

★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) 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	<p>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 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	
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。	

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せん。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。

D-I's 新興国債券 インデックス

運用報告書 (全体版) 第2期

(決算日 2015年7月6日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「D-I's 新興国債券インデックス」は、このたび、第2期の決算を行ないました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先 (コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00～17:00)

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			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
	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末 (2014年 7月 7日)	円 10,560	円 0	% 5.6	10,607	% 6.1	% 96.8	百万円 8
2 期末 (2015年 7月 6日)	円 10,526	円 0	% △ 0.3	10,751	% 1.4	% 96.8	百万円 24

(注1) 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。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 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

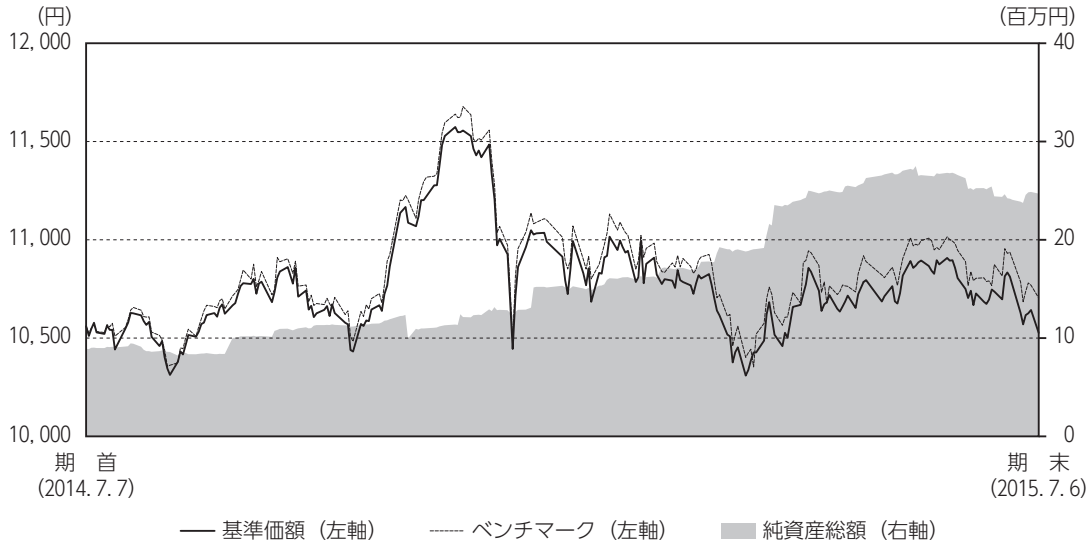
(注2) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注3) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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

《運用経過》

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期首：10,560円

期末：10,526円

騰落率：△0.3%

■基準価額の主な変動要因

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

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)2014年7月7日	10,560	—	10,607	—	96.8
7月末	10,582	0.2	10,655	0.5	95.3
8月末	10,624	0.6	10,696	0.8	95.5
9月末	10,645	0.8	10,732	1.2	95.8
10月末	10,864	2.9	10,973	3.5	96.7
11月末	11,556	9.4	11,729	10.6	96.6
12月末	10,990	4.1	11,149	5.1	96.7
2015年1月末	10,944	3.6	11,072	4.4	96.4
2月末	10,803	2.3	10,961	3.3	97.6
3月末	10,527	△ 0.3	10,653	0.4	96.1
4月末	10,785	2.1	10,967	3.4	96.3
5月末	10,875	3.0	10,999	3.7	94.9
6月末	10,570	0.1	10,732	1.2	95.7
(期末)2015年7月6日	10,526	△ 0.3	10,751	1.4	96.8

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○新興国債券市況

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

○為替相場

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

前期における「今後の運用方針」

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

ポートフォリオについて

○当ファンド

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

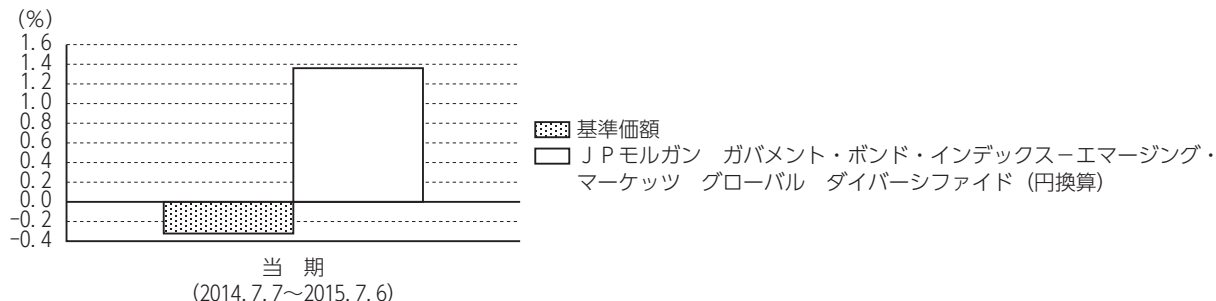
○ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期
	2014年7月8日 ～2015年7月6日
当期分配金（税込み）(円)	—
対基準価額比率 (%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
翌期繰越分配対象額 (円)	526

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

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

○ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2014.7.8~2015.7.6)		
	金 額	比 率	
信託報酬	70円	0.646%	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10,769円です。
(投信会社)	(33)	(0.307)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(33)	(0.307)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.032)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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	26	0.246	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)	(26)	(0.238)	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)	(0.007)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	96	0.892	

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

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2014年7月8日から2015年7月6日まで)

	設 定		解 約	
	□ 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	17,804	25,105	6,360	9,019

(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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

期首保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 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	6,482	17,927	17,927	24,687

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年7月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	24,687	99.7
コール・ローン等、その他	83	0.3
投資信託財産総額	24,771	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年7月6日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	24,771,312円
コール・ローン等	83,907
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	24,687,405
(B) 負債	70,320
未払信託報酬	69,553
その他未払費用	767
(C) 純資産総額(A-B)	24,700,992
元本	23,466,033
次期繰越損益金	1,234,959
(D) 受益権総口数	23,466,033口
1万口当り基準価額(C/D)	10,526円

*期首における元本額は8,446,241円、当期中における追加設定元本額は25,430,980円、同解約元本額は10,411,188円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,526円です。

■損益の状況

当期 自2014年7月8日 至2015年7月6日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	16円
受取利息	16
(B) 有価証券売買損益	△ 459,167
売買益	199,535
売買損	△ 658,702
(C) 信託報酬等	△ 106,074
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 565,225
(E) 前期繰越損益金	143,045
(F) 追加信託差損益金	1,657,139
(配当等相当額)	(740,999)
(売買損益相当額)	(916,140)
(G) 合計 (D + E + F)	1,234,959
次期繰越損益金 (G)	1,234,959
追加信託差損益金	1,657,139
(配当等相当額)	(740,999)
(売買損益相当額)	(916,140)
分配準備積立金	143,045
繰越損益金	△ 565,225

(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「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	1,091,914
(d) 分配準備積立金	143,045
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,234,959
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,234,959
(h) 受益権総口数	23,466,033口

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

《お知らせ》

●運用報告書 (全体版) の電子交付について

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

●書面決議手続きの改正について

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

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第5期 (決算日 2015年7月6日)

(計算期間 2014年7月8日～2015年7月6日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル・ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
運用方法	①主として、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットツ グローバル ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。 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

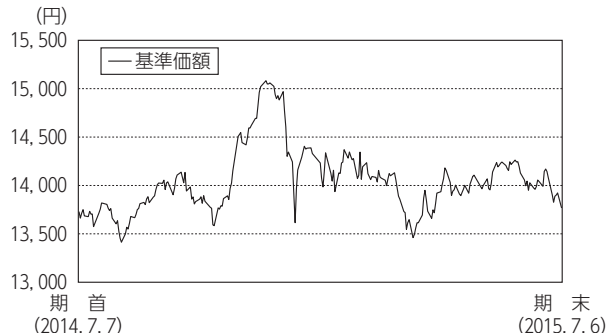
大和投資信託

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		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 率 比
	円	%	円	%	
(期首) 2014年 7月 7日	13,726	—	14,299	—	97.0
7月 末	13,761	0.3	14,364	0.5	95.3
8月 末	13,822	0.7	14,420	0.8	95.5
9月 末	13,858	1.0	14,468	1.2	95.8
10月 末	14,151	3.1	14,794	3.5	96.7
11月 末	15,060	9.7	15,813	10.6	96.7
12月 末	14,330	4.4	15,031	5.1	96.8
2015年 1月 末	14,277	4.0	14,927	4.4	96.4
2月 末	14,100	2.7	14,777	3.3	97.6
3月 末	13,748	0.2	14,362	0.4	96.1
4月 末	14,093	2.7	14,786	3.4	96.2
5月 末	14,217	3.6	14,829	3.7	94.8
6月 末	13,827	0.7	14,468	1.2	95.7
(期末) 2015年 7月 6日	13,771	0.3	14,494	1.4	96.9

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：13,726円 期末：13,771円 騰落率：0.3%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入が、基準価額の値上がりに寄与しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

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

○為替相場

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

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年7月8日から2015年7月6日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2015年7月6日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

(注3) 当期末における外貨建純資産(3,091,200千円)の投資信託財産総額(3,260,043千円)に対する比率は、94.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2015年7月6日現在

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

*期首における元本額は1,647,688,099円、当期中における追加設定元本額は769,642,371円、同解約元本額は152,825,911円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)489,506,556円、D-1's 新興国債券インデックス17,927,097円、DCダイワ新興国債券インデックスファンド1,656,402,068円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券100,668,838円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,771円です。

■損益の状況

当期 自2014年7月8日 至2015年7月6日

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

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

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

《お知らせ》

●書面決議手続きの改正について

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

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