

★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4期

(決算日 2017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、「D-I's 新興国債券インデックス」は、このたび、第4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			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)		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			
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末(2014年 7 月 7 日)	10,560	0	5.6	10,607	6.1	96.8	8
2 期末(2015年 7 月 6 日)	10,526	0	△ 0.3	10,751	1.4	96.8	24
3 期末(2016年 7 月 5 日)	8,965	0	△ 14.8	9,207	△ 14.4	96.4	31
4 期末(2017年 7 月 5 日)	10,345	0	15.4	10,745	16.7	97.1	43

(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-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。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 (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されていますが、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。

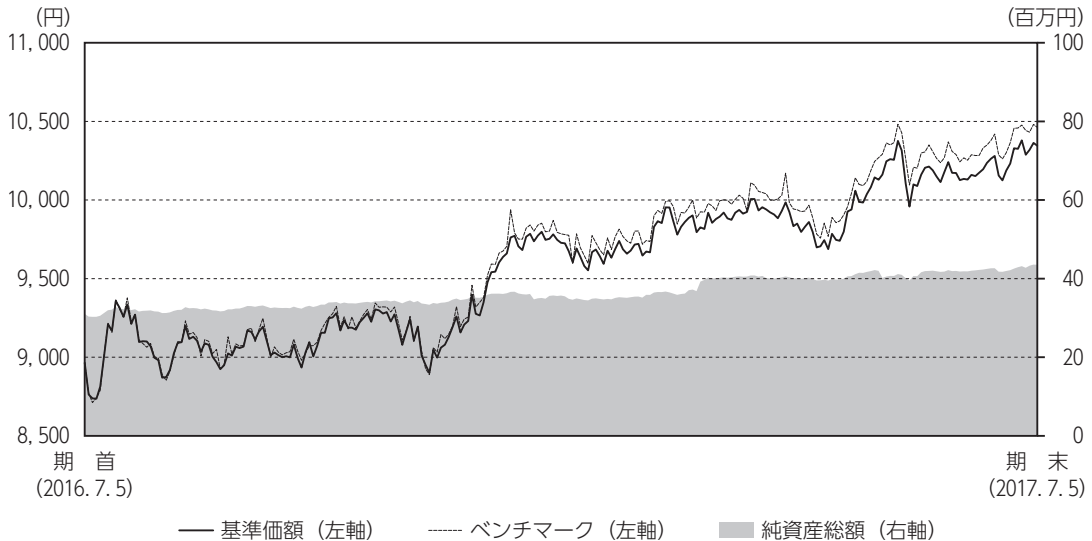
(注3) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：8,965円

期末：10,345円

騰落率：15.4%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

投資している債券の利息収入および新興国通貨の対円為替レートの上昇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)2016年7月5日	8,965	—	9,207	—	96.4
7月末	9,069	1.2	9,333	1.4	96.6
8月末	9,067	1.1	9,330	1.3	96.6
9月末	9,005	0.4	9,319	1.2	97.0
10月末	9,227	2.9	9,539	3.6	96.3
11月末	9,231	3.0	9,506	3.2	96.6
12月末	9,753	8.8	10,067	9.3	93.9
2017年1月末	9,687	8.1	10,032	9.0	95.5
2月末	9,826	9.6	10,194	10.7	95.9
3月末	9,985	11.4	10,446	13.5	96.4
4月末	9,984	11.4	10,364	12.6	97.0
5月末	10,114	12.8	10,514	14.2	95.6
6月末	10,288	14.8	10,725	16.5	95.0
(期末)2017年7月5日	10,345	15.4	10,745	16.7	97.1

(注) 騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2016.7.6 ~ 2017.7.5)

## ■新興国債券市況

新興国債券市況は、個別国要因でまちまちの展開となりました。

米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことや、米国の利上げ観測が強まったことなどが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。その後は、フランス大統領選挙の先行き不透明感が高まったことや、トランプ政権の政策実行能力への懐疑的な見方が広がったことなどが、金利低下の材料となりました。国別では、連続利下げが行なわれたブラジルで金利が低下しました。

## ■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。

原油価格の上昇や米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり円安が進んだことで、新興国通貨は対円で上昇しました。その後、米国の政権運営への懸念は円高要因となった一方で、米国金利の上昇抑制は高金利通貨への需要につながり、各通貨の個別要因が対円のパフォーマンスにつながる展開となりました。通貨別では、原油価格の底堅さなどからロシア・ルーブルが上昇しました。

## 前期における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組み入れ、ベンチマーク（JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算））に連動する投資成果をめざします。

## ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

今後もファンドの通貨の比率をベンチマーク（JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ 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

(2016.7.6～2017.7.5)

### ■当ファンド

期を通じて「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組み入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

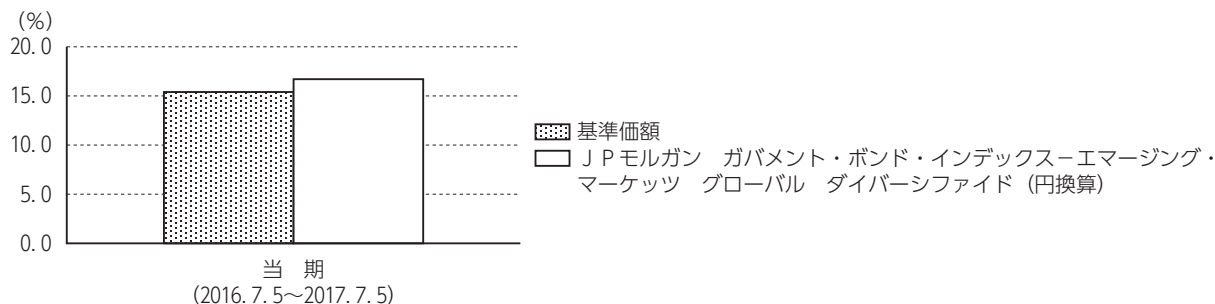
### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は16.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は15.4%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、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（1万口当り）

項 目	当 期	
	2016年7月6日 ～2017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)	691

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

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

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



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2016.7.6~2017.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0.648%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,581円です。
(投 信 会 社)	(29)	(0.308)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(29)	(0.308)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0.032)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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	21	0.219	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)	(19)	(0.203)	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)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	83	0.867	

(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

(2016年7月6日から2017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	11,681	14,978	6,055	7,868

(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	
	□ 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	26,082	31,709	31,709	43,489

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2017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	43,489	99.6
コール・ローン等、その他	165	0.4
投資信託財産総額	43,654	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=113.08円、1トルコ・リラ=31.79円、1メキシコ・ペソ=6.22円、1フィリピン・ペソ=2.24円、1アルゼンチン・ペソ=6.69円、100チリ・ペソ=17.04円、100コロンビア・ペソ=3.71円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・レアル=34.16円、1チェコ・コナナ=4.91円、1ルーマニア・レイ=28.02円、1ロシア・ルーブル=1.91円、1マレーシア・リンギット=26.31円、1南アフリカ・ランド=8.56円、1タイ・バーツ=3.32円、1ペルー・ソル=34.71円、1ポーランド・ズロチ=30.31円、100ハンガリー・フォリント=41.67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(5,615,457千円)の投資信託財産総額(6,035,591千円)に対する比率は、93.0%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	43,654,811円
コール・ローン等	165,513
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	43,489,298
(B)負債	128,089
未払信託報酬	126,605
その他未払費用	1,484
(C)純資産総額(A-B)	43,526,722
元本	42,076,514
次期繰越損益金	1,450,208
(D)受益権総口数	42,076,514口
1万口当り基準価額(C/D)	10,345円

\*期首における元本額は34,625,917円、当期中における追加設定元本額は17,019,765円、同解約元本額は9,569,168円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,345円です。

## ■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017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	4,894,766
売買益	5,582,371
売買損	△ 687,605
(C)信託報酬等	△ 238,589
(D)当期損益金(A+B+C)	4,656,176
(E)前期繰越損益金	△ 3,237,254
(F)追加信託差損益金	31,286
(配当等相当額)	( 1,492,648)
(売買損益相当額)	(△ 1,461,362)
(G)合計(D+E+F)	1,450,208
次期繰越損益金(G)	1,450,208
追加信託差損益金	31,286
(配当等相当額)	( 1,492,648)
(売買損益相当額)	(△ 1,461,362)
分配準備積立金	1,418,923
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9ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

## ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,326,425
(c) 収益調整金	1,492,648
(d) 分配準備積立金	92,498
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,911,571
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,911,571
(h) 受益権総口数	42,076,514口

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

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第7期（決算日 2017年7月5日）

（計算期間 2016年7月6日～2017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7期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果を J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット 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 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

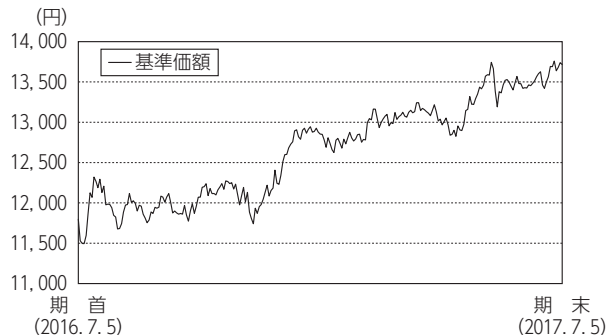
## 大和投資信託

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



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：11,798円 期末：13,715円 騰落率：△16.2%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の利息収入および新興国通貨の対円為替レートの上昇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

新興国債券市況は、個別国要因でまちまちの展開となりました。

米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことを受けて、米ドル高観測により新興国市場の資金流出懸念が高まったことや、米国の利上げ観測が強まったことなどが、新興国債券の金利上昇の材料となりました。その後は、フランス大統領選挙の先行き不透明感が高まったことや、トランプ政権の政策実行能力への懐疑的な見方が広がったことなどが、金利低下の材料となりました。国別では連続利下げが行なわれたブラジルで金利が低下しました。

○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。

原油価格の上昇や米国の大統領選挙で勝利したトランプ氏の政策への期待感などから市場のリスク選好度が強まり円安が進んだことで、新興国通貨は対円で上昇しました。その後、米国の政権運営への懸念は円高要因となった一方で、米国金利の上昇抑制は高金利通貨への需要につながり、各通貨の個別要因が対円のパフォーマンスにつながる展開となりました。通貨別では、原油価格の底堅さなどからロシア・ルーブルが上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後もファンドの通貨の比率をベンチマーク（J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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

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

◆ベンチマークとの差異について

当期のベンチマークの騰落率は16.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は16.2%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。

【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。

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・エマーゼィング・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 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期首) 2016年 7月 5日	円	%	円	%	%
	11,798	—	12,413	—	97.3
7 月 末	11,941	1.2	12,582	1.4	97.5
8 月 末	11,945	1.2	12,579	1.3	97.5
9 月 末	11,870	0.6	12,563	1.2	97.8
10 月 末	12,172	3.2	12,859	3.6	97.2
11 月 末	12,184	3.3	12,815	3.2	97.4
12 月 末	12,886	9.2	13,572	9.3	94.7
2017年 1 月 末	12,805	8.5	13,524	9.0	96.3
2 月 末	12,997	10.2	13,743	10.7	96.7
3 月 末	13,217	12.0	14,083	13.5	97.2
4 月 末	13,220	12.1	13,972	12.6	97.1
5 月 末	13,400	13.6	14,174	14.2	95.7
6 月 末	13,638	15.6	14,459	16.5	95.1
(期末) 2017年 7月 5日	13,715	16.2	14,485	16.7	97.1

(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・エマーゼィング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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。J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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。

■ 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)	27 ( 26)
(その他)	( 1)
合 計	27

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

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

		買 付 額	売 付 額	
外	トルコ	千トルコ・リラ 6,831	千トルコ・リラ 2,003 ( —)	
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 43,675	千メキシコ・ペソ 11,945 ( —)	
	フィリピン	千フィリピン・ペソ 5,245	千フィリピン・ペソ ( —)	
	アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 9,527	千アルゼンチン・ペソ ( —)	
	チリ	千チリ・ペソ 623,913	千チリ・ペソ ( —)	
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 4,009,016	千コロンビア・ペソ 261,593 ( —)	
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 24,250,003	千インドネシア・ルピア 3,067,617 ( —)	
	ブラジル	千ブラジル・レアル 9,868	千ブラジル・レアル 4,923 ( —)	
	チェコ	千チェコ・コルナ 39,115	千チェコ・コルナ ( —)	
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 2,278	千ルーマニア・レイ 388 ( —)	
	ロシア	千ロシア・ルーブル 84,128	千ロシア・ルーブル 18,107 ( —)	
	国	マレーシア	千マレーシア・リンギット 6,835	千マレーシア・リンギット 5,236 ( —)
		南アフリカ	千南アフリカ・ランド 19,771	千南アフリカ・ランド 8,368 ( —)
		タイ	千タイ・バーツ 55,648	千タイ・バーツ 17,468 ( —)
ペルー		千ペルー・ソル 1,792	千ペルー・ソル 233 ( —)	
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 7,356	千ポーランド・ズロチ 2,696 ( —)	
ハンガリー		千ハンガリー・フォロント 186,756	千ハンガリー・フォロント 88,797 ( —)	

(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

(2016年7月6日から2017年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
Chile Government International Bond (チリ) 5.5% 2020/8/5	105,100	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/7/1	39,175
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2020/7/1	82,681	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/1/1	39,157
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/4/1	49,547	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2018/7/25	28,762
Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	46,463	Mexican Bonos (メキシコ) 4.75% 2018/6/14	28,185
Thailand Government Bond (タイ) 1.875% 2022/6/17	44,316	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/4/1	25,768
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.5% 2037/1/31	43,432	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	25,047
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2019/1/1	41,026	Poland Government Bond (ポーランド) 3.75% 2018/4/25	21,956
Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	40,966	Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2017/10/25	21,500
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2018/10/1	37,699	Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2017/12/14	18,652
Czech Republic Government Bond (チェコ) 5.7% 2024/5/25	37,461	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2017/10/1	18,493

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期				末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
				千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 14,460	千トルコ・リラ 13,888		441,499	7.7	—	3.5	3.5	0.6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 85,590	千メキシコ・ペソ 89,842		558,820	9.7	—	5.5	3.4	0.8
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 10,350		23,184	0.4	—	—	0.4	—
アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ 8,500	千アルゼンチン・ペソ 9,302		62,231	1.1	1.1	0.7	0.4	—
チリ	千チリ・ペソ 590,000	千チリ・ペソ 627,866		106,988	1.9	—	—	1.9	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 10,015,000	千コロンビア・ペソ 10,886,796		403,900	7.0	—	3.9	2.7	0.3
インドネシア	千インドネシア・ルピア 60,849,000	千インドネシア・ルピア 65,247,366		554,602	9.6	—	7.2	1.8	0.6
ブラジル	千ブラジル・レアル 19,050	千ブラジル・レアル 16,963		579,459	10.0	—	3.0	3.4	3.7
チェコ	千チェコ・コルナ 33,900	千チェコ・コルナ 38,627		189,658	3.3	—	2.1	1.2	—
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 4,940	千ルーマニア・レイ 5,325		149,223	2.6	—	1.0	1.1	0.6
ロシア	千ロシア・ルーブル 187,240	千ロシア・ルーブル 186,413		356,049	6.2	—	3.9	1.5	0.7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 14,180	千マレーシア・リンギット 14,134		371,877	6.4	—	3.3	2.7	0.4
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 60,910	千南アフリカ・ランド 55,645		476,327	8.3	—	7.3	0.7	0.2
タイ	千タイ・バーツ 119,960	千タイ・バーツ 128,345		426,105	7.4	—	3.4	2.7	1.3

区 分	当 期				未 期			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ペルー	千ペルー・ソル 3,430	千ペルー・ソル 3,775	千円 131,046	% 2.3	% —	% 2.1	% 0.2	% —
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 17,190	千ポーランド・ズロチ 17,382	526,876	9.1	—	3.6	4.5	1.1
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 521,400	千ハンガリー・フォリント 594,117	247,568	4.3	—	1.7	2.0	0.7
合計	—	—	5,605,421	97.1	1.1	52.2	34.1	10.9

(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手しています。

(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	
					千円		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	千トルコ・リラ 680	千トルコ・リラ 680	千円 21,621	2020/01/15
	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	510	493	15,681	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	733	23,305	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	780	672	21,392	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	790	734	23,356	2023/09/27
	Turkey Government Bond	国債証券	8.8000	630	613	19,516	2018/11/14
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	470	467	14,847	2019/03/27
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	683	21,725	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	1,160	1,114	35,438	2019/07/10
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	630	590	18,775	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	7.4000	570	529	16,842	2020/02/05
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	1,490	1,311	41,683	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	9.4000	1,180	1,148	36,518	2020/07/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	910	915	29,116	2021/02/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	1,170	1,189	37,808	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	1,010	968	30,791	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	520	530	16,853	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	490	510	16,223	2027/02/24
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		14,460	13,888	441,499	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 9,800	千メキシコ・ペソ 9,446	千円 58,754	2019/12/11
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	4,900	4,571	28,435	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	1,300	1,403	8,730	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	4,250	4,534	28,203	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	9,350	11,109	69,102	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	4,030	4,222	26,265	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,390	3,078	19,146	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,430	2,743	17,063	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,900	7,060	43,918	2018/12/13

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	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	3,300	3,731	23,212	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,590	6,832	42,498	2020/06/11	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	9,950	9,904	61,608	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,950	5,266	32,759	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	5,450	5,415	33,681	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,820	8,194	50,972	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	2,180	2,325	14,466	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			85,590	89,842	558,820		
			%	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	10,000	10,350	23,184	2021/01/15	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			10,000	10,350	23,184		
			%	千アルゼンチン・ペソ	千アルゼンチン・ペソ	千円		
アルゼンチン	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	18.2000	3,100	3,309	22,138	2021/10/03	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	16.0000	1,400	1,509	10,095	2023/10/17	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	15.5000	4,000	4,483	29,997	2026/10/17	
通貨小計	銘柄数	3銘柄						
	金 額			8,500	9,302	62,231		
			%	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ	千円		
チリ	Chile Government International Bond	国債証券	5.5000	590,000	627,866	106,988	2020/08/05	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			590,000	627,866	106,988		
			%	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	115,672	4,291	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	7.7500	95,000	102,301	3,795	2021/04/14	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	42,086	1,561	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	5.0000	520,000	522,147	19,371	2018/11/21	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	735,000	761,731	28,260	2019/09/11	
	Colombian TES	国債証券	11.0000	1,465,000	1,694,008	62,847	2020/07/24	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	1,625,000	1,704,966	63,254	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	1,650,000	2,011,861	74,640	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	940,000	897,596	33,300	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	1,530,000	1,631,729	60,537	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	940,000	1,020,811	37,872	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	380,000	381,881	14,167	2032/06/30	
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額			10,015,000	10,886,796	403,900		
			%	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	4,750,000	5,047,587	42,904	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	4,000,000	4,486,200	38,132	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,400,000	2,710,488	23,039	2020/11/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	12.8000	600,000	726,318	6,173	2021/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	1,000,000	1,246,910	10,598	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	980,000	1,234,280	10,491	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	5,710,000	6,016,569	51,140	2021/07/15	



		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	1,270,000	1,499,997	12,749	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,524,000	6,088,276	51,750	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	3,350,000	3,584,701	30,469	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	4,230,000	4,282,071	36,397	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	2,560,000	2,591,334	22,026	2022/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	1,410,000	1,330,673	11,310	2023/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	1,200,000	1,103,292	9,377	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,975,000	1,808,152	15,369	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,720,000	5,065,220	43,054	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,350,000	6,859,714	58,307	2024/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	4,920,000	5,572,096	47,362	2029/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.8750	3,900,000	3,993,483	33,944	2019/04/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		60,849,000	65,247,366	554,602		
			%	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	1,880	1,888	64,504	2021/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,330	2,308	78,841	2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	280	284	9,728	2019/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,390	1,360	46,458	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	1,380	1,340	45,792	2027/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	2,370	2,089	71,392	2019/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,510	1,269	43,375	2019/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,580	1,261	43,087	2020/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,270	1,145	39,141	2018/10/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	3,340	2,531	86,469	2020/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	1,720	1,483	50,668	2019/04/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		19,050	16,963	579,459		
			%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.7500	3,500	3,921	19,253	2020/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	3,300	3,832	18,817	2021/09/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	3,100	3,535	17,357	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	5,600	7,678	37,700	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.5000	6,000	6,226	30,572	2019/10/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	3,000	3,718	18,257	2022/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	3,100	3,501	17,192	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	3,200	3,230	15,860	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	3,100	2,983	14,647	2030/05/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		33,900	38,627	189,658		
			%	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	493	13,831	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	360	383	10,747	2019/06/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.6000	420	447	12,533	2018/11/28	
	Romania Government Bond	国債証券	5.9500	440	497	13,946	2021/06/11	
	Romania Government Bond	国債証券	5.7500	770	852	23,895	2020/04/29	

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	580	624	17,511	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	2.5000	360	367	10,311	2019/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	430	443	12,428	2021/03/22	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	300	346	9,698	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	2.2500	370	374	10,503	2020/02/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	480	493	13,815	2022/12/19	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			4,940	5,325	149,223		
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	2021/04/14	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,880	7,824	14,945	2019/02/27	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	7,130	7,106	13,573	2019/02/27	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	18,760	19,584	37,405	2027/02/03	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	11,910	11,844	22,622	2022/07/20	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.8000	6,500	6,363	12,154	2019/12/11	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	8,400	8,101	15,474	2023/01/25	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	11,660	11,111	21,222	2028/01/19	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.4000	14,100	13,651	26,074	2020/05/27	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.7000	15,700	15,464	29,537	2019/05/15	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,300	13,838	26,432	2023/08/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	18,300	18,111	34,593	2021/08/18	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	16,300	17,343	33,125	2031/09/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	15,300	15,362	29,342	2026/09/16	
Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	10,000	9,880	18,870	2022/12/07		
Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	11,000	10,824	20,673	2033/03/23		
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			187,240	186,413	356,049		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3900	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	2023/07/07	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	600	610	16,069	2026/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7430	870	861	22,654	2026/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.2260	280	279	7,343	2021/08/26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.2260	530	524	13,800	2020/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3780	970	988	26,002	2019/11/29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	920	932	24,530	2021/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	670	651	17,147	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5800	510	511	13,460	2018/09/28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	440	431	11,339	2022/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4920	540	538	14,171	2020/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	860	837	22,036	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	740	748	19,689	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	650	656	17,279	2021/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6540	910	913	24,033	2019/10/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	660	654	17,210	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6590	590	590	15,529	2020/10/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	590	589	15,520	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	570	551	14,504	2035/05/31	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7590	380	382	10,054	2019/03/15		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	500	494	13,010	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	800	790	20,787	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	600	596	15,699	2021/11/30	
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金 額			14,180	14,134	371,877		
			%	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	8.0000	1,120	1,127	9,654	2018/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.2500	2,590	2,567	21,981	2020/01/15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	8,450	9,379	80,291	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	3,220	2,282	19,535	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	2,560	2,476	21,200	2021/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	4,280	3,002	25,698	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	4,240	3,478	29,773	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	2,980	2,924	25,031	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	7,320	6,576	56,296	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	8,350	7,468	63,929	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	5,700	5,166	44,223	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	3,200	2,869	24,566	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	3,800	3,438	29,430	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	2,100	1,961	16,786	2035/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	1,000	926	7,928	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			60,910	55,645	476,327		
			%	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ	千円		
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	3.8750	18,300	19,115	63,465	2019/06/13	
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	12,950	15,805	52,472	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	11,500	12,451	41,339	2023/06/16	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	11,310	12,570	41,733	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	19,600	21,138	70,179	2021/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4500	2,800	2,888	9,591	2019/03/08	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	5,500	5,968	19,815	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.5500	12,000	12,335	40,953	2020/06/26	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	13,500	13,472	44,728	2022/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	5,100	5,400	17,928	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	7,400	7,197	23,897	2026/12/17	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			119,960	128,345	426,105		
			%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円		
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	580	604	20,968	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	770	819	28,455	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	535	641	22,269	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	7.8400	310	345	11,978	2020/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	465	510	17,722	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	770	854	29,652	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金 額			3,430	3,775	131,046		

ドイツ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	1,210	1,390	42,158	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	5.5000	880	949	28,790	2019/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.5000	1,210	1,193	36,168	2020/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,740	1,650	50,015	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	1,560	1,541	46,720	2021/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,270	1,243	37,696	2018/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,130	1,102	33,407	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,140	1,064	32,265	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,650	1,624	49,251	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	—	830	802	24,329	2019/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.2500	620	680	20,624	2020/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	570	647	19,621	2021/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	1,030	1,100	33,359	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	810	833	25,258	2019/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	1,540	1,557	47,208	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			17,190	17,382	526,876		
			%	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	66,300	72,000	30,002	2020/06/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	55,500	57,657	24,026	2024/06/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	23,000	22,969	9,571	2027/10/27	
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	23,907	9,962	2019/10/30	
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	39,000	40,959	17,067	2021/10/27	
	Hungary Government Bond	国債証券	7.5000	44,500	54,323	22,636	2020/11/12	
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	61,800	75,902	31,628	2023/11/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	6.5000	58,800	66,123	27,553	2019/06/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	63,000	79,318	33,051	2022/06/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	24,000	25,902	10,793	2018/12/20	
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	62,500	75,053	31,274	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			521,400	594,117	247,568		
合 計	銘柄数	196銘柄						
	金 額					5,605,421		

(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

2017年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	5,605,421	92.9
コール・ローン等、その他	430,170	7.1
投資信託財産総額	6,035,591	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=113.08円、1トルコ・リラ=31.79円、1メキシコ・ペソ=6.22円、1フィリピン・ペソ=2.24円、1アルゼンチン・ペソ=6.69円、100チリ・ペソ=17.04円、100コロンビア・ペソ=3.71円、100インドネシア・ルピア=0.85円、1ブラジル・レアル=34.16円、1チェコ・コルナ=4.91円、1ルーマニア・レイ=28.02円、1ロシア・ルーブル=1.91円、1マレーシア・リンギット=26.31円、1南アフリカ・ランド=8.56円、1タイ・バツ=3.32円、1ペルー・ソル=34.71円、1ポーランド・ズロチ=30.31円、100ハンガリー・フォリント=41.67円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(5,615,457千円)の投資信託財産総額(6,035,591千円)に対する比率は、93.0%です。

■損益の状況

当期 自2016年7月6日 至2017年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	273,591,161円
受取利息	273,617,913
支払利息	△ 26,752
(B) 有価証券売買損益	360,747,361
売買益	488,572,926
売買損	△ 127,825,565
(C) その他費用	△ 8,864,433
(D) 当期損益金 (A + B + C)	625,474,089
(E) 前期繰越損益金	525,594,128
(F) 解約差損益金	△ 143,268,092
(G) 追加信託差損益金	555,416,922
(H) 合計 (D + E + F + G)	1,563,217,047
次期繰越損益金 (H)	1,563,217,047

(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。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2017年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,217,272,228円
コール・ローン等	335,332,902
公社債 (評価額)	5,605,421,137
未収入金	183,046,337
未収利息	78,292,336
前払費用	15,179,516
(B) 負債	446,564,416
未払金	444,498,159
未払解約金	2,055,457
その他未払費用	10,800
(C) 純資産総額 (A - B)	5,770,707,812
元本	4,207,490,765
次期繰越損益金	1,563,217,047
(D) 受益権総口数	4,207,490,765口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,715円

\* 期首における元本額は2,923,660,797円、当期中における追加設定元本額は1,904,435,637円、同解約元本額は620,605,669円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 92,883,266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) 100,049,168円、D-1's 新興国債券インデックス31,709,295円、iFree 新興国債券インデックス464,867,850円、iFree 8資産バランス325,557,701円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド 2,999,269,705円、ダイワ・インデックスセレクト新興国債券174,677,461円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド18,476,319円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,715円です。