★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	無期限	
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	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。	
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し、原則として、配当等収益の中から分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行な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。

ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド

運用報告書（全体版）
第６期
（決算日　2016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、「ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド」は、このたび、第６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/

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			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・マーケッツ 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
2期末(2012年７月５日)	10,295	0	△ 5.3	10,695	△ 3.2	97.2	231
3期末(2013年７月５日)	12,802	0	24.4	13,520	26.4	96.6	468
4期末(2014年７月７日)	13,404	0	4.7	14,299	5.8	96.9	1,521
5期末(2015年７月６日)	13,371	0	△ 0.2	14,494	1.4	96.6	2,288
6期末(2016年７月５日)	11,392	0	△ 14.8	12,413	△ 14.4	96.8	2,748

（注１）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・マーケッツ 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－エマージング・マーケッツ 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。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・マーケッツ 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.

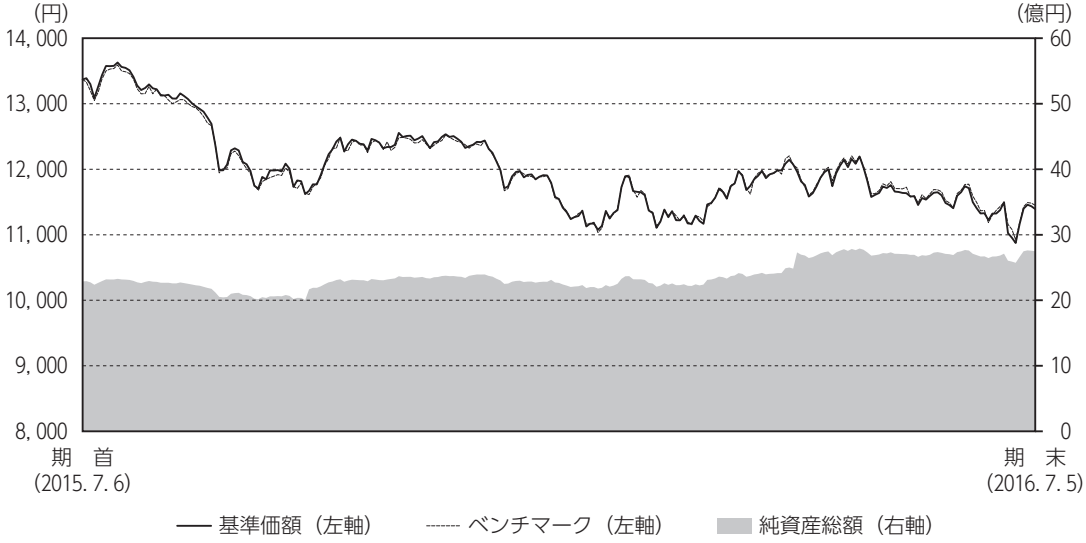
（注２）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

（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、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・マーケッツ　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：13,371円
期　末：11,392円
騰落率：△14.8%

■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に寄与しましたが、新興国通貨の対円為替レートの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。

ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド

年　月　日	基準価額		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・マーケッツ　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）2015年７月６日	13,371	―	14,494	―	96.6
７月末	13,236	△ 1.0	14,257	△ 1.6	96.4
８月末	12,319	△ 7.9	13,309	△ 8.2	97.2
９月末	11,671	△ 12.7	12,589	△ 13.1	92.0
10月末	12,340	△ 7.7	13,322	△ 8.1	95.3
11月末	12,326	△ 7.8	13,414	△ 7.4	96.5
12月末	11,906	△ 11.0	12,909	△ 10.9	97.3
2016年１月末	11,730	△ 12.3	12,711	△ 12.3	96.6
２月末	11,211	△ 16.2	12,218	△ 15.7	97.5
３月末	12,084	△ 9.6	13,177	△ 9.1	95.6
４月末	12,027	△ 10.1	13,040	△ 10.0	95.5
５月末	11,649	△ 12.9	12,667	△ 12.6	95.8
６月末	11,398	△ 14.8	12,388	△ 14.5	96.3
（期末）2016年７月５日	11,392	△ 14.8	12,413	△ 14.4	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

米国の金融政策の正常化への思惑から新興国の多くで金利が上昇する局面もありましたが、原油をはじめとする商品価格の反発などを背景に投資家心理が改善を見せたことや、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの市場の観測から、金利が低下する国が多くなりました。個別の国では、インフレ懸念の後退や景気の悪化により将来の利下げ期待が高まったブラジルで金利が低下しました。

○為替相場

中国経済の減速懸念などで市場のリスク回避姿勢が高まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。その後、原油価格の反発などから投資家心理は改善しましたが、英国の国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱派が勝利したことを受け円高が進行したことなどから、対円で下落する通貨が多くなりました。個別の通貨では、政治的不透明感の高まりや中央銀行の金融政策への不信感が嫌気されてトルコ・リラが下落したほか、米国の利上げの影響が懸念されたメキシコ・ペソが下落しました。

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・マーケッツ　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

○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。

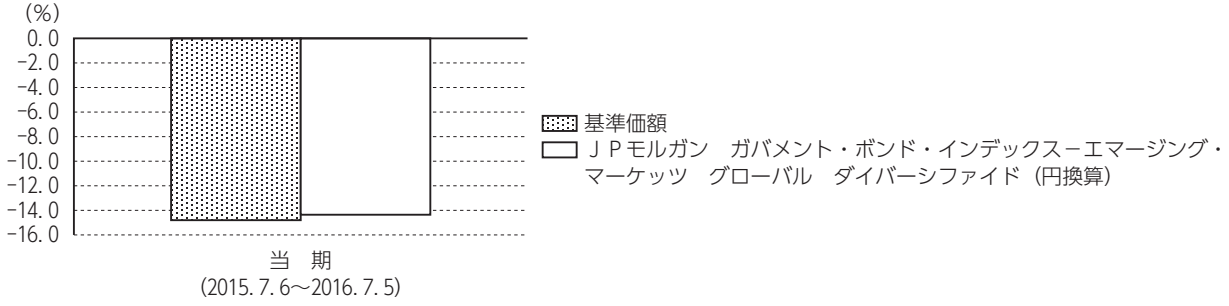
○ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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△14.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△14.8%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、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 2015年７月７日 ～2016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)	—
翌期繰越分配可能額		(円)	1,744

（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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち、経費控除後の配当等収益です。

《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 (2015. 7. 7～2016. 7. 5)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信託報酬	67円	0. 560%	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12, 011円です。**
（投信会社）	(23)	(0. 194)	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）	(39)	(0. 323)	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）	(5)	(0. 043)	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 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	34	0. 286	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）	(32)	(0. 268)	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）	(1)	(0. 010)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	102	0. 846	

（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

（2015年７月７日から2016年７月５日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	783,840	962,434	121,699	151,161

（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	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	1,656,402	2,318,543	2,735,417

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016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	2,735,417	99.2
コール・ローン等、その他	22,750	0.8
投資信託財産総額	2,758,167	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＝102.39円、１トルコ・リラ＝35.25円、１メキシコ・ペソ＝5.55円、１フィリピン・ペソ＝2.18円、100コロンビア・ペソ＝3.49円、100インドネシア・ルピア＝0.79円、１ブラジル・レアル＝31.31円、１ルーマニア・レイ＝25.24円、１ロシア・ルーブル＝1.60円、１マレーシア・リンギット＝25.57円、１南アフリカ・ランド＝7.02円、１タイ・バーツ＝2.92円、１ペルー・ヌエボソル＝31.12円、１ポーランド・ズロチ＝25.70円、100ハンガリー・フォリント＝35.99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（3,422,024千円）の投資信託財産総額（3,543,718千円）に対する比率は、96.6% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年７月５日現在

項目	当期末
(A)資産	**2,758,167,658円**
コール・ローン等	22,750,233
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	2,735,417,425
(B)負債	**9,399,964**
未払解約金	2,338,277
未払信託報酬	6,961,366
その他未払費用	100,321
(C)純資産総額（A－B）	**2,748,767,694**
元本	2,412,822,636
次期繰越損益金	335,945,058
(D)受益権総口数	**2,412,822,636口**
１万口当り基準価額（C／D）	**11,392円**

＊期首における元本額は1,711,403,032円、当期中における追加設定元本額は1,024,760,651円、同解約元本額は323,341,047円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,392円です。

■損益の状況

当期　自2015年７月７日　至2016年７月５日

項目	当期	
(A)配当等収益		**469円**
受取利息		2,016
支払利息	△	1,547
(B)有価証券売買損益	△	**322,074,998**
売買益		33,163,684
売買損	△	355,238,682
(C)信託報酬等	△	**13,512,326**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	△	**335,586,855**
(E)前期繰越損益金		**25,825,868**
(F)追加信託差損益金		**645,706,045**
（配当等相当額）	(	376,190,676)
（売買損益相当額）	(	269,515,369)
(G)合計（D＋E＋F）		**335,945,058**
次期繰越損益金（G）		**335,945,058**
追加信託差損益金		645,706,045
（配当等相当額）	(	376,190,676)
（売買損益相当額）	(	269,515,369)
分配準備積立金		44,678,462
繰越損益金	△	354,439,449

（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	376,190,676
(d) 分配準備積立金	44,678,462
(e) 当期分配可能額（a＋b＋c＋d）	420,869,138
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額（e－f）	420,869,138
(h) 受益権総口数	2,412,822,636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６期　（決算日　2016年７月５日）

（計算期間　2015年７月７日～2016年７月５日）

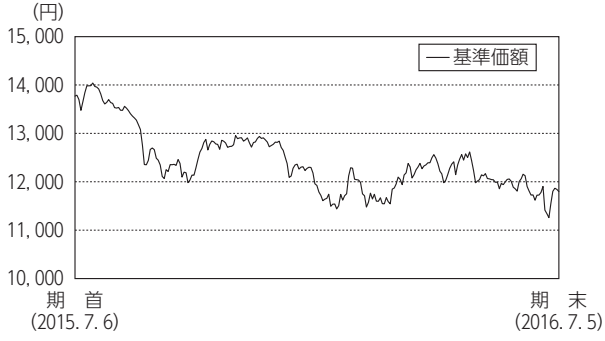
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの第６期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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/

■当期中の基準価額と市況の推移



年月日	基準価額		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・マーケッツ 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
		騰落率		騰落率	
	円	%		%	%
(期首) 2015年7月6日	13,771	—	14,494	—	96.9
7月末	13,637	△ 1.0	14,257	△ 1.6	96.4
8月末	12,698	△ 7.8	13,309	△ 8.2	97.2
9月末	12,036	△ 12.6	12,589	△ 13.1	92.0
10月末	12,732	△ 7.5	13,322	△ 8.1	95.3
11月末	12,723	△ 7.6	13,414	△ 7.4	96.5
12月末	12,296	△ 10.7	12,909	△ 10.9	97.3
2016年1月末	12,119	△ 12.0	12,711	△ 12.3	96.7
2月末	11,589	△ 15.8	12,218	△ 15.7	97.5
3月末	12,497	△ 9.3	13,177	△ 9.1	95.7
4月末	12,443	△ 9.6	13,040	△ 10.0	95.6
5月末	12,059	△ 12.4	12,667	△ 12.6	96.2
6月末	11,803	△ 14.3	12,388	△ 14.5	96.8
(期末) 2016年7月5日	11,798	△ 14.3	12,413	△ 14.4	97.3

(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－エマージング・マーケッツ　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－エマージング・マーケッツ　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。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・マーケッツ　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：13,771円　期末：11,798円　騰落率：△14.3%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入はプラスに寄与しましたが、新興国通貨の対円為替レートの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

○新興国債券市況

米国の金融政策の正常化への思惑から新興国の多くで金利が上昇する局面もありましたが、原油をはじめとする商品価格の反発などを背景に投資家心理が改善を見せたことや、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの市場の観測から、金利が低下する国が多くなりました。個別の国では、インフレ懸念の後退や景気の悪化により将来の利下げ期待が高まったブラジルで金利が低下しました。

○為替相場

中国経済の減速懸念などで市場のリスク回避姿勢が高まったことから、新興国通貨は対円で下落しました。その後、原油価格の反発などから投資家心理は改善しましたが、英国の国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱派が勝利したことを受け円高が進行したことなどから、対円で下落する通貨が多くなりました。個別の通貨では、政治的不透明感の高まりや中央銀行の金融政策への不信感が嫌気されてトルコ・リラが下落したほか、米国の利上げの影響が懸念されたメキシコ・ペソが下落しました。

◆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（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・マーケッツ　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

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△14.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△14.3%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。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	34
(保管費用)	(33)
(その他)	(1)
合計	34

(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

(2015年7月7日から2016年7月5日まで)

			買付額	売付額
外国	トルコ	国債証券	千トルコ・リラ 3,961	千トルコ・リラ 1,301 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 28,162	千メキシコ・ペソ 6,932 (—)
	コロンビア	国債証券	千コロンビア・ペソ 2,464,607	千コロンビア・ペソ 56,804 (—)
	インドネシア	国債証券	千インドネシア・ルピア 16,024,712	千インドネシア・ルピア 5,169,064 (—)
	ブラジル	国債証券	千ブラジル・レアル 8,023	千ブラジル・レアル 6,535 (—)
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニア・レイ 2,084	千ルーマニア・レイ 1,121 (—)
	ロシア	国債証券	千ロシア・ルーブル 59,465	千ロシア・ルーブル 26,841 (—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 5,251	千マレーシア・リンギット 2,055 (—)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 20,363	千南アフリカ・ランド 5,301 (—)
	タイ	国債証券	千タイ・バーツ 42,429	千タイ・バーツ 18,918 (—)
	ペルー	国債証券	千ペルー・ヌエボソル 621	千ペルー・ヌエボソル 74 (—)
	ナイジェリア	国債証券	千ナイジェリア・ナイラ —	千ナイジェリア・ナイラ 87,763 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 7,294	千ポーランド・ズロチ 3,810 (—)
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリー・フォリント 214,149	千ハンガリー・フォリント 50,101 (—)

(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

（2015年７月７日から2016年７月５日まで）

当期 買付 銘柄	金額	当期 売付 銘柄	金額
	千円		千円
Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8.375% 2026/9/15	32,279	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F（ブラジル）10% 2017/1/1	42,942
Poland Government Bond（ポーランド）2.5% 2026/7/25	31,464	Brazil Letras do Tesouro Nacional（ブラジル） 2017/7/1	38,870
Thailand Government Bond（タイ）2.55% 2020/6/26	30,143	Thailand Government Bond（タイ）3.25% 2017/6/16	34,745
Turkey Government Bond（トルコ）8% 2025/3/12	29,544	Brazil Letras do Tesouro Nacional（ブラジル） 2017/1/1	24,646
Turkey Government Bond（トルコ）9.4% 2020/7/8	29,075	Poland Government Bond（ポーランド）4.75% 2016/10/25	23,068
Poland Government Bond（ポーランド）2% 2021/4/25	26,305	Mexican Bonos（メキシコ）7.25% 2016/12/15	22,817
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA（南アフリカ）10.5% 2026/12/21	26,265	Turkey Government Bond（トルコ）9% 2017/3/8	20,406
Mexican Bonos（メキシコ）8.5% 2018/12/13	24,741	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F（ブラジル）10% 2025/1/1	19,640
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F（ブラジル）10% 2021/1/1	24,199	Poland Government Bond（ポーランド）5.5% 2019/10/25	19,623
Thailand Government Bond（タイ）4.875% 2029/6/22	22,893	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F（ブラジル）10% 2021/1/1	19,611

（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 区分	当期末 額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率 5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 9,460	千トルコ・リラ 9,510	335,252	9.7	—	4.3	4.3	1.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 54,670	千メキシコ・ペソ 60,970	338,384	9.8	—	5.5	3.2	1.2
フィリピン	千フィリピン・ペソ 5,000	千フィリピン・ペソ 5,244	11,432	0.3	—	—	0.3	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,465,000	千コロンビア・ペソ 6,786,524	236,849	6.9	—	4.4	2.4	—
インドネシア	千インドネシア・ルピア 40,719,000	千インドネシア・ルピア 42,979,199	339,535	9.8	—	8.7	1.0	0.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 12,770	千ブラジル・レアル 10,589	331,559	9.6	9.6	2.3	4.0	3.3
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 3,190	千ルーマニア・レイ 3,529	89,075	2.6	—	0.7	1.6	0.3
ロシア	千ロシア・ルーブル 120,540	千ロシア・ルーブル 115,912	185,460	5.4	—	2.8	1.8	0.8
マレーシア	千マレーシア・リンギット 12,570	千マレーシア・リンギット 12,816	327,728	9.5	—	4.7	3.2	1.7
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 48,640	千南アフリカ・ランド 45,068	316,381	9.2	—	7.2	1.6	0.4
タイ	千タイ・バーツ 82,800	千タイ・バーツ 92,679	270,623	7.8	—	4.8	2.4	0.7
ペルー	千ペルー・ヌエボソル 1,960	千ペルー・ヌエボソル 2,123	66,094	1.9	—	1.6	0.3	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 12,290	千ポーランド・ズロチ 12,859	330,489	9.6	—	4.2	4.3	1.1
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 435,000	千ハンガリー・フォリント 491,818	177,005	5.1	5.1	2.1	2.1	0.9
合計	—	—	3,355,871	97.3	14.7	53.2	32.4	11.7

（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）

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	480	507	17,901	2020/01/15
		Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	510	527	18,597	2022/01/12
		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	490	483	17,039	2022/09/14
		Turkey Government Bond	国債証券	6.3000	600	582	20,536	2018/02/14
		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	780	714	25,199	2023/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	8.3000	530	528	18,626	2018/06/20
		Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	540	537	18,939	2023/09/27
		Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	630	634	22,362	2018/11/14
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	370	387	13,642	2019/03/27
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	330	358	12,650	2024/03/20
		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	710	710	25,052	2019/07/10
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	630	633	22,340	2024/07/24
		Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	570	549	19,359	2020/02/05
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	640	605	21,353	2025/03/12
		Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	740	758	26,737	2020/07/08
		Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	570	612	21,589	2021/02/17
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	340	377	13,324	2026/02/11
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				9,460	9,510	335,252	
				%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.0000	3,900	3,847	21,355	2019/12/11
		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	1,400	1,375	7,634	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,950	2,209	12,260	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	5,550	7,069	39,234	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	2,030	2,269	12,593	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,280	3,435	19,068	2017/12/14
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	1,490	2,104	11,679	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,430	2,931	16,272	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,750	6,164	34,213	2018/12/13
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,300	2,878	15,976	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	3,190	3,478	19,305	2020/06/11
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	5,950	6,213	34,483	2021/06/10
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,450	3,947	21,907	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	2,250	2,354	13,069	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	3,620	4,241	23,540	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	4.7500	3,950	3,944	21,891	2018/06/14
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,180	2,504	13,897	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				54,670	60,970	338,384	
				%	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ	千円	
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	4.9500	5,000	5,244	11,432	2021/01/15
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額				5,000	5,244	11,432	
				%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	108,158	3,774	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	97,907	3,416	2021/04/14
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	38,628	1,348	2023/03/21

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	
		Colombian TES	国債証券	5.0000	520,000	504,166	17,595	2018/11/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	615,000	622,564	21,727	2019/09/11
		Colombian TES	国債証券	11.0000	1,025,000	1,180,041	41,183	2020/07/24
		Colombian TES	国債証券	7.0000	735,000	737,410	25,735	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	1,300,000	1,517,867	52,973	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	630,000	557,424	19,454	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	800,000	801,912	27,986	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	610,000	620,443	21,653	2030/09/18
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額				6,465,000	6,786,524	236,849	
				%	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	8.2500	1,500,000	1,604,340	12,674	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	1,600,000	1,774,752	14,020	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	700,000	797,027	6,296	2020/11/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	600,000	734,130	5,799	2021/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,000,000	1,231,880	9,731	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	980,000	1,225,882	9,684	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	3,060,000	3,202,412	25,299	2021/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,120,000	1,299,144	10,263	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,424,000	4,754,384	37,559	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	1,970,000	2,066,116	16,322	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	990,000	954,894	7,543	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	1,460,000	1,434,201	11,330	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	1,410,000	1,277,883	10,095	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	1,200,000	1,063,992	8,405	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,975,000	1,770,903	13,990	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.2500	870,000	843,969	6,667	2018/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,030,000	4,337,247	34,264	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,510,000	5,815,419	45,941	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	3,720,000	4,134,928	32,665	2029/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.8750	2,600,000	2,655,692	20,979	2019/04/15
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金額				40,719,000	42,979,199	339,535	
				%	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	1,430	1,337	41,885	2021/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	350	338	10,603	2018/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,380	1,260	39,456	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	280	268	8,406	2019/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	920	828	25,954	2025/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,220	1,021	31,992	2018/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,270	1,007	31,535	2018/07/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	560	496	15,543	2027/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,870	1,404	43,986	2019/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,020	725	22,713	2019/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	680	584	18,309	2017/10/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	790	643	20,163	2018/04/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,000	671	21,010	2020/01/01
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				12,770	10,589	331,559	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	5.8500	430	507	12,814	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	360	391	9,871	2019/06/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.6000	420	463	11,697	2018/11/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.9500	440	509	12,871	2021/06/11
		Romania Government Bond	国債証券	5.7500	360	408	10,311	2020/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	380	421	10,633	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	380	394	9,962	2018/01/17
		Romania Government Bond	国債証券	2.5000	220	225	5,686	2019/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	200	207	5,225	2021/03/22
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				3,190	3,529	89,075	
				%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	6,800	6,653	10,646	2018/03/15
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	7,880	7,640	12,225	2021/04/14
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,130	6,912	11,060	2019/02/27
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	13,060	13,141	21,026	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	6,610	6,391	10,226	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	6,500	6,162	9,859	2019/12/11
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	8,400	7,909	12,655	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	11,660	10,789	17,262	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.2000	6,600	6,313	10,102	2018/01/31
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	8,100	7,563	12,101	2020/05/27
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.7000	10,000	9,506	15,209	2019/05/15
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	11,800	11,062	17,700	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	5,000	4,817	7,708	2021/08/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	6,000	6,153	9,844	2031/09/17
		Russian Foreign Bond - Eurobond	国債証券	7.8500	5,000	4,894	7,831	2018/03/10
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				120,540	115,912	185,460	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2400	660	676	17,304	2018/02/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.7340	350	375	9,598	2019/07/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	780	809	20,693	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0120	540	548	14,025	2017/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	620	646	16,542	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	560	579	14,819	2021/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	490	514	13,167	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	330	336	8,598	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	510	518	13,245	2018/09/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	440	434	11,109	2022/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	280	276	7,067	2032/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.3140	560	564	14,446	2017/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	540	543	13,906	2020/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2600	460	464	11,879	2018/03/01
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	470	464	11,877	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	220	209	5,361	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8890	470	481	12,309	2020/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	510	526	13,460	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	650	672	17,185	2021/09/30

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	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	3.6540	560	567	14,505	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	660	668	17,095	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	590	599	15,320	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	590	595	15,220	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	380	387	9,901	2019/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	350	355	9,085	2023/08/17
通貨小計	銘柄数	25銘柄						
	金額				12,570	12,816	327,728	
				%	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	1,930	1,946	13,663	2017/09/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	2,350	2,357	16,550	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	2,940	2,872	20,162	2020/01/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	6,300	7,078	49,687	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	3,920	2,871	20,158	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	2,760	2,606	18,294	2021/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	3,750	2,707	19,006	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	4,240	3,525	24,749	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,280	2,203	15,467	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	4,970	4,625	32,472	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	3,000	2,771	19,453	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	3,400	3,121	21,912	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	2,600	2,426	17,036	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	2,500	2,305	16,181	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	1,700	1,650	11,584	2035/02/28
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				48,640	45,068	316,381	
				%	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	4,250	4,504	13,153	2018/03/13
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8750	15,000	16,002	46,727	2019/06/13
		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	11,050	14,425	42,122	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	9,600	10,751	31,393	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8000	3,300	3,352	9,788	2017/10/10
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	8,950	10,462	30,551	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	15,400	16,971	49,556	2021/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.4500	2,900	3,042	8,885	2019/03/08
		Thailand Government Bond	国債証券	3.5800	3,250	3,731	10,895	2027/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	9,100	9,434	27,547	2020/06/26
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				82,800	92,679	270,623	
				%	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	380	384	11,958	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	305	364	11,329	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	341	10,618	2020/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	255	278	8,664	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	480	529	16,474	2031/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.2000	230	226	7,048	2023/09/12
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額				1,960	2,123	66,094	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	910	1,086	27,925	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	780	815	20,961	2017/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.5000	620	692	17,793	2019/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,030	1,013	26,054	2020/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,180	1,141	29,333	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.0000	920	917	23,574	2021/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	650	625	16,064	2018/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.7500	680	666	17,138	2021/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.2500	620	701	18,038	2020/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	570	670	17,221	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	930	1,018	26,165	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.7500	650	674	17,339	2018/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	940	956	24,580	2018/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	810	844	21,700	2019/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,000	1,034	26,597	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				12,290	12,859	330,489	
				%	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント	千円	
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.5000	39,300	41,638	14,985	2020/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	35,000	35,817	12,890	2018/06/22
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	24,000	24,206	8,712	2024/06/26
		Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	16,000	16,137	5,808	2019/10/30
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	10,000	10,121	3,642	2021/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	40,500	49,663	17,873	2020/11/12
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	21,400	23,130	8,324	2017/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	48,800	59,475	21,405	2023/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	6.5000	58,800	66,870	24,066	2019/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	40,000	50,224	18,075	2022/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	24,000	26,286	9,460	2018/12/20
		Hungary Government Bond	国債証券	4.0000	28,700	30,131	10,844	2018/04/25
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	48,500	58,115	20,915	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				435,000	491,818	177,005	
合計	銘柄数	187銘柄						
	金額						3,355,871	

（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

2016年７月５日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
公社債	3,355,871	94.7
コール・ローン等、その他	187,847	5.3
投資信託財産総額	3,543,718	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＝102.39円、１トルコ・リラ＝35.25円、１メキシコ・ペソ＝5.55円、１フィリピン・ペソ＝2.18円、100コロンビア・ペソ＝3.49円、100インドネシア・ルピア＝0.79円、１ブラジル・レアル＝31.31円、１ルーマニア・レイ＝25.24円、１ロシア・ルーブル＝1.60円、１マレーシア・リンギット＝25.57円、１南アフリカ・ランド＝7.02円、１タイ・バーツ＝2.92円、１ペルー・ヌエボソル＝31.12円、１ポーランド・ズロチ＝25.70円、100ハンガリー・フォリント＝35.99円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（3,422,024千円）の投資信託財産総額（3,543,718千円）に対する比率は、96.6％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2016年７月５日現在

項　　目	当　期　末
（A）資産	**3,575,291,022円**
コール・ローン等	116,863,482
公社債（評価額）	3,355,871,415
未収入金	45,359,513
未収利息	49,691,718
前払費用	7,504,894
（B）負債	**126,036,097**
未払金	126,025,286
その他未払費用	10,811
（C）純資産総額（A－B）	**3,449,254,925**
元本	2,923,660,797
次期繰越損益金	525,594,128
（D）受益権総口数	**2,923,660,797口**
１万口当り基準価額（C／D）	**11,798円**

＊期首における元本額は2,264,504,559円、当期中における追加設定元本額は836,305,797円、同解約元本額は177,149,559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）438,574,434円、Ｄ－Ｉ’ｓ新興国債券インデックス26,082,894円、ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド2,318,543,334円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券136,749,136円、ダイワ・ノーロード　新興国債券ファンド3,710,999円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,798円です。

■損益の状況

当期　自2015年７月７日　至2016年７月５日

項　　目	当　　期	
（A）配当等収益		**192,062,811円**
受取利息		192,065,985
支払利息	△	3,174
（B）有価証券売買損益	△	**664,118,859**
売買益		114,152,004
売買損	△	778,270,863
（C）その他費用	△	**8,840,810**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	△	**480,896,858**
（E）前期繰越損益金		**854,039,268**
（F）解約差損益金	△	**38,506,495**
（G）追加信託差損益金		**190,958,213**
（H）合計（D＋E＋F＋G）		**525,594,128**
次期繰越損益金（H）		**525,594,128**

（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。