

ダイワ・インデックス セレクト 新興国債券

運用報告書(全体版) 第10期

(決算日 2023年7月5日)

(作成対象期間 2022年7月6日～2023年7月5日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | | |
|--------|---|-----------------------------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／海外／債券／インデックス型 | | |
| 信託期間 | 2013年12月2日～2028年7月5日 | | |
| 運用方針 | 投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーGING・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 | | |
| 主要投資対象 | ベビーファンド | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券 | |
| | ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 新興国通貨建ての債券 | |
| 組入制限 | ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 | 無制限 | |
| | マザーファンドの株式組入上限比率 | 純資産総額の10%以下 | |
| 分配方針 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。 | | |

◇TUZ0561920230705◇

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーGING・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先(コールセンター)
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<5619>

最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | JPMorgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (円換算) | | 公社債組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------------|-----------|--|-----------|---------|------|
| | (分配落) | 税込み 分配金 | 期中 騰落率 | (ベンチマーク) | 期中 騰落率 | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| 6期末(2019年7月5日) | 10,278 | 0 | 6.5 | 10,954 | 7.7 | 96.7 | 250 |
| 7期末(2020年7月6日) | 9,841 | 0 | △ 4.3 | 10,580 | △ 3.4 | 95.4 | 234 |
| 8期末(2021年7月5日) | 10,628 | 0 | 8.0 | 11,532 | 9.0 | 96.7 | 239 |
| 9期末(2022年7月5日) | 10,421 | 0 | △ 1.9 | 11,437 | △ 0.8 | 96.4 | 211 |
| 10期末(2023年7月5日) | 12,265 | 0 | 17.7 | 13,616 | 19.1 | 96.4 | 239 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) JPMorgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (円換算) は、JPMorgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。JPMorgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

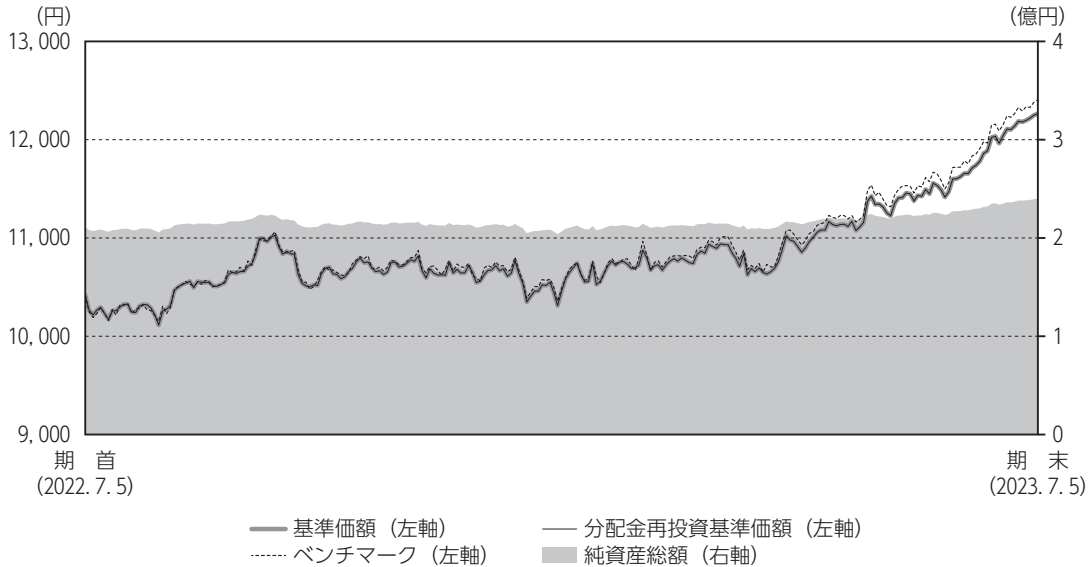
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークは、JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）です。

基準価額・騰落率

期首：10,421円

期末：12,265円（分配金0円）

騰落率：17.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことなどから、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。

ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券

| 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 |
|-----------------|---------|------------|--|------------|---------------|
| | 円 | 騰 落 率 % | (ベンチマーク) | 騰 落 率 % | |
| (期首)2022年 7月 5日 | 10,421 | — | 11,437 | — | 96.4 |
| 7月末 | 10,284 | △ 1.3 | 11,262 | △ 1.5 | 96.7 |
| 8月末 | 10,639 | 2.1 | 11,695 | 2.3 | 96.5 |
| 9月末 | 10,522 | 1.0 | 11,529 | 0.8 | 96.4 |
| 10月末 | 10,748 | 3.1 | 11,825 | 3.4 | 96.3 |
| 11月末 | 10,719 | 2.9 | 11,787 | 3.1 | 95.8 |
| 12月末 | 10,446 | 0.2 | 11,525 | 0.8 | 95.3 |
| 2023年 1月末 | 10,733 | 3.0 | 11,841 | 3.5 | 96.2 |
| 2月末 | 10,866 | 4.3 | 11,970 | 4.7 | 96.2 |
| 3月末 | 11,022 | 5.8 | 12,157 | 6.3 | 96.2 |
| 4月末 | 11,158 | 7.1 | 12,321 | 7.7 | 96.2 |
| 5月末 | 11,489 | 10.2 | 12,716 | 11.2 | 96.0 |
| 6月末 | 12,198 | 17.1 | 13,538 | 18.4 | 95.1 |
| (期末)2023年 7月 5日 | 12,265 | 17.7 | 13,616 | 19.1 | 96.4 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 7. 6 ~ 2023. 7. 5)

新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が低下（債券価格は上昇）しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より、米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、低下しました。F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇したことや、英国の財政政策の発表を受けて、金利が上昇する場面もありましたが、2022年11月には、インフレ期待の低下などを受けてF R Bによる利上げペース減速の可能性が意識されたことなどから、金利は低下に転じました。その後、F R Bが2023年末の政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は再び上昇しましたが、2023年3月には、米国の地方銀行の経営破綻に端を発する信用不安が広がり、将来の利下げ織り込みが加速したことや投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は再び低下しました。

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。

新興国通貨は、当作成期首より、米ドル円相場が円高米ドル安方向に進行したことから、多くの通貨は対円で下落しましたが、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことから、多くの通貨は対円で上昇しました。2022年12月には、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで、市場では事実上の金融引き締めと受け止められ円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。しかしその後は、F R Bの金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、多くの通貨が対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022.7.6～2023.7.5)

■当ファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

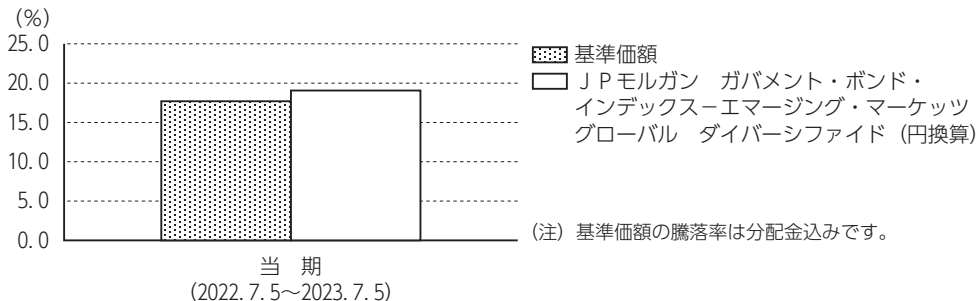
* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

| 組入ファンド | ベンチマーク |
|------------------------|--|
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) |

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は19.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は17.7%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、運用管理費用や税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

| 項 目 | 当 期 | |
|------------|-------------------------|-------|
| | 2022年7月6日 ～2023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） | 2,808 |

- （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。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

当ファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 (2022.7.6~2023.7.5) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|----------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 72円 | 0.660% | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,860円です。 |
| (投 信 会 社) | (34) | (0.313) | 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価 |
| (販 売 会 社) | (34) | (0.313) | 販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受 託 会 社) | (4) | (0.033) | 受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| 売 買 委 託 手 数 料 | — | — | 売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| 有 価 証 券 取 引 税 | — | — | 有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| そ の 他 費 用 | 9 | 0.086 | その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (8) | (0.076) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (監 査 費 用) | (1) | (0.008) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.002) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 81 | 0.746 | |

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

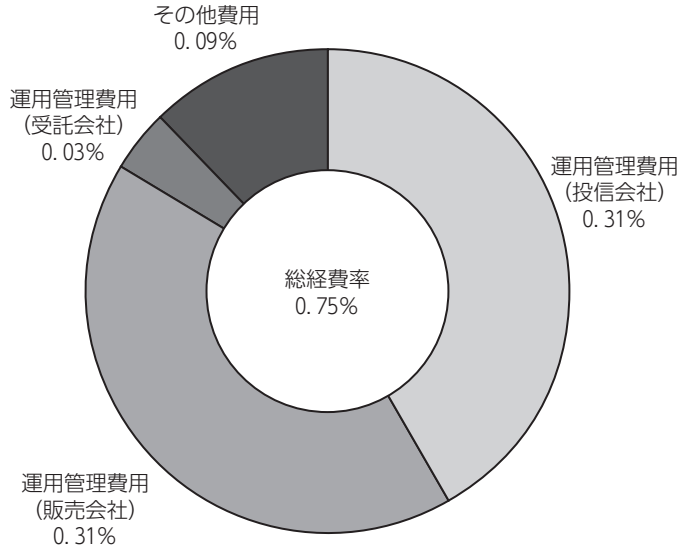
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.75%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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

(2022年7月6日から2023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 | 7,035 | 10,643 | 13,053 | 19,781 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|---------|---------|---------|
| | □ 数 | 評 価 額 | □ 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド | 145,588 | 239,029 | 139,571 | 239,029 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023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 | 239,029 | 99.3 |
| コール・ローン等、その他 | 1,729 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 240,758 | 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=144.56円、1エジプト・ポンド=4.675円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、1フィリピン・ペソ=2.616円、1アルゼンチン・ペソ=0.557円、100チリ・ペソ=18.091円、100コロンビア・ペソ=3.494円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=29.85円、1チェコ・コルナ=6.63円、1ルーマニア・レイ=31.778円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.14円、1ペルー・ソル=39.838円、1ポーランド・ズロチ=35.492円、100ハンガリー・フォリント=41.909円、1ウルグアイ・ペソ=3.851円、1ドミニカ・ペソ=2.601円、1ユーロ=157.37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(36,549,324千円)の投資信託財産総額(38,579,159千円)に対する比率は、94.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------------|--------------|
| (A) 資産 | 240,758,547円 |
| コール・ローン等 | 1,729,116 |
| ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額) | 239,029,431 |
| (B) 負債 | 796,647 |
| 未払解約金 | 72,746 |
| 未払信託報酬 | 715,050 |
| その他未払費用 | 8,851 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 239,961,900 |
| 元本 | 195,646,202 |
| 次期繰越損益金 | 44,315,698 |
| (D) 受益権総口数 | 195,646,202口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 12,265円 |

* 期首における元本額は202,601,401円、当作成期間中における追加設定元本額は18,743,322円、同解約元本額は25,698,521円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,265円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| (A) 配当等収益 | △ 362円 |
| 受取利息 | 12 |
| 支払利息 | △ 374 |
| (B) 有価証券売買損益 | 36,730,205 |
| 売買益 | 37,874,427 |
| 売買損 | △ 1,144,222 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,441,507 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 35,288,336 |
| (E) 前期繰越損益金 | 6,858,216 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,169,146 |
| (配当等相当額) | (12,792,670) |
| (売買損益相当額) | (△ 10,623,524) |
| (G) 合計(D+E+F) | 44,315,698 |
| 次期繰越損益金(G) | 44,315,698 |
| 追加信託差損益金 | 2,169,146 |
| (配当等相当額) | (12,792,670) |
| (売買損益相当額) | (△ 10,623,524) |
| 分配準備積立金 | 42,146,914 |
| 繰越損益金 | △ 362 |

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

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

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 32,095,551 |
| (c) 収益調整金 | 12,792,670 |
| (d) 分配準備積立金 | 10,051,363 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 54,939,584 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 54,939,584 |
| (h) 受益権総口数 | 195,646,202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13期（決算日 2023年7月5日）

（作成対象期間 2022年7月6日～2023年7月5日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ない ます。 |
| 主要投資対象 | 新興国通貨建ての債券 |
| 株式組入制限 | 純資産総額の10%以下 |

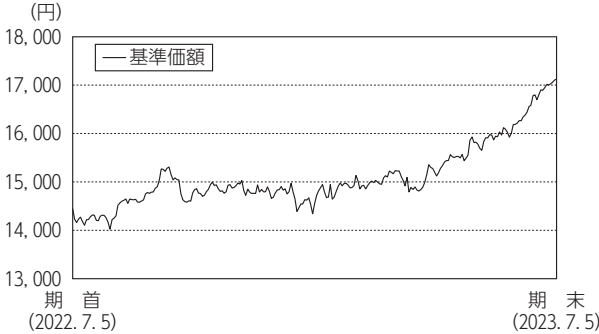
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：14,445円 期末：17,126円 騰落率：18.6%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことなどから、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。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が低下（債券価格は上昇）しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より、米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、低下しました。F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇したことや、英国の財政政策の発表を受けて、金利が上昇する場面もありましたが、2022年11月には、インフレ期待の低下などを受けてF R Bによる利上げペース減速の可能性が意識されたことなどから、金利は低下に転じました。その後、F R Bが2023年末の政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は再び上昇しましたが、2023年3月には、米国の地方銀行の経営破綻に端を発する信用不安が広がり、将来の利下げ織り込みが加速したことや投資家のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は再び低下しました。

○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。

新興国通貨は、当作成期首より、米ドル円相場が円高米ドル安方向に進行したことから、多くの通貨は対円で下落しましたが、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことから、多くの通貨は対円で上昇しました。2022年12月には、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで、市場では事実上の金融引き締めと受け止められ円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。しかしその後は、F R Bの金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、多くの通貨が対円で上昇しました。

◆前作成期における【今後の運用方針】

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は19.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.6%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

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

| 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－エマーシング・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 入 率 比 |
|----------------|--------|-------|--|-------|-------------|
| | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | 騰落率 | |
| (期首) 2022年7月5日 | 円 | % | 円 | % | % |
| | 14,445 | — | 15,584 | — | 96.7 |
| 7月末 | 14,260 | △ 1.3 | 15,346 | △ 1.5 | 97.1 |
| 8月末 | 14,764 | 2.2 | 15,935 | 2.3 | 96.9 |
| 9月末 | 14,609 | 1.1 | 15,710 | 0.8 | 96.8 |
| 10月末 | 14,932 | 3.4 | 16,113 | 3.4 | 96.7 |
| 11月末 | 14,900 | 3.1 | 16,062 | 3.1 | 96.2 |
| 12月末 | 14,527 | 0.6 | 15,704 | 0.8 | 95.7 |
| 2023年1月末 | 14,937 | 3.4 | 16,135 | 3.5 | 96.6 |
| 2月末 | 15,130 | 4.7 | 16,310 | 4.7 | 96.5 |
| 3月末 | 15,357 | 6.3 | 16,566 | 6.3 | 96.5 |
| 4月末 | 15,555 | 7.7 | 16,789 | 7.7 | 96.6 |
| 5月末 | 16,028 | 11.0 | 17,327 | 11.2 | 96.4 |
| 6月末 | 17,031 | 17.9 | 18,448 | 18.4 | 95.5 |
| (期末) 2023年7月5日 | 17,126 | 18.6 | 18,554 | 19.1 | 96.8 |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマーシング・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－エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメント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－エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

《今後の運用方針》

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

■ 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) | 12 (12) |
| (その他) | (0) |
| 合 計 | 12 |

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|--------|---------------------------|-----------------------------------|
| 外 | エジプト | 千エジプト・ポンド 12,654 | 千エジプト・ポンド — (—) |
| | トルコ | 千トルコ・リラ 33,621 | 千トルコ・リラ 12,823 (—) |
| | メキシコ | 千メキシコ・ペソ 95,238 | 千メキシコ・ペソ 60,537 (—) |
| | チリ | 千チリ・ペソ 1,372,843 | 千チリ・ペソ 445,454 (—) |
| | コロンビア | 千コロンビア・ペソ 11,993,880 | 千コロンビア・ペソ 796,042 (—) |
| | インドネシア | 千インドネシア・ルピア 80,304,651 | 千インドネシア・ルピア 10,356,147 (—) |
| 国 | ブラジル | 千ブラジル・レアル 90,319 | 千ブラジル・レアル 75,928 (—) |
| | チェコ | 千チェコ・コルナ 67,175 | 千チェコ・コルナ 11,521 (—) |
| | ルーマニア | 千ルーマニア・レイ 18,191 | 千ルーマニア・レイ 6,833 (—) |

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|-------|-------------------------|---------------------------------|
| 外 | 中国 | 千オフショア・人民元 68,406 | 千オフショア・人民元 13,810 (—) |
| | ロシア | 千ロシア・ルーブル — | 千ロシア・ルーブル — (—) |
| | マレーシア | 千マレーシア・リンギット 41,595 | 千マレーシア・リンギット 9,451 (—) |
| | 南アフリカ | 千南アフリカ・ランド 149,562 | 千南アフリカ・ランド 45,392 (—) |
| | タイ | 千タイ・バーツ 278,287 | 千タイ・バーツ 68,165 (—) |
| | ペルー | 千ペルー・ソル 4,593 | 千ペルー・ソル — (—) |
| 国 | ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 21,519 | 千ポーランド・ズロチ 5,721 (—) |
| | ハンガリー | 千ハンガリー・フォリント 556,970 | 千ハンガリー・フォリント 230,074 (—) |
| | ドミニカ | 千ドミニカ・ペソ 12,888 | 千ドミニカ・ペソ — (—) |

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

| 当 | | 期 | |
|--|---------|--|-----------|
| 買 | 付 | 期 | 付 |
| 銘 | 柄 | 銘 | 柄 |
| 金 額 | | 金 額 | |
| 千円 | | 千円 | |
| BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/7/1 | 676,008 | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1 | 1,134,115 |
| BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/1/1 | 500,857 | Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1 | 574,758 |
| Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1 | 307,598 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1 | 273,253 |
| BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2025/7/1 | 279,340 | Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2023/12/7 | 220,703 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31 | 178,396 | Thailand Government Bond (タイ) 2.4% 2023/12/17 | 151,324 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21 | 173,994 | Poland Government Bond (ポーランド) 4% 2023/10/25 | 144,004 |
| THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.65% 2028/6/17 | 172,584 | Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9 | 123,892 |
| MEXICAN BONOS (メキシコ) 5% 2025/3/6 | 164,381 | China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2 | 120,500 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1 | 158,146 | China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5 | 96,933 |
| POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 7.5% 2028/7/25 | 148,138 | Thailand Government Bond (タイ) 3.625% 2023/6/16 | 90,555 |

(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 | | 未 | | |
|---------|--------------|--------------|-----------|------|------------|-----------|------|------|
| | | 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 |
| 額 面 金 額 | 額 | 千円 | % | % | % | % | % | |
| | 千エジプト・ポンド | 千エジプト・ポンド | 千円 | % | % | % | % | % |
| エジプト | 66,600 | 54,706 | 255,756 | 0.7 | 0.7 | 0.1 | 0.5 | 0.1 |
| | 千トルコ・リラ | 千トルコ・リラ | | | | | | |
| トルコ | 52,860 | 50,818 | 282,653 | 0.8 | 0.8 | 0.1 | 0.6 | 0.1 |
| | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | | | | | | |
| メキシコ | 440,900 | 416,395 | 3,530,405 | 9.6 | — | 5.0 | 2.4 | 2.1 |
| | 千フィリピン・ペソ | 千フィリピン・ペソ | | | | | | |
| フィリピン | 10,000 | 9,659 | 25,274 | 0.1 | — | 0.1 | — | — |
| | 千チリ・ペソ | 千チリ・ペソ | | | | | | |
| チリ | 4,705,000 | 4,692,466 | 848,914 | 2.3 | — | 1.6 | 0.2 | 0.5 |
| | 千コロンビア・ペソ | 千コロンビア・ペソ | | | | | | |
| コロンビア | 53,780,000 | 47,197,658 | 1,649,133 | 4.5 | — | 2.6 | 1.5 | 0.4 |
| | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア | | | | | | |
| インドネシア | 340,819,000 | 361,127,831 | 3,502,939 | 9.5 | — | 6.6 | 1.8 | 1.1 |
| | 千ブラジル・リアル | 千ブラジル・リアル | | | | | | |
| ブラジル | 139,540 | 120,836 | 3,607,004 | 9.8 | — | 1.9 | 4.8 | 3.1 |
| | 千チェコ・コルナ | 千チェコ・コルナ | | | | | | |
| チェコ | 321,900 | 286,859 | 1,902,136 | 5.1 | — | 3.2 | 1.4 | 0.6 |
| | 千ルーマニア・レイ | 千ルーマニア・レイ | | | | | | |
| ルーマニア | 45,250 | 42,438 | 1,348,624 | 3.6 | — | 1.7 | 1.2 | 0.7 |
| | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | | | | | | |
| 中国 | 177,700 | 181,587 | 3,630,636 | 9.8 | — | 4.9 | 3.7 | 1.2 |
| | 千ロシア・ルーブル | 千ロシア・ルーブル | | | | | | |
| ロシア | 1,116,020 | — | — | — | — | — | — | — |
| | 千マレーシア・リンギット | 千マレーシア・リンギット | | | | | | |
| マレーシア | 115,930 | 117,037 | 3,640,163 | 9.8 | — | 5.4 | 3.4 | 1.0 |
| | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 477,710 | 389,080 | 3,015,377 | 8.2 | — | 6.7 | 1.4 | — |
| | 千タイ・バーツ | 千タイ・バーツ | | | | | | |
| タイ | 888,560 | 895,597 | 3,707,774 | 10.0 | — | 5.8 | 2.5 | 1.8 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 区 分 | 額 面 金 額 | 当 期 | | | 組入比率 | うちBB格 以下組入 率 | 未 | | |
|---------|---------------------------|---------------------------|------------|-----------|------|--------------------|------|------|------|
| | | 評 価 額 | | 残存期間別組入比率 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額 | | | | | | |
| ペルー | 千ペルー・ソル 23,010 | 千ペルー・ソル 22,637 | 901,825 | 2.4 | — | 2.1 | 0.2 | 0.1 | |
| ポーランド | 千ポーランド・ズロチ 86,030 | 千ポーランド・ズロチ 76,817 | 2,726,412 | 7.4 | — | 2.3 | 3.5 | 1.6 | |
| ハンガリー | 千ハンガリー・フォリント 3,237,000 | 千ハンガリー・フォリント 2,630,825 | 1,102,573 | 3.0 | — | 1.4 | 1.0 | 0.6 | |
| ウルグアイ | 千ウルグアイ・ペソ 9,800 | 千ウルグアイ・ペソ 9,134 | 35,180 | 0.1 | — | 0.1 | 0.0 | — | |
| ドミニカ共和国 | 千ドミニカ・ペソ 22,400 | 千ドミニカ・ペソ 25,391 | 66,066 | 0.2 | 0.2 | 0.1 | 0.1 | — | |
| 合計 | — | — | 35,778,854 | 96.8 | 1.6 | 51.4 | 30.3 | 15.1 | |

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(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 | 当 期 | | 償還年月日 |
|------|------------------------|------|---------|------------|-----------|------------|------------|
| | | | | | 未 | | |
| | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦貨換算金額 | |
| エジプト | ARAB REP EGYPT | 国債証券 | 16.1000 | 千エジプト・ポンド | 千エジプト・ポンド | 5,434 | 2029/05/07 |
| | | | 1.500 | 1,162 | 5,434 | 2029/05/07 | |
| | | | 14.3500 | 1,000 | 909 | 4,254 | 2024/09/10 |
| | | | 14.4000 | 4,000 | 2,858 | 13,365 | 2029/09/10 |
| | | | 13.5360 | 1,500 | 1,341 | 6,270 | 2025/01/14 |
| | | | 14.6640 | 4,500 | 3,170 | 14,822 | 2030/10/06 |
| | | | 14.5560 | 2,000 | 1,527 | 7,141 | 2027/10/13 |
| | | | 14.3690 | 9,000 | 7,670 | 35,860 | 2025/10/20 |
| | | | 14.2920 | 6,000 | 4,561 | 21,325 | 2028/01/05 |
| | | | 14.0600 | 18,800 | 15,673 | 73,274 | 2026/01/12 |
| | | | 14.4830 | 9,000 | 7,424 | 34,711 | 2026/04/06 |
| | | | 14.5630 | 1,000 | 816 | 3,818 | 2026/07/06 |
| | | | 14.5310 | 8,300 | 7,588 | 35,477 | 2024/09/14 |
| | | | 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 12銘柄 | | 66,600 |
| トルコ | Turkey Government Bond | 国債証券 | 9.0000 | 千トルコ・リラ | 千トルコ・リラ | 8,615 | 2024/07/24 |
| | | | 8.0000 | 1,630 | 1,549 | 13,688 | 2025/03/12 |
| | | | 10.6000 | 2,690 | 2,461 | 28,895 | 2026/02/11 |
| | | | 11.0000 | 5,570 | 5,195 | 14,995 | 2027/02/24 |
| | | | 10.5000 | 2,970 | 2,696 | 45,800 | 2027/08/11 |
| | | | 12.4000 | 9,000 | 8,234 | 24,716 | 2028/03/08 |
| | | | 12.6000 | 5,000 | 4,443 | 50,851 | 2025/10/01 |
| | | | 11.7000 | 9,100 | 9,142 | 44,345 | 2030/11/13 |
| | | | 16.9000 | 8,400 | 7,972 | 50,745 | 2026/09/02 |
| | | | 16.9000 | 8,500 | 9,123 | | |
| | | | 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 9銘柄 | | 52,860 |
| メキシコ | Mexican Bonos | 国債証券 | 5.7500 | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 406,212 | 2026/03/05 |
| | | | 52,400 | 47,910 | 227,443 | 2047/11/07 | |
| | | | 8.0000 | 29,300 | 26,825 | 320,262 | 2024/09/05 |
| | | | 8.0000 | 39,000 | 37,773 | 173,599 | 2027/03/04 |
| | | | 5.5000 | 23,000 | 20,475 | | |

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 | | |
| | | | % | 千メキシコ・ペソ | 千メキシコ・ペソ | 千円 | | |
| | MEXICAN BONOS | 国債証券 | 5.0000 | 25,700 | 23,734 | 201,237 | 2025/03/06 | |
| | MEXICAN BONOS | 国債証券 | 8.0000 | 16,000 | 14,546 | 123,330 | 2025/07/31 | |
| | MEXICAN BONOS | 国債証券 | 7.5000 | 15,300 | 14,123 | 119,744 | 2023/05/26 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 30,550 | 30,323 | 257,098 | 2024/12/05 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.5000 | 40,030 | 38,084 | 322,899 | 2027/06/03 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 10.0000 | 9,390 | 10,408 | 88,251 | 2026/11/20 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 35,230 | 34,874 | 295,686 | 2029/05/31 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 8.5000 | 25,100 | 24,502 | 207,741 | 2028/11/18 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 55,350 | 52,436 | 444,581 | 2031/05/29 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 34,120 | 30,628 | 259,683 | 2042/11/13 | |
| | Mexican Bonos | 国債証券 | 7.7500 | 10,430 | 9,746 | 82,632 | 2024/11/23 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 15銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 440,900 | 416,395 | 3,530,405 | | |
| フィリピン | Philippine Government International Bond | 国債証券 | 6.2500 | 千フィリピン・ペソ | 千フィリピン・ペソ | 25,274 | 2036/01/14 | |
| | | | | 10,000 | 9,659 | | | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 1銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 10,000 | 9,659 | 25,274 | | |
| チリ | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 4.5000 | 千チリ・ペソ | 千チリ・ペソ | 88,052 | 2026/03/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 5.0000 | 500,000 | 486,720 | 128,797 | 2025/03/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 6.0000 | 720,000 | 711,943 | 126,117 | 2024/01/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 4.7000 | 630,000 | 697,126 | 120,060 | 2030/09/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 2.5000 | 685,000 | 663,648 | 169,646 | 2025/03/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 2.3000 | 1,000,000 | 937,740 | 129,646 | 2025/03/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 2.3000 | 250,000 | 216,385 | 39,146 | 2028/10/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 5.0000 | 200,000 | 197,026 | 35,643 | 2028/10/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 7.0000 | 220,000 | 252,412 | 45,663 | 2034/05/01 | |
| | BONOS TESORERIA PESOS | 国債証券 | 6.0000 | 500,000 | 529,465 | 95,785 | 2033/04/01 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 9銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 4,705,000 | 4,692,466 | 848,914 | | |
| コロンビア | Colombia Government International Bond | 国債証券 | 9.8500 | 千コロンビア・ペソ | 千コロンビア・ペソ | 3,037 | 2027/06/28 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 10.0000 | 90,000 | 86,933 | 134,711 | 2024/07/24 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 6.0000 | 3,850,000 | 3,855,390 | 167,329 | 2028/04/28 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.5000 | 5,570,000 | 4,788,918 | 177,554 | 2026/08/26 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.5000 | 5,410,000 | 5,081,558 | 112,524 | 2030/09/18 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.0000 | 3,600,000 | 3,220,416 | 133,840 | 2032/06/30 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 6.2500 | 4,650,000 | 3,830,484 | 119,663 | 2025/11/26 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.2500 | 3,700,000 | 3,424,720 | 138,081 | 2034/10/18 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.2500 | 4,900,000 | 3,951,850 | 96,493 | 2027/11/03 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 5.7500 | 3,200,000 | 2,761,600 | 112,661 | 2020/10/26 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 7.2500 | 4,100,000 | 3,224,334 | 48,514 | 2036/07/09 | |
| | Colombian TES | 国債証券 | 6.2500 | 1,900,000 | 1,388,482 | 159,858 | 2031/03/26 | |
| | COLOMBIAN TES | 国債証券 | 7.0000 | 5,400,000 | 4,575,096 | 141,558 | 2042/05/28 | |
| | COLOMBIAN TES | 国債証券 | 9.2500 | 4,500,000 | 4,051,350 | 103,303 | 2033/02/09 | |
| | COLOMBIAN TES | 国債証券 | 13.2500 | 2,500,000 | 2,956,525 | | | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 14銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 53,780,000 | 47,197,658 | 1,649,133 | | |
| インドネシア | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.2500 | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア | 126,372 | 2036/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.7500 | 11,250,000 | 13,028,062 | 89,403 | 2031/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.5000 | 8,000,000 | 9,216,880 | 57,794 | 2032/08/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.5000 | 5,300,000 | 5,958,205 | 76,854 | 2038/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.5000 | 7,300,000 | 7,923,128 | 98,857 | 2024/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.1250 | 10,000,000 | 10,191,500 | | | |

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 | | |
| | | | % | 千インドネシア・ルピア | 千インドネシア・ルピア | 千円 | | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.3750 | 6,000,000 | 7,036,620 | 68,255 | 2039/04/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.2500 | 12,000,000 | 13,242,960 | 128,456 | 2029/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.0000 | 17,300,000 | 18,040,613 | 174,993 | 2030/09/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 6.5000 | 16,700,000 | 16,902,237 | 163,951 | 2025/06/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.5000 | 13,300,000 | 14,478,114 | 140,437 | 2035/06/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.5000 | 13,500,000 | 14,704,470 | 142,633 | 2040/04/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 5.5000 | 14,400,000 | 14,320,656 | 138,910 | 2026/04/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 6.5000 | 20,800,000 | 21,082,464 | 204,499 | 2031/02/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 6.2500 | 7,300,000 | 7,251,455 | 70,339 | 2036/06/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 6.3750 | 20,600,000 | 20,752,646 | 201,300 | 2032/04/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 5.1250 | 12,000,000 | 11,788,200 | 114,345 | 2027/04/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 7.1250 | 11,700,000 | 12,356,253 | 119,855 | 2042/06/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 6.3750 | 2,700,000 | 2,696,976 | 26,160 | 2037/07/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 7.0000 | 11,300,000 | 11,956,417 | 115,977 | 2033/02/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 6.3750 | 7,600,000 | 7,767,732 | 75,347 | 2028/08/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 7.1250 | 4,600,000 | 4,943,666 | 47,953 | 2043/06/15 | |
| | INDONESIA TREASURY BOND | 国債証券 | 7.1250 | 4,700,000 | 5,030,645 | 48,797 | 2038/06/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 11.0000 | 3,600,000 | 3,985,308 | 38,657 | 2025/09/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 10.5000 | 3,480,000 | 4,308,588 | 41,793 | 2030/08/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 9.5000 | 2,970,000 | 3,587,344 | 34,797 | 2031/07/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.3750 | 12,824,000 | 13,756,433 | 133,437 | 2026/09/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.2500 | 4,750,000 | 5,455,032 | 51,846 | 2032/06/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 7.0000 | 12,530,000 | 12,999,875 | 126,098 | 2027/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 6.1250 | 11,450,000 | 11,554,538 | 112,079 | 2028/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 6.6250 | 10,575,000 | 10,824,993 | 105,002 | 2033/05/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.3750 | 14,320,000 | 16,555,065 | 160,584 | 2034/03/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 8.3750 | 15,150,000 | 15,424,821 | 149,620 | 2024/03/15 | |
| | Indonesia Treasury Bond | 国債証券 | 9.0000 | 10,620,000 | 12,115,933 | 117,524 | 2029/03/15 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 33銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 340,819,000 | 361,127,831 | 3,502,939 | | |
| ブラジル | | | | 千ブラジル・レアル | 千ブラジル・レアル | | | |
| | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 12,890 | 12,750 | 380,602 | 2025/01/01 | |
| | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 14,850 | 14,776 | 441,094 | 2027/01/01 | |
| | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 14,100 | 13,816 | 412,419 | 2029/01/01 | |
| | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F | 国債証券 | 10.0000 | 4,600 | 4,469 | 133,412 | 2031/01/01 | |
| | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F | 国債証券 | 10.0000 | 4,800 | 4,625 | 138,064 | 2033/01/01 | |
| | Brazil Letras do Tesouro Nacional | 国債証券 | — | 14,600 | 13,109 | 391,320 | 2024/07/01 | |
| | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 国債証券 | — | 15,500 | 12,758 | 380,844 | 2025/07/01 | |
| | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 国債証券 | — | 27,200 | 21,335 | 636,858 | 2026/01/01 | |
| | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL | 国債証券 | — | 31,000 | 23,195 | 692,388 | 2026/07/01 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 9銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | 139,540 | 120,836 | 3,607,004 | | |
| チェコ | | | | 千チェコ・コルナ | 千チェコ・コルナ | | | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 2.5000 | 19,600 | 17,827 | 118,214 | 2028/08/25 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 5.7000 | 12,100 | 12,093 | 80,193 | 2024/05/25 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 2.4000 | 21,100 | 19,889 | 131,886 | 2025/09/17 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 1.0000 | 23,900 | 21,377 | 141,752 | 2026/06/26 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 0.9500 | 22,000 | 17,673 | 117,191 | 2030/05/15 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 0.2500 | 22,500 | 19,237 | 127,560 | 2027/02/10 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 24,500 | 22,368 | 148,323 | 2029/07/23 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 22,000 | 17,930 | 118,892 | 2033/10/13 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 1.2000 | 22,700 | 18,160 | 120,417 | 2031/03/13 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 0.0500 | 10,000 | 7,626 | 50,567 | 2029/11/29 | |
| | Czech Republic Government Bond | 国債証券 | 4.2000 | 13,500 | 13,361 | 88,596 | 2036/12/04 | |

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 | |
| | | | % | 千チェコ・コルナ | 千チェコ・コルナ | 千円 | | |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 20,500 | 16,779 | 111,261 | 2032/06/23 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.2500 | 17,500 | 16,409 | 108,810 | 2025/02/14 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.5000 | 10,000 | 6,590 | 43,697 | 2040/04/24 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 5,000 | 4,617 | 30,618 | 2024/12/12 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 6,000 | 5,590 | 37,070 | 2035/05/30 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 15,500 | 15,965 | 105,862 | 2026/02/26 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.0000 | 15,500 | 16,145 | 107,057 | 2030/09/30 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 5.5000 | 12,000 | 12,651 | 83,887 | 2028/12/12 |
| | | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.9500 | 6,000 | 4,566 | 30,276 | 2037/07/30 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 20銘柄 | | | 321,900 | 286,859 | 1,902,136 | |
| | | | | | 千ルーマニア・レイ | 千ルーマニア・レイ | | |
| ルーマニア | | Romania Government Bond | 国債証券 | 4.7500 | 2,450 | 2,389 | 75,937 | 2025/02/24 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 5.8000 | 2,800 | 2,720 | 86,448 | 2027/07/26 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 1,600 | 1,561 | 49,636 | 2024/04/29 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 5.0000 | 2,600 | 2,400 | 76,275 | 2029/02/12 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 4.8500 | 2,500 | 2,399 | 76,267 | 2026/04/22 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 2,900 | 2,367 | 75,228 | 2031/09/24 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 4.5000 | 2,500 | 2,459 | 78,149 | 2024/06/17 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 2,300 | 2,189 | 69,564 | 2025/07/28 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 4.1500 | 1,600 | 1,446 | 45,965 | 2028/01/26 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 3.7000 | 2,200 | 2,128 | 67,650 | 2024/11/25 |
| | | Romania Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 2,100 | 1,926 | 61,214 | 2026/06/24 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.1500 | 2,500 | 2,136 | 67,887 | 2030/10/24 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 2,700 | 2,284 | 72,596 | 2034/10/11 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 2,300 | 1,953 | 62,092 | 2027/10/25 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.8500 | 2,300 | 2,092 | 66,499 | 2029/07/25 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.7000 | 2,000 | 1,998 | 63,514 | 2032/02/25 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.2500 | 1,100 | 861 | 27,372 | 2036/04/28 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5000 | 2,000 | 1,877 | 59,657 | 2025/11/25 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.2500 | 2,100 | 2,314 | 73,536 | 2032/09/29 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.7500 | 700 | 762 | 24,224 | 2028/10/30 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 8.0000 | 500 | 531 | 16,887 | 2030/04/29 |
| | | ROMANIA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.9000 | 1,500 | 1,636 | 52,015 | 2038/02/24 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 22銘柄 | | | 45,250 | 42,438 | 1,348,624 | |
| | | | | | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | | |
| 中国 | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2200 | 3,700 | 3,790 | 75,779 | 2025/12/06 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 4,800 | 5,006 | 100,101 | 2028/11/22 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.1900 | 4,000 | 4,042 | 80,824 | 2024/04/11 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2900 | 5,900 | 6,167 | 123,308 | 2029/05/23 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 4,800 | 4,940 | 98,777 | 2026/06/06 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.1200 | 4,200 | 4,315 | 86,292 | 2026/12/05 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.1300 | 5,700 | 5,890 | 117,769 | 2029/11/21 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 2.9400 | 4,500 | 4,554 | 91,061 | 2024/10/17 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 2.8500 | 4,800 | 4,883 | 97,631 | 2027/06/04 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 2.6800 | 8,000 | 8,025 | 160,466 | 2030/05/21 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 1.9900 | 6,500 | 6,479 | 129,549 | 2025/04/09 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.0200 | 7,000 | 7,133 | 142,623 | 2025/10/22 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2800 | 5,000 | 5,198 | 103,946 | 2027/12/03 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.2700 | 6,300 | 6,608 | 132,127 | 2030/11/19 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.0300 | 3,900 | 3,987 | 79,718 | 2026/03/11 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.8100 | 5,800 | 6,559 | 131,149 | 2050/09/14 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 2.8400 | 4,000 | 4,030 | 80,583 | 2024/04/08 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 区 分 | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 | |
|------|----------------------------|-----------------------|--------|--------|-----------|------------|-------------|-----------|------------|
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | | |
| | | | | | % | 千オフショア・人民元 | 千オフショア・人民元 | 千円 | |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.0100 | 5,000 | 5,133 | 102,644 | | 2028/05/13 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.7200 | 2,000 | 2,230 | 44,604 | | 2051/04/12 |
| | | China Government Bond | 国債証券 | 3.0200 | 7,000 | 7,195 | 143,860 | | 2031/05/27 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6900 | 2,500 | 2,529 | 50,565 | | 2026/08/12 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.4700 | 3,900 | 3,920 | 78,380 | | 2024/09/02 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.9100 | 1,800 | 1,837 | 36,732 | | 2028/10/14 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.5300 | 1,000 | 1,080 | 21,605 | | 2051/10/18 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8900 | 3,500 | 3,561 | 71,217 | | 2031/11/18 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.3700 | 2,800 | 2,800 | 55,994 | | 2027/01/20 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 3,000 | 3,013 | 60,243 | | 2032/02/17 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8000 | 3,500 | 3,550 | 70,978 | | 2029/03/24 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.4800 | 2,200 | 2,209 | 44,177 | | 2027/04/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.3200 | 1,000 | 1,042 | 20,847 | | 2052/04/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7600 | 2,500 | 2,512 | 50,238 | | 2032/05/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7500 | 3,600 | 3,633 | 72,654 | | 2029/06/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.5000 | 3,700 | 3,712 | 74,226 | | 2027/07/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6900 | 3,000 | 2,998 | 59,943 | | 2032/08/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.1800 | 3,900 | 3,897 | 77,923 | | 2025/08/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6000 | 1,600 | 1,587 | 31,737 | | 2032/09/01 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6200 | 3,300 | 3,303 | 66,048 | | 2029/09/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.4400 | 3,200 | 3,203 | 64,057 | | 2027/10/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.1200 | 1,200 | 1,213 | 24,258 | | 2052/10/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8000 | 3,700 | 3,720 | 74,396 | | 2032/11/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2800 | 3,000 | 3,004 | 60,063 | | 2025/11/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.7900 | 1,200 | 1,212 | 24,233 | | 2029/12/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6400 | 1,200 | 1,210 | 24,203 | | 2028/01/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.4600 | 2,600 | 2,614 | 52,265 | | 2026/02/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8800 | 2,500 | 2,543 | 50,849 | | 2033/02/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.8000 | 1,700 | 1,717 | 34,345 | | 2030/03/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6200 | 3,300 | 3,331 | 66,615 | | 2028/04/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.1900 | 1,200 | 1,240 | 24,803 | | 2053/04/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6700 | 3,200 | 3,211 | 64,207 | | 2033/05/25 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 49銘柄 | | | 177,700 | 181,587 | 3,630,636 | | |
| ロシア | | | | | 千ロシア・ルーブル | 千ロシア・ルーブル | | | |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 8.1500 | 46,760 | — | — | — | — | 2027/02/03 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.0500 | 46,160 | — | — | — | — | 2028/01/19 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.0000 | 33,800 | — | — | — | — | 2023/08/16 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 8.5000 | 43,000 | — | — | — | — | 2031/09/17 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.7500 | 45,600 | — | — | — | — | 2026/09/16 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.7000 | 46,100 | — | — | — | — | 2033/03/23 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.1000 | 48,600 | — | — | — | — | 2024/10/16 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 6.5000 | 48,000 | — | — | — | — | 2024/02/28 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.2500 | 55,000 | — | — | — | — | 2034/05/10 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 6.9000 | 49,000 | — | — | — | — | 2029/05/23 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.9500 | 46,000 | — | — | — | — | 2026/10/07 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.4000 | 55,000 | — | — | — | — | 2024/07/17 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.1500 | 59,000 | — | — | — | — | 2025/11/12 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.6500 | 65,000 | — | — | — | — | 2030/04/10 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 7.7000 | 38,000 | — | — | — | — | 2039/03/16 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 6.0000 | 68,000 | — | — | — | — | 2027/10/06 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 4.5000 | 71,000 | — | — | — | — | 2025/07/16 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 6.1000 | 63,000 | — | — | — | — | 2035/07/18 |
| | Russian Federal Bond - OFZ | 国債証券 | 5.7000 | 65,000 | — | — | — | — | 2028/05/17 |
| | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ | 国債証券 | 6.9000 | 74,000 | — | — | — | — | 2031/07/23 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 区 分 | | 銘 柄 | 種 類 | 年 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | | 償 還 年 月 日 |
|-------|------------|--------------------------------------|------|---------|-----------------------|-----------------------|-------------|------------|
| | | | | | | 外 貨 建 金 額 | 邦 貨 換 算 金 額 | |
| | | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ | 国債証券 | 6.7000 | 千ロシア・ルーブル 50,000 | 千ロシア・ルーブル — | 千円 — | 2029/03/14 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 21銘柄 | | | 1,116,020 | — | — | |
| マレーシア | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4.0700 | 千マレーシア・リンギット 2,800 | 千マレーシア・リンギット 2,843 | 88,442 | 2026/09/30 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4.2580 | 1,800 | 1,838 | 57,190 | 2027/07/26 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4.3690 | 3,500 | 3,601 | 112,017 | 2028/10/31 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4.1280 | 1,900 | 1,929 | 60,003 | 2025/08/15 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 4.1300 | 2,900 | 2,949 | 91,736 | 2029/07/09 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3.6550 | 2,700 | 2,705 | 84,154 | 2024/10/15 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3.7260 | 4,200 | 4,219 | 131,223 | 2026/03/31 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3.4650 | 5,100 | 4,967 | 154,487 | 2030/10/15 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3.4220 | 3,500 | 3,462 | 107,693 | 2027/09/30 |
| | | Malaysia Government Investment Issue | 国債証券 | 3.4470 | 3,100 | 2,924 | 90,946 | 2036/07/15 |
| | | MALAYSIA T-BILL | 国債証券 | 4.4170 | 3,300 | 3,423 | 106,490 | 2041/09/30 |
| | | MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE | 国債証券 | 3.9900 | 3,800 | 3,840 | 119,435 | 2025/10/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5020 | 2,450 | 2,435 | 75,761 | 2027/05/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7330 | 3,850 | 3,857 | 119,972 | 2028/06/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1810 | 1,740 | 1,752 | 54,511 | 2024/07/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9550 | 4,350 | 4,390 | 136,551 | 2025/09/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2540 | 2,300 | 2,335 | 72,640 | 2035/05/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9000 | 3,800 | 3,838 | 119,389 | 2026/11/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0590 | 1,720 | 1,731 | 53,864 | 2024/09/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8990 | 3,820 | 3,856 | 119,945 | 2027/11/16 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.7620 | 4,300 | 4,595 | 142,944 | 2037/04/07 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8820 | 2,800 | 2,822 | 87,788 | 2025/03/14 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.8930 | 3,300 | 3,609 | 112,255 | 2038/06/08 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.9060 | 3,000 | 3,032 | 94,332 | 2026/07/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8850 | 2,950 | 2,959 | 92,044 | 2029/08/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.9210 | 2,100 | 2,318 | 72,119 | 2048/07/06 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.4780 | 3,300 | 3,304 | 102,775 | 2024/06/14 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.8280 | 3,000 | 2,945 | 91,598 | 2034/07/05 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.7570 | 3,500 | 3,334 | 103,708 | 2040/05/22 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.0650 | 4,300 | 4,212 | 131,019 | 2050/06/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 2.6320 | 2,900 | 2,652 | 82,486 | 2031/04/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5820 | 2,400 | 2,344 | 72,908 | 2032/07/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.1930 | 3,400 | 3,470 | 107,947 | 2032/10/07 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.6960 | 3,500 | 3,756 | 116,837 | 2042/10/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5990 | 600 | 596 | 18,549 | 2028/07/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2910 | 2,100 | 2,140 | 66,560 | 2043/08/14 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.6620 | 1,400 | 1,500 | 46,676 | 2038/03/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.2450 | 2,400 | 2,462 | 76,598 | 2030/09/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 4.4570 | 750 | 782 | 24,338 | 2053/03/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 国債証券 | 3.5190 | 1,300 | 1,293 | 40,218 | 2028/04/20 |
| 通貨小計 | 銘柄数 金 額 | 40銘柄 | | | 115,930 | 117,037 | 3,640,163 | |
| 南アフリカ | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 10.5000 | 千南アフリカ・ランド 65,650 | 千南アフリカ・ランド 68,142 | 528,106 | 2026/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.2500 | 17,720 | 11,284 | 87,458 | 2036/03/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 6.5000 | 16,280 | 9,630 | 74,635 | 2041/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 7.0000 | 29,540 | 23,611 | 182,987 | 2031/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 63,020 | 45,692 | 354,118 | 2048/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.5000 | 45,800 | 34,947 | 270,844 | 2037/01/31 |

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

| 区 分 | | 当 期 | | | 末 | | | 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 | | |
| | | | % | 千南アフリカ・ランド | 千南アフリカ・ランド | 千円 | | |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.0000 | 62,200 | 54,905 | 425,515 | 2030/01/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.7500 | 42,700 | 31,301 | 242,584 | 2044/01/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.2500 | 52,200 | 43,798 | 339,437 | 2032/03/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 8.8750 | 46,200 | 37,789 | 292,866 | 2035/02/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 国債証券 | 9.0000 | 36,400 | 27,977 | 216,822 | 2040/01/31 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 11銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 477,710 | 389,080 | 3,015,377 | |
| | | | | | 千タイ・バーツ | 千タイ・バーツ | | |
| タイ | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 4.8750 | 36,050 | 41,019 | 169,822 | 2029/06/22 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.8500 | 31,610 | 32,891 | 136,170 | 2025/12/12 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.6500 | 32,700 | 35,593 | 147,356 | 2031/06/20 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.4000 | 29,600 | 31,682 | 131,164 | 2036/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.1250 | 48,400 | 48,308 | 199,997 | 2026/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.7750 | 48,500 | 53,644 | 222,087 | 2032/06/25 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.8750 | 34,900 | 33,783 | 139,862 | 2046/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.8750 | 34,500 | 35,437 | 146,710 | 2028/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 3.3000 | 40,500 | 42,804 | 177,212 | 2038/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 1.4500 | 42,000 | 41,599 | 172,221 | 2024/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 1.6000 | 36,500 | 34,848 | 144,272 | 2029/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 1.6000 | 15,500 | 13,838 | 57,290 | 2035/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 0.9500 | 43,000 | 42,043 | 174,059 | 2025/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 32,900 | 32,494 | 134,527 | 2024/06/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 1.5850 | 32,900 | 29,171 | 120,771 | 2035/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 64,000 | 62,002 | 256,690 | 2031/12/17 |
| | | Thailand Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 23,000 | 19,774 | 81,865 | 2042/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.0000 | 61,000 | 58,104 | 240,551 | 2027/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 0.7500 | 43,000 | 42,316 | 175,189 | 2024/09/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.6500 | 43,000 | 43,699 | 180,916 | 2028/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.3900 | 24,500 | 26,157 | 108,291 | 2037/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.3500 | 36,500 | 36,694 | 151,915 | 2026/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.4500 | 20,000 | 21,249 | 87,970 | 2043/06/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.3500 | 34,000 | 36,438 | 150,856 | 2033/06/17 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 24銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 888,560 | 895,597 | 3,707,774 | |
| | | | | | 千ペルー・ソル | 千ペルー・ソル | | |
| ペルー | | Peru Government Bond | 国債証券 | 5.7000 | 1,230 | 1,223 | 48,756 | 2024/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 6.3500 | 2,870 | 2,922 | 116,438 | 2028/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 6.1500 | 3,350 | 3,227 | 128,594 | 2032/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 5.9400 | 3,400 | 3,355 | 133,669 | 2029/02/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 5.4000 | 2,050 | 1,830 | 72,911 | 2034/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 5.3500 | 1,500 | 1,267 | 50,510 | 2040/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 8.2000 | 2,075 | 2,205 | 87,851 | 2026/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 6.9000 | 3,465 | 3,460 | 137,841 | 2037/08/12 |
| | | Peru Government Bond | 国債証券 | 6.9500 | 3,070 | 3,144 | 125,252 | 2031/08/12 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 9銘柄 | | | | | | |
| | 金 額 | | | | 23,010 | 22,637 | 901,825 | |
| | | | | | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | | |
| ポーランド | | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.5000 | 8,190 | 7,494 | 265,984 | 2026/07/25 |
| | | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.5000 | 5,240 | 4,660 | 165,418 | 2027/07/25 |
| | | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.5000 | 5,600 | 5,448 | 193,371 | 2024/04/25 |
| | | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 8,250 | 7,060 | 250,577 | 2029/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.2500 | 6,700 | 6,398 | 227,084 | 2024/10/25 |
| | | Poland Government Bond | 国債証券 | 0.7500 | 5,550 | 5,089 | 180,641 | 2025/04/25 |

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 | |
| | | | % | 千ポーランド・ズロチ | 千ポーランド・ズロチ | 千円 | |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 1.2500 | 6,900 | 5,160 | 183,174 | 2030/10/25 |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 0.2500 | 6,300 | 5,301 | 188,152 | 2026/10/25 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 1.7500 | 6,950 | 5,095 | 180,846 | 2032/04/25 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.7500 | 6,150 | 5,759 | 204,426 | 2027/05/25 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 7.5000 | 4,200 | 4,545 | 161,338 | 2028/07/25 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | — | 1,300 | 1,150 | 40,833 | 2025/10/25 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 6.0000 | 1,600 | 1,639 | 58,201 | 2033/10/25 |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 6,950 | 6,151 | 218,320 | 2028/04/25 |
| | Poland Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 6,150 | 5,861 | 208,041 | 2025/07/25 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 15銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 86,030 | 76,817 | 2,726,412 | |
| ハンガリー | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 98,500 | 91,682 | 38,424 | 2024/06/26 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 270,000 | 225,909 | 94,678 | 2027/10/27 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 2.7500 | 130,000 | 108,260 | 45,371 | 2026/12/22 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 6.7500 | 153,000 | 147,291 | 61,729 | 2028/10/22 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 225,000 | 176,625 | 74,023 | 2030/08/21 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 2.5000 | 220,000 | 198,880 | 83,350 | 2024/10/24 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.2500 | 272,000 | 212,350 | 88,995 | 2031/10/22 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 1.0000 | 270,000 | 226,260 | 94,825 | 2025/11/26 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 3.0000 | 202,000 | 131,219 | 54,993 | 2038/10/27 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 169,000 | 139,458 | 58,446 | 2026/04/22 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 2.0000 | 135,000 | 102,964 | 43,152 | 2029/05/23 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 2.2500 | 215,000 | 149,113 | 62,493 | 2033/04/20 |
| | Hungary Government Bond | 国債証券 | 1.5000 | 100,000 | 81,290 | 34,068 | 2026/08/26 |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 3.0000 | 150,000 | 93,828 | 39,323 | 2041/04/25 |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 2.2500 | 75,000 | 49,935 | 20,927 | 2034/06/22 |
| | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.5000 | 100,000 | 87,846 | 36,816 | 2028/03/23 |
| HUNGARY GOVERNMENT BOND | 国債証券 | 4.7500 | 170,000 | 145,540 | 60,995 | 2032/11/24 | |
| Hungary Government Bond | 国債証券 | 5.5000 | 282,500 | 262,371 | 109,959 | 2025/06/24 | |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 18銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 3,237,000 | 2,630,825 | 1,102,573 | |
| ウルグアイ | Uruguay Government International Bond | 国債証券 | 8.5000 | 2,800 | 2,669 | 10,283 | 2028/03/15 |
| | Uruguay Government International Bond | 国債証券 | 8.2500 | 7,000 | 6,464 | 24,897 | 2031/05/21 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 2銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 9,800 | 9,134 | 35,180 | |
| ドミニカ共和国 | Dominican Republic International Bond | 国債証券 | 9.7500 | 11,000 | 11,231 | 29,221 | 2026/06/05 |
| | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND | 国債証券 | 13.6250 | 11,400 | 14,160 | 36,844 | 2033/02/03 |
| 通貨小計 | 銘柄数 | 2銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | 22,400 | 25,391 | 66,066 | |
| 合 計 | 銘柄数 | 335銘柄 | | | | | |
| | 金 額 | | | | | 35,778,854 | |

(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

2023年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 35,778,854 | % 92.7 |
| コール・ローン等、その他 | 2,800,304 | 7.3 |
| 投資信託財産総額 | 38,579,159 | 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=144.56円、1エジプト・ポンド=4.675円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、1フィリピン・ペソ=2.616円、1アルゼンチン・ペソ=0.557円、100チリ・ペソ=18.091円、100コロンビア・ペソ=3.494円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=29.85円、1チェコ・コルナ=6.63円、1ルーマニア・レイ=31.778円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.14円、1ペルー・ソール=39.838円、1ポーランド・ズロチ=35.492円、100ハンガリー・フォリント=41.909円、1ウルグアイ・ペソ=3.851円、1ドミニカ・ペソ=2.601円、1ユーロ=157.37円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(36,549,324千円)の投資信託財産総額(38,579,159千円)に対する比率は、94.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 38,738,464,707円 |
| コール・ローン等 | 2,190,313,164 |
| 公社債(評価額) | 35,778,854,757 |
| 未収入金 | 164,114,282 |
| 未収利息 | 547,210,845 |
| 前払費用 | 57,971,659 |
| (B) 負債 | 1,772,830,742 |
| 未払金 | 1,758,563,803 |
| 未払解約金 | 14,260,999 |
| その他未払費用 | 5,940 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 36,965,633,965 |
| 元本 | 21,584,689,967 |
| 次期繰越損益金 | 15,380,943,998 |
| (D) 受益権総口数 | 21,584,689,967口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 17,126円 |

* 期首における元本額は17,708,826,793円、当作成期間中における追加設定元本額は4,565,040,079円、同解約元本額は689,176,905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:

| | |
|--|----------------|
| 新興国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) | 373,663,442円 |
| ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) | 372,728,172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) | 414,298,460円 |
| D-1's 新興国債券インデックス | 65,003,129円 |
| iFree 新興国債券インデックス | 6,956,174,244円 |
| iFree 8 資産バランス | 4,233,399,046円 |
| ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用) | 2,485,607円 |
| DCダイワ新興国債券インデックスファンド | 8,989,541,355円 |
| ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券 | 139,571,080円 |
| ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド | 37,825,432円 |

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,126円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

| 項 目 | 当 期 |
|-------------------------|-----------------------|
| (A) 配当等収益 | 1,860,703,320円 |
| 受取利息 | 1,860,805,623 |
| その他収益金 | 9,515 |
| 支払利息 | △ 111,818 |
| (B) 有価証券売買損益 | 3,634,060,911 |
| 売買益 | 4,346,147,599 |
| 売買損 | △ 712,086,688 |
| (C) その他費用 | △ 23,077,157 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 5,471,687,074 |
| (E) 前期繰越損益金 | 7,871,124,665 |
| (F) 解約差損益金 | △ 348,814,676 |
| (G) 追加信託差損益金 | 2,386,946,935 |
| (H) 合計(D+E+F+G) | 15,380,943,998 |
| 次期繰越損益金(H) | 15,380,943,998 |

(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。