

# D-I's 新興国債券 インデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第8期

(決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日~2021年7月5日)

#### ★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9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	
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、分配を行なわないことがあります。		

#### 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。

当ファンドは、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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
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)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

## 最近5期の運用実績

決算期	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)		公社債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
4期末(2017年7月5日)	10,345	0	15.4	10,745	16.7	97.1	43
5期末(2018年7月5日)	9,764	0	△ 5.6	10,281	△ 4.3	96.7	61
6期末(2019年7月5日)	10,396	0	6.5	11,071	7.7	96.7	81
7期末(2020年7月6日)	9,955	0	△ 4.2	10,694	△ 3.4	95.4	73
8期末(2021年7月5日)	10,750	0	8.0	11,655	9.0	96.7	80

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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) は、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 (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として大和アセットマネジメントが計算したものです。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 (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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

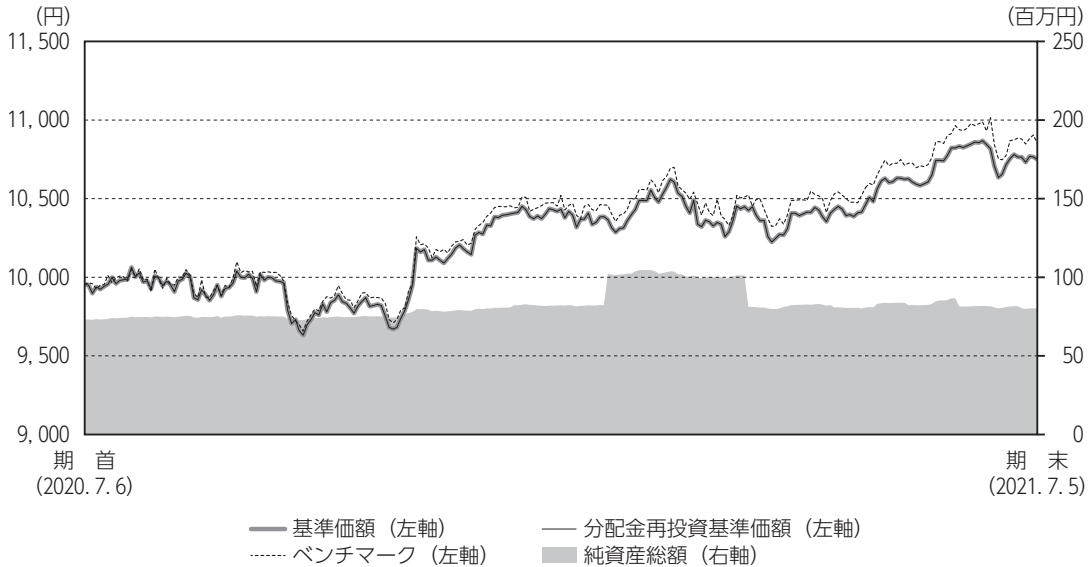
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 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。

- \* 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります(分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* 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：9,955円

期末：10,750円(分配金0円)

騰落率：8.0%(分配金込み)

#### 基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇(円安)したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## D-I's 新興国債券インデックス

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-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)2020年7月6日	9,955	—	10,694	—	95.4
7月末	9,926	△ 0.3	10,643	△ 0.5	94.9
8月末	9,935	△ 0.2	10,674	△ 0.2	95.4
9月末	9,698	△ 2.6	10,444	△ 2.3	95.8
10月末	9,670	△ 2.9	10,431	△ 2.5	96.0
11月末	10,161	2.1	10,961	2.5	96.3
12月末	10,429	4.8	11,252	5.2	95.9
2021年1月末	10,360	4.1	11,206	4.8	95.9
2月末	10,338	3.8	11,244	5.1	96.0
3月末	10,307	3.5	11,166	4.4	96.2
4月末	10,508	5.6	11,384	6.4	95.8
5月末	10,744	7.9	11,668	9.1	95.9
6月末	10,732	7.8	11,653	9.0	96.2
(期末)2021年7月5日	10,750	8.0	11,655	9.0	96.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.7.7～2021.7.5)

## ■新興国債券市況

新興国債券価格は、多くの国で下落（金利は上昇）しました。

新興国債券価格は、当作成期首より2020年10月にかけて、緩和的な金融環境を背景に横ばい圏で推移しました。11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、新興国債券価格は上昇しました。2021年2月以降は、米国債が金利上昇したことに連動して新興国の金利も上昇し、債券価格は下落しました。個別国では、感染者数および死者数が新興国最多で財政悪化が懸念され、また2022年の大統領選挙の見通しに不透明感が高まったブラジルや、エルドアン大統領による中央銀行人事への介入で中央銀行の独立性が懸念されたトルコなどの債券価格が大きく下落しました。

## ■為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、緩和的な金融環境を背景に堅調に推移しました。2020年11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、一段と上昇しました。2021年2月以降は、ウイルスの変異種の感染拡大や米国金利上昇に伴う新興国からの資金流出への懸念で、上昇幅を縮小させる局面もありました。米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことで、多くの新興国通貨は対円で上昇しました。個別国では、いち早く景気回復局面に入り、また株式や債券の国際的なインデックス入りに伴う資金流入が期待された中国・人民元、米国の大型財政出動や景気回復の恩恵を強く受けると期待されたメキシコ・ペソ、財政再建の進展が期待された南アメリカ・ランドなどが大きく上昇しました。

## 前作成期末における「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、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、新興国通貨建ての債券に投資し、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

(2020.7.7～2021.7.5)

### ■当ファンド

当作成期を通じて「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

新興国通貨建ての債券に投資し、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。

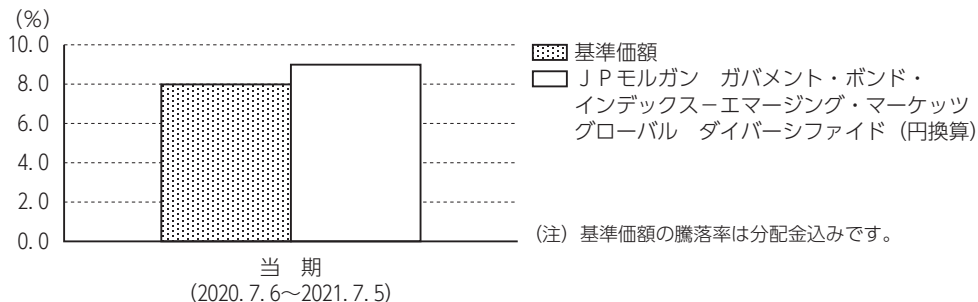
\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	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)

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は9.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.0%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、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。



\* 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) です。

## 分配金について

当作成期は、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	
	2020年7月7日 ～2021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）	1,293

- （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、新興国通貨建ての債券に投資し、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 (2020.7.7~2021.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	68円	0.658%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,263円です。
(投 信 会 社)	(32)	(0.313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(32)	(0.313)	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 会 社)	(3)	(0.033)	受託会社分は、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＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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	10	0.100	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(9)	(0.087)	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	78	0.758	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

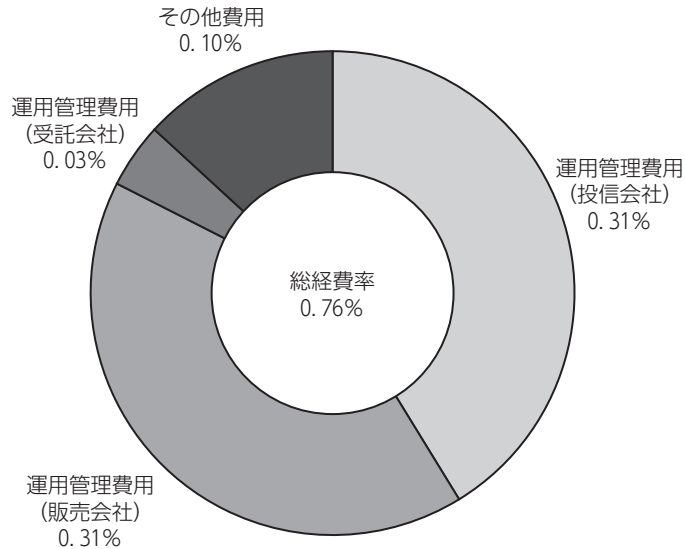
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 参考情報

## ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.76%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## D-I's 新興国債券インデックス

### ■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

(2020年7月7日から2021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	29,583	41,488	29,196	41,574

(注) 単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況等

当作成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	評 価 額	□ 数	評 価 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	54,311	54,698	54,698	80,050

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2021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	80,050	99.3
コール・ローン等、その他	552	0.7
投資信託財産総額	80,602	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=111.16円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.16円、100チリ・ペソ=15.112円、100コロンビア・ペソ=2.965円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=21.971円、1チェコ・コルナ=5.151円、1ルーマニア・レイ=26.689円、1オフショア・人民元=17.174円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=28.486円、1ポーランド・ズロチ=29.216円、100ハンガリー・フォリント=37.468円、1ウルグアイ・ペソ=2.544円、1ドミニカ・ペソ=1.951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(20,973,875千円)の投資信託財産総額(21,656,127千円)に対する比率は、96.8%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	80,602,881円
コール・ローン等	552,080
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	80,050,801
(B) 負債	289,495
未払信託報酬	286,000
その他未払費用	3,495
(C) 純資産総額(A-B)	80,313,386
元本	74,708,513
次期繰越損益金	5,604,873
(D) 受益権総口数	74,708,513口
1万口当り基準価額(C/D)	10,750円

\* 期首における元本額は73,500,690円、当作成期間中における追加設定元本額は46,741,148円、同解約元本額は45,533,325円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,750円です。

### ■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1円
支払利息	△ 1
(B) 有価証券売買損益	5,175,700
売買益	6,904,239
売買損	△ 1,728,539
(C) 信託報酬等	△ 546,922
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,628,777
(E) 前期繰越損益金	△ 886,054
(F) 追加信託差損益金	1,862,150
(配当等相当額)	( 5,918,202)
(売買損益相当額)	(△ 4,056,052)
(G) 合計(D+E+F)	5,604,873
次期繰越損益金(G)	5,604,873
追加信託差損益金	1,862,150
(配当等相当額)	( 5,918,202)
(売買損益相当額)	(△ 4,056,052)
分配準備積立金	3,742,724
繰越損益金	△ 1

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	3,310,900
(c) 収益調整金	5,918,202
(d) 分配準備積立金	431,824
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	9,660,926
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	9,660,926
(h) 受益権総口数	74,708,513口

# 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11期（決算日 2021年7月5日）

（作成対象期間 2020年7月7日～2021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 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
株式組入制限	純資産総額の10%以下

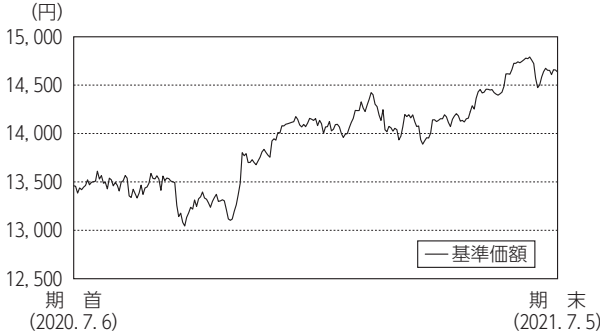
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：13,460円 期末：14,635円 騰落率：8.7%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券価格は、多くの国で下落（金利は上昇）しました。

新興国債券価格は、当作成期首より2020年10月にかけて、緩和的な金融環境を背景に横ばい圏で推移しました。11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、新興国債券価格は上昇しました。2021年2月以降は、米国債が金利上昇したことに連動して新興国の金利も上昇し、債券価格は下落しました。個別国では、感染者数および死者数が新興国最多で財政悪化が懸念され、また2022年の大統領選挙の見通しに不透明感が高まったブラジルや、エルドアン大統領による中央銀行人事への介入で中央銀行の独立性が懸念されたトルコなどの債券価格が大きく下落しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、緩和的な金融環境を背景に堅調に推移しました。2020年11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、一段と上昇しました。2021年2月以降は、ウイルスの変異種の感染拡大や米国金利上昇に伴う新興国からの資金流出への懸念で、上昇幅を縮小させる局面もありました。米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことで、多くの新興国通貨は対円で上昇しました。個別国では、いち早く景気回復局面に入り、また株式や債券の国際的なインデックス入りに伴う資金流入が期待された中国・人民元、米国の大型財政出動や景気回復の恩恵を強く受けたと期待されたメキシコ・ペソ、財政再建の進展が期待された南アフリカ・ランドなどが大きく上昇しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、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

新興国通貨建ての債券に投資し、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

当作成期のベンチマークの騰落率は9.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.7%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、売買に伴う費用などが主な要因です。

\*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－エマーゼンク・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）です。

《今後の運用方針》

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、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。

年 月 日	基準 価 額		騰落率		JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマーゼンク・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）	騰落率		公社債組入率
	円	%	円	%		円	%	
(期首) 2020年7月6日	13,460	—	14,417	—	14,417	—	—	95.5
7月末	13,428	△ 0.2	14,349	△ 0.5	14,349	△ 0.5	—	95.0
8月末	13,448	△ 0.1	14,390	△ 0.2	14,390	△ 0.2	—	95.5
9月末	13,133	△ 2.4	14,080	△ 2.3	14,080	△ 2.3	—	95.9
10月末	13,103	△ 2.7	14,062	△ 2.5	14,062	△ 2.5	—	96.1
11月末	13,777	2.4	14,777	2.5	14,777	2.5	—	96.4
12月末	14,148	5.1	15,170	5.2	15,170	5.2	—	96.0
2021年1月末	14,062	4.5	15,108	4.8	15,108	4.8	—	96.0
2月末	14,039	4.3	15,158	5.1	15,158	5.1	—	96.4
3月末	14,005	4.0	15,054	4.4	15,054	4.4	—	96.6
4月末	14,287	6.1	15,347	6.4	15,347	6.4	—	96.2
5月末	14,617	8.6	15,731	9.1	15,731	9.1	—	96.3
6月末	14,609	8.5	15,710	9.0	15,710	9.0	—	96.6
(期末) 2021年7月5日	14,635	8.7	15,713	9.0	15,713	9.0	—	97.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマーゼンク・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）は、JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマーゼンク・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として大和アセットマネジメントが計算したものです。JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマーゼンク・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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債組入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。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## ■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)	13 ( 12)
(その他)	( 1)
合 計	13

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 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

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買 付 額	売 付 額
外	トルコ	千トルコ・リラ 7,490	千トルコ・リラ ( 3,507 —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 73,031	千メキシコ・ペソ ( 20,003 —)
	チリ	千チリ・ペソ 687,215	千チリ・ペソ ( 57,691 —)
国	コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,549,900	千コロンビア・ペソ ( 2,892,000 —)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 62,416,644	千インドネシア・ルピア ( 3,465,000 —)
	ブラジル	千ブラジル・リアル 29,279	千ブラジル・リアル ( 15,421 —)

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

買 付		当 期	売 付	
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額
		千円		
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	309,188	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1	134,458	
China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	176,741	Thailand Government Bond (タイ) 3.65% 2021/12/17	108,962	
China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	143,302	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	98,282	
Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9	123,869	China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	85,852	
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.5% 2031/2/15	122,145	Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7% 2021/12/15	70,878	
China Government Bond (中国) 3.27% 2030/11/19	121,040	Mexican Bonos (メキシコ) 7.25% 2021/12/9	53,367	
Poland Government Bond (ポーランド) 0.75% 2025/4/25	115,880	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2021/10/25	50,962	
China Government Bond (中国) 3.02% 2025/10/22	110,931	China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	48,410	
Poland Government Bond (ポーランド) 1.25% 2030/10/25	109,534	Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25	48,104	
China Government Bond (中国) 2.85% 2027/6/4	107,997	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	45,491	

(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。

		買 付 額	売 付 額
外	チェコ	千チェコ・コルナ 29,444	千チェコ・コルナ ( 15,794 —)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 4,869	千ルーマニア・レイ ( 1,012 —)
	中国	千オフショア・人民元 89,993	千オフショア・人民元 ( 9,471 —)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 298,895	千ロシア・ルーブル ( 104,221 —)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,127	千マレーシア・リンギット ( 2,197 —)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 30,142	千南アフリカ・ランド ( 5,607 —)
国	タイ	千タイ・バーツ 166,995	千タイ・バーツ ( 38,130 —)
	ペルー	千ペルー・ソル 764	千ペルー・ソル ( 926 —)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 20,869	千ポーランド・ズロチ ( 3,613 —)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 789,018	千ハンガリー・フォリント ( 90,602 —)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 6,996	千ウルグアイ・ペソ ( 5,464 —)

(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。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期 区分	額面金額	当期		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		評価額				5年以上	2年以上	2年未満
		外貨建金額	邦貨換算金額					
トルコ	千トルコ・リラ 33,510	千トルコ・リラ 27,790	千円 356,260	1.7%	1.7%	0.5%	0.5%	0.6%
メキシコ	千メキシコ・ペソ 324,900	千メキシコ・ペソ 341,228	1,915,315	9.0	—	4.5	3.1	1.4
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 11,966	27,025	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 2,790,000	千チリ・ペソ 2,834,115	428,297	2.0	—	1.0	0.8	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 31,630,000	千コロンビア・ペソ 31,986,957	948,573	4.5	—	3.1	0.9	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 244,089,000	千インドネシア・ルピア 260,230,570	2,003,775	9.4	—	6.6	2.0	0.8
ブラジル	千ブラジル・レアル 85,150	千ブラジル・レアル 79,736	1,751,898	8.2	—	1.8	3.6	2.8
チェコ	千チェコ・コルナ 163,800	千チェコ・コルナ 165,613	853,073	4.0	—	2.5	1.3	0.2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 20,170	千ルーマニア・レイ 21,520	574,354	2.7	—	1.0	1.0	0.7
中国	千オフショア・人民元 121,450	千オフショア・人民元 121,621	2,088,833	9.8	—	5.3	4.1	0.5
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,019,330	千ロシア・ルーブル 1,025,580	1,548,626	7.3	—	4.6	1.9	0.7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 57,030	千マレーシア・リンギット 59,115	1,581,530	7.4	—	4.5	2.1	0.8
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 233,090	千南アフリカ・ランド 211,551	1,647,990	7.7	—	7.3	—	0.4
タイ	千タイ・バーツ 487,060	千タイ・バーツ 524,481	1,814,706	8.5	—	5.2	2.2	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 15,050	千ペルー・ソル 16,037	456,833	2.1	—	2.0	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 58,370	千ポーランド・ズロチ 61,151	1,786,658	8.4	—	3.9	2.8	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,152,800	千ハンガリー・フォリント 2,237,781	838,465	3.9	—	2.0	1.5	0.5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 10,088	25,669	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,443	24,280	0.1	0.1	—	0.1	—
合計	—	—	20,672,166	97.1	1.8	56.1	28.1	12.8

(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。

(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力しています。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分		銘 柄	種 類	当 期		末		償還年月日
				年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円		
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	714	9,157	2022/09/14
		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,367	30,350	2023/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	579	7,428	2024/03/20
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,313	16,840	2024/07/24
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,012	25,800	2025/03/12
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,014	25,820	2026/02/11
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,299	29,483	2022/03/02
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,291	29,373	2027/02/24
		Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,766	22,639	2022/08/17
		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,862	23,876	2027/08/11
		Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,301	16,686	2023/01/18
		Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,638	21,001	2028/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,366	17,518	2023/06/14
		Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	3,500	2,989	38,328	2025/10/01
		Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	4,300	3,272	41,954	2030/11/13
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			33,510	27,790	356,260		
				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ			
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	34,400	33,456	187,788	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,500	21,529	120,847	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	26,000	27,356	153,551	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	23,000	23,427	131,497	2023/03/09
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	28,553	160,271	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	29,628	166,306	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	31,418	176,354	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,257	51,963	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	27,730	30,354	170,380	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	20,400	22,403	125,753	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,450	23,581	132,365	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,450	28,719	161,202	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,120	20,587	115,560	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	10,951	61,472	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額			324,900	341,228	1,915,315		
				千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ			
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	11,966	27,025	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			10,000	11,966	27,025		
				千チリ・ペソ	千チリ・ペソ			
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	516,710	78,086	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	571,305	86,336	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	451,594	68,245	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	407,330	61,556	2030/09/01



ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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	
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	千チリ・ペソ 250,000	千チリ・ペソ 257,000	千円 38,838	2023/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	630,175	95,233	2025/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄			2,790,000	2,834,115	428,297	
					千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ		
<b>コロンビア</b>		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	106,914	3,170	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	46,078	1,366	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,635,000	3,754,773	111,347	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,050,000	3,480,904	103,226	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	4,290,000	4,131,827	122,529	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	3,710,000	3,927,702	116,476	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,821,311	83,665	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	2,946,090	87,366	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,746,386	81,444	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	3,400,000	3,371,270	99,975	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	5.7500	2,400,000	2,306,040	68,385	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	7.2500	1,410,000	1,294,323	38,383	2050/10/26
		Colombian TES	国債証券	6.2500	1,200,000	1,053,336	31,236	2036/07/09
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			31,630,000	31,986,957	948,573	
					千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア		
<b>インドネシア</b>		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	9,070,050	69,839	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,906,360	53,178	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,791,940	44,597	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,486,734	57,647	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,917,500	84,064	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	7,973,424	61,395	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,383,720	103,054	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,802,073	113,975	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,000,000	16,792,160	129,299	2025/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,618,246	74,060	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,241,900	78,862	2040/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	9,200,000	9,239,284	71,142	2026/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,727,636	121,102	2031/02/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	2,300,000	2,267,064	17,456	2036/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,337,496	33,398	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,756,174	21,222	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,561,000	27,419	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	14,441,234	111,197	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,278,627	40,645	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,953,518	84,342	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,397,661	87,761	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	11,163,766	85,961	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,454,236	88,197	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	7,055,968	54,330	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,825,961	106,459	2034/03/15

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
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円		
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,375,185	110,688	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	8,120,000	9,411,648	72,469	2029/03/15
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄			244,089,000	260,230,570	2,003,775	
					千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
ブラジル		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,210	10,590	232,688	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	11,250	247,193	2025/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,150	9,660	212,242	2027/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	5,608	123,221	2029/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,521	55,404	2031/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,721	125,705	2022/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	10,957	240,739	2023/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	23,200	19,157	420,911	2024/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,400	4,268	93,792	2024/07/01
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			85,150	79,736	1,751,898	
					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	15,600	16,388	84,415	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	9,670	49,813	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,700	9,143	47,099	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,614	85,580	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	17,356	89,405	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	14,903	76,768	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,723	50,085	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	14,331	73,820	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	12,883	66,365	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	17,306	89,143	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	13,000	12,302	63,372	2031/03/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	5,198	26,775	2029/11/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	7,500	9,789	50,427	2036/12/04
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			163,800	165,613	853,073	
					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,521	40,607	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,237	33,017	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,452	65,462	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,111	29,661	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,636	43,687	2024/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,716	45,815	2022/03/08
		Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,557	41,573	2023/06/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,918	77,892	2029/02/12
		Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,750	46,715	2026/04/22
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,423	37,995	2031/09/24
		Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	952	25,424	2024/06/17
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,564	41,754	2025/07/28
		Romania Government Bond	国債証券	4.1500	800	856	22,857	2028/01/26

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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	
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	千ルーマニア・レイ 800	千ルーマニア・レイ 820	千円 21,887	2026/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			20,170	21,520	574,354	
中国		China Government Bond	国債証券	3.2900	千オフショア・人民元 3,900	千オフショア・人民元 3,958	67,983	2023/10/18
		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,700	5,776	99,215	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,853	83,356	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.1900	6,700	6,782	116,487	2024/04/11
		China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,309	142,714	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,900	118,508	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,051	121,109	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	6,996	120,155	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,519	77,615	2024/10/17
		China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,512	146,206	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	9,400	9,051	155,459	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	1.9900	8,000	7,738	132,913	2025/04/09
		China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,110	104,945	2023/07/02
		China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,919	84,486	2023/11/05
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,028	120,716	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,071	87,099	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,394	127,006	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,707	29,334	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	5,931	101,869	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	2.8400	1,000	1,002	17,215	2024/04/08	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	1,000	995	17,094	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,000	1,009	17,340	2051/04/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			121,450	121,621	2,088,833	
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	千ロシア・ルーブル 46,760	千ロシア・ルーブル 49,399	74,592	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	33,371	50,391	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,453	21,824	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	46,513	70,234	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	33,977	51,305	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	34,234	51,693	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	51,600	53,618	80,963	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	51,000	51,669	78,020	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	48,232	72,830	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	49,001	73,992	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	38,000	37,718	56,955	2024/02/28
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	45,000	45,598	68,853	2034/05/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	50,885	76,836	2029/05/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	51,000	53,381	80,606	2026/10/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	55,784	84,235	2024/07/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	59,551	89,922	2025/11/12
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	67,699	102,226	2030/04/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	40,211	60,718	2039/03/16

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			償還年月日
		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	6.0000	58,000	55,369	83,608	2027/10/06	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	39,000	35,787	54,038	2025/07/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	53,000	48,373	73,044	2035/07/18	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	60,749	91,730	2028/05/17	
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			1,019,330	1,025,580	1,548,626		
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			
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	3,400	3,457	92,510	2022/04/14	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,930	51,657	2027/07/26	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,098	56,142	2023/11/30	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,836	49,128	2028/10/31	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,703	45,566	2029/07/09	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,774	47,471	2024/10/15	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	2,200	2,310	61,816	2026/03/31	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	2,500	2,532	67,755	2030/10/15	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,200	2,261	60,493	2027/09/30	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	900	849	22,714	2036/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	1,750	1,809	48,412	2027/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,463	65,899	2028/06/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,835	49,094	2024/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	2,950	3,114	83,320	2025/09/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,800	1,886	50,471	2035/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,451	38,843	2023/08/17	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	2,000	2,132	57,044	2026/11/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,208	32,340	2021/11/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	3,020	3,183	85,170	2024/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,662	71,222	2027/11/16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,816	75,344	2037/04/07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,445	38,664	2023/04/20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,117	56,648	2026/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,150	2,266	60,648	2029/08/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	1,100	1,139	30,476	2024/06/14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,350	62,869	2034/07/05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,800	1,698	45,451	2040/05/22	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,900	1,832	49,025	2050/06/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,000	946	25,322	2031/04/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	29銘柄			57,030	59,115	1,581,530		
南アフリカ					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド			
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	34,550	39,114	304,698	2026/12/21	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	7,951	61,938	2036/03/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	12,580	8,450	65,830	2041/02/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	12,440	10,643	82,914	2031/02/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	11,380	11,811	92,010	2023/02/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	31,520	26,664	207,712	2048/02/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	20,900	17,941	139,765	2037/01/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	26,900	25,449	198,254	2030/01/31	

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
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	17,600	14,911	116,159	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	19,600	17,845	139,014	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	20,600	18,654	145,320	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	13,800	12,114	94,371	2040/01/31
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			233,090	211,551	1,647,990	
タイ					千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	30,050	37,447	129,566	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	24,707	85,486	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	26,610	30,235	104,615	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,734	92,500	2031/06/20
		Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,432	60,316	2022/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	23,600	26,977	93,340	2036/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	29,400	31,300	108,298	2026/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,530	84,876	2022/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	32,500	38,725	133,988	2032/06/25
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	26,233	90,766	2046/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	24,500	25,611	88,614	2023/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	29,363	101,598	2028/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	31,500	35,587	123,131	2038/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	30,000	30,844	106,721	2024/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	27,500	27,615	95,548	2029/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	14,550	50,344	2035/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	28,000	28,310	97,954	2025/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	20,900	21,005	72,679	2024/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	12,400	11,536	39,915	2035/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	9,000	9,215	31,887	2031/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	7,000	6,518	22,554	2042/06/17
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄			487,060	524,481	1,814,706	
ペルー					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
		Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	811	23,105	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,191	62,418	2028/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	1,919	54,670	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,066	58,854	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,925	54,841	2034/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	877	24,999	2040/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,937	55,203	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,172	61,899	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,135	60,839	2031/08/12
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			15,050	16,037	456,833	
ポーランド					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	5.7500	3,610	3,858	112,726	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,990	6,350	185,551	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,140	4,398	128,511	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,261	95,279	2022/04/25

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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	
					千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,658	136,096	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,784	169,008	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,450	7,025	205,258	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,100	3,248	94,921	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,978	116,250	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,900	3,757	109,780	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,400	2,274	66,439	2026/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	3,530	3,818	111,572	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,500	4,873	142,395	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,863	112,866	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			58,370	61,151	1,786,658	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	102,454	38,388	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	177,242	66,410	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	141,610	53,059	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	134,329	50,331	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	113,546	42,544	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	145,000	150,913	56,545	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	164,003	61,449	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	202,000	213,354	79,940	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	40,205	15,064	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	130,000	124,800	46,760	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	75,000	73,125	27,398	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	95,000	92,569	34,684	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	80,000	77,824	29,159	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	100,000	94,008	35,223	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	97,222	36,427	2026/08/26
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	146,192	54,776	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	132,406	49,610	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	161,975	60,689	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			2,152,800	2,237,781	838,465	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,923	7,438	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	7,165	18,230	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	10,088	25,669	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	12,443	24,280	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			11,000	12,443	24,280	
合 計	銘柄数	262銘柄					
	金 額					20,672,166	

(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

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	20,672,166	95.5
コール・ローン等、その他	983,961	4.5
投資信託財産総額	21,656,127	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=111.16円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.16円、100チリ・ペソ=15.112円、100コロンビア・ペソ=2.965円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=21.971円、1チエコ・コルナ=5.151円、1ルーマニア・レイ=26.689円、1オフショア・人民元=17.174円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=28.486円、1ポーランド・ズロチ=29.216円、100ハンガリー・フォリント=37.468円、1ウルグアイ・ペソ=2.544円、1ドミニカ・ペソ=1.951円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(20,973,875千円)の投資信託財産総額(21,656,127千円)に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>22,222,755,636円</b>
コール・ローン等	674,373,087
公社債(評価額)	20,672,166,113
未収入金	604,557,331
未収利息	255,476,931
前払費用	16,182,174
<b>(B) 負債</b>	<b>923,205,227</b>
未払金	919,638,550
未払解約金	3,560,737
その他未払費用	5,940
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>21,299,550,409</b>
元本	14,553,919,275
次期繰越損益金	6,745,631,134
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>14,553,919,275口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	14,635円

\* 期首における元本額は11,831,677,635円、当作成期間中における追加設定元本額は3,356,035,460円、同解約元本額は633,793,820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、新興国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)139,125,730円、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)264,519,469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)431,390,249円、D-1's 新興国債券インデックス54,698,190円、i F r e e 新興国債券インデックス3,803,181,162円、i F r e e 8資産バランス2,737,955,446円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド6,926,685,621円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券162,851,958円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド33,511,450円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,635円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>967,591,713円</b>
受取利息	967,675,396
支払利息	△ 83,683
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>617,999,402</b>
売買益	1,665,193,821
売買損	△ 1,047,194,419
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 16,880,636</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>1,568,710,479</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>4,093,541,775</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>253,784,839</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 1,337,163,719</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>6,745,631,134</b>
次期繰越損益金(H)	6,745,631,134

(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。