	36,100	36,533	63,568	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	29,000	29,160	50,738	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	47,000	47,141	82,025	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	35,600	35,038	60,967	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	15,000	14,910	25,943	2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券		6,000	5,740	9,988	2024/02/28
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			388,310	389,810	678,270	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	530	526	14,378	2020/04/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	800	802	21,921	2022/04/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	1,200	1,187	32,431	2027/07/26
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,570	1,589	43,406	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	1,350	1,368	37,380	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,510	1,510	41,258	2020/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	1,740	1,747	47,715	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	910	912	24,928	2019/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	1,350	1,327	36,252	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券		1,040	1,041	28,443	2020/10/15

		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. 8000	900	894	24, 416	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9000	800	779	21, 285	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 6200	1, 200	1, 200	32, 791	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 0590	920	917	25, 059	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8990	2, 120	2, 062	56, 325	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 7620	1, 100	1, 079	29, 480	2037/04/07
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄					
				19, 040	18, 948	517, 475	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 2500	4, 190	4, 183	33, 717	2020/01/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10. 5000	13, 550	14, 929	120, 330	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 2500	10, 220	7, 461	60, 142	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 7500	3, 760	3, 671	29, 593	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 5000	5, 280	3, 793	30, 577	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 0000	8, 440	7, 070	56, 989	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 7500	5, 880	5, 794	46, 705	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	11, 520	10, 564	85, 149	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 5000	8, 000	7, 313	58, 943	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 0000	7, 100	6, 536	52, 682	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	8, 100	7, 454	60, 080	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 2500	5, 300	4, 874	39, 287	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 8750	5, 100	4, 851	39, 100	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9. 0000	4, 500	4, 266	34, 387	2040/01/31
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄					
				100, 940	92, 765	747, 686	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4. 8750	千タイ・バーツ 19, 050	千タイ・バーツ 22, 701	75, 597	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 6250	19, 300	20, 631	68, 702	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 8500	16, 610	18, 186	60, 560	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 6500	26, 600	28, 156	93, 759	2021/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 6500	15, 700	16, 733	55, 721	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	2. 5500	18, 200	18, 500	61, 605	2020/06/26
	Thailand Government Bond	国債証券	1. 8750	21, 200	21, 116	70, 319	2022/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 4000	14, 100	14, 522	48, 359	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2. 1250	23, 400	22, 638	75, 384	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2. 0000	16, 000	15, 967	53, 171	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3. 7750	15, 000	16, 198	53, 941	2032/06/25
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄					
				205, 160	215, 352	717, 123	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5. 7000	千ペルー・ソル 1, 130	千ペルー・ソル 1, 173	39, 383	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6. 3500	1, 470	1, 538	51, 632	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6. 1500	950	976	32, 773	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8. 2000	1, 065	1, 254	42, 083	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	7. 8400	310	342	11, 485	2020/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6. 9000	1, 165	1, 257	42, 188	2037/08/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
				%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,120	1,214	40,763
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額				7,210	7,758	260,309
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000		2,210	2,513	73,858
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000		880	926	27,224
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000		2,210	2,208	64,890
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000		2,640	2,522	74,123
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000		1,560	1,565	45,988
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500		2,230	2,216	65,124
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000		2,090	1,975	58,048
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500		1,650	1,652	48,564
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000		2,000	2,008	59,012
	Poland Government Bond	国債証券	—		1,000	967	28,425
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500		920	993	29,183
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500		1,820	2,035	59,816
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000		2,530	2,711	79,649
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500		800	769	22,600
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500		1,850	1,880	55,242
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額				26,390	26,948	791,753
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	千ハンガリー・フォリント	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000		66,300	69,056	27,332
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000		98,500	99,671	39,449
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000		128,000	121,529	48,101
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000		23,000	23,408	9,265
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000		39,000	39,608	15,677
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000		14,000	13,879	5,493
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500		90,000	87,842	34,768
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500		40,000	37,711	14,926
	Hungary Government Bond	国債証券	0.5000		60,000	57,887	22,911
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000		99,500	113,176	44,795
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000		81,800	95,967	37,984
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000		80,000	94,452	37,384
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000		92,500	107,312	42,474
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額				912,600	961,505	380,563
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750		千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ	
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000		2,300	2,276	8,011
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額				2,800	2,405	8,466
合 計	銘柄数	200銘柄					
	金 額				5,100	4,681	16,478
							8,904,714

(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。

■投資信託財産の構成

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	8,904,714	94.7
コール・ローン等、その他	493,676	5.3
投資信託財産総額	9,398,391	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5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝110.43円、1トルコ・リラ＝23.61円、1メキシコ・ペソ＝5.68円、1フィリピン・ペソ＝2.07円、1アルゼンチン・ペソ＝3.93円、100チリ・ペソ＝16.93円、100コロンビア・ペソ＝3.80円、100インドネシア・ルピア＝0.77円、1ブラジル・レアル＝28.22円、1チェコ・コルナ＝4.95円、1ルーマニア・レイ＝27.63円、1ロシア・ルーブル＝1.74円、1マレーシア・リンギット＝27.31円、1南アフリカ・ランド＝8.06円、1タイ・バーツ＝3.33円、1ペルー・ソル＝33.55円、1ポーランド・ズロチ＝29.38円、100ハンガリー・フォリント＝39.58円、1ウルグアイ・ペソ＝3.52円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産(9,125,733千円)の投資信託財産総額(9,398,391千円)に対する比率は、97.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2018年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	9,486,484,310円
コール・ローン等	336,142,857
公社債(評価額)	8,904,714,872
未収入金	88,283,880
未収利息	132,046,280
前払費用	25,296,421
(B)負債	285,784,712
未払金	284,770,107
未払解約金	999,241
その他未払費用	15,364
(C)純資産総額(A－B)	9,200,699,598
元本	7,061,638,177
次期繰越損益金	2,139,061,421
(D)受益権総口数	7,061,638,177口
1万口当り基準価額(C/D)	13,029円

- *期首における元本額は4,207,490,765円、当期中における追加設定元本額は3,347,001,155円、同解約元本額は492,853,743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、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)184,828,745円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)339,584,075円、D－I's 新興国債券インデックス46,907,341円、i F r e e 新興国債券インデックス1,371,592,775円、i F r e e 8資産バランス783,201,691円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド4,125,461,369円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券181,938,399円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド28,123,782円です。
- *当期末の計算口数当りの純資産額は13,029円です。

■損益の状況

当期 自 2017年7月6日 至 2018年7月5日

項 目	当 期
(A)配当等収益	440,445,335円
受取利息	440,535,976
支払利息	△ 90,641
(B)有価証券売買損益	△ 970,371,973
売買益	66,848,561
売買損	△ 1,037,220,534
(C)その他費用	△ 13,552,975
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 543,479,613
(E)前期繰越損益金	1,563,217,047
(F)解約差損益金	△ 192,538,573
(G)追加信託差損益金	1,311,862,560
(H)合計(D+E+F+G)	2,139,061,421
次期繰越損益金(H)	2,139,061,421

- (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。