

ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド

運用報告書(全体版) 第8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	2016年3月22日~2026年7月3日		
運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公社債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
4 期末 (2019年 7月 5 日)	11,140	0	6.4	11,611	7.7	96.7	44
5 期末 (2020年 7月 6 日)	10,664	0	△ 4.3	11,215	△ 3.4	95.4	50
6 期末 (2021年 7月 5 日)	11,512	0	8.0	12,224	9.0	96.7	49
7 期末 (2022年 7月 5 日)	11,285	0	△ 2.0	12,123	△ 0.8	96.4	46
8 期末 (2023年 7月 5 日)	13,278	0	17.7	14,433	19.1	96.4	65

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

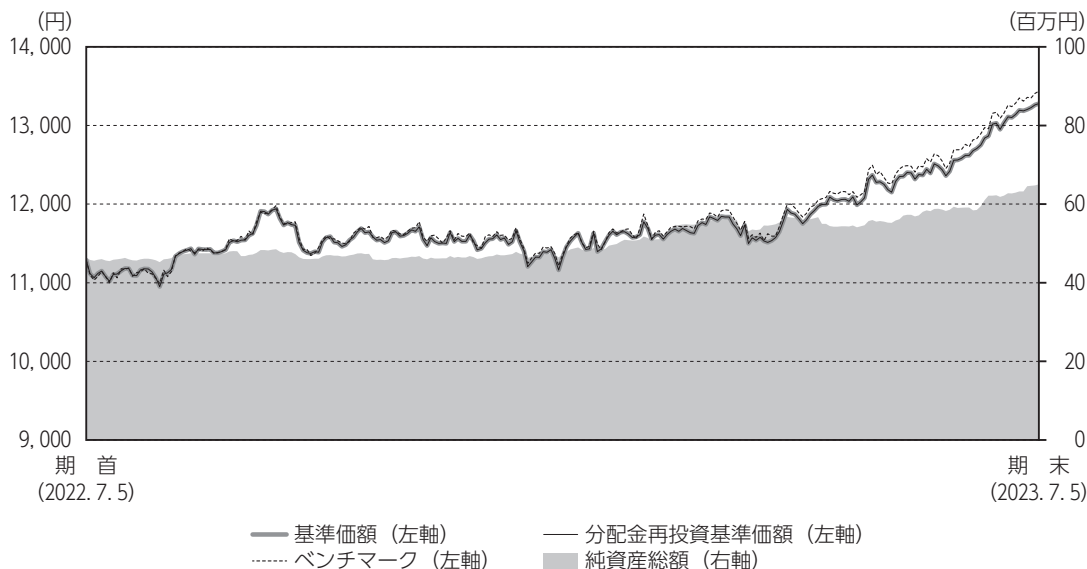
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 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：11,285円

期末：13,278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・ノーロード 新興国債券ファンド

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)2022年7月5日	11,285	—	12,123	—	96.4
7月末	11,136	△ 1.3	11,938	△ 1.5	96.7
8月末	11,521	2.1	12,396	2.3	96.5
9月末	11,394	1.0	12,221	0.8	96.4
10月末	11,638	3.1	12,535	3.4	96.3
11月末	11,606	2.8	12,494	3.1	95.8
12月末	11,310	0.2	12,216	0.8	95.3
2023年1月末	11,621	3.0	12,551	3.5	96.2
2月末	11,764	4.2	12,688	4.7	96.2
3月末	11,933	5.7	12,887	6.3	96.2
4月末	12,080	7.0	13,060	7.7	96.2
5月末	12,438	10.2	13,479	11.2	96.0
6月末	13,205	17.0	14,351	18.4	95.1
(期末)2023年7月5日	13,278	17.7	14,433	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。

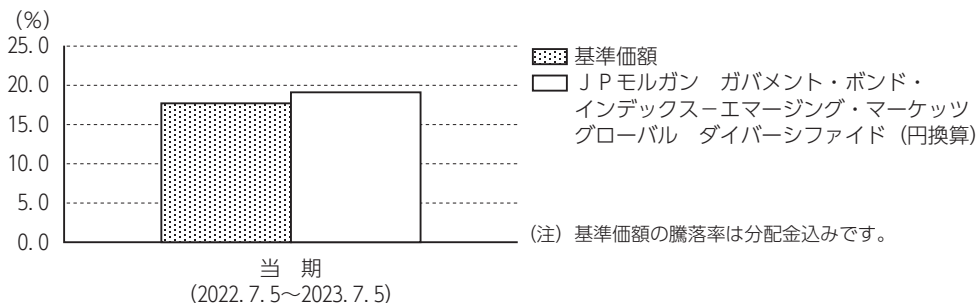
* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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	
	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）	3,277

（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	81円	0.693%	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11,759円です。
(投 信 会 社)	(39)	(0.330)	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)	(39)	(0.330)	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	10	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)	(9)	(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	92	0.778	

(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。

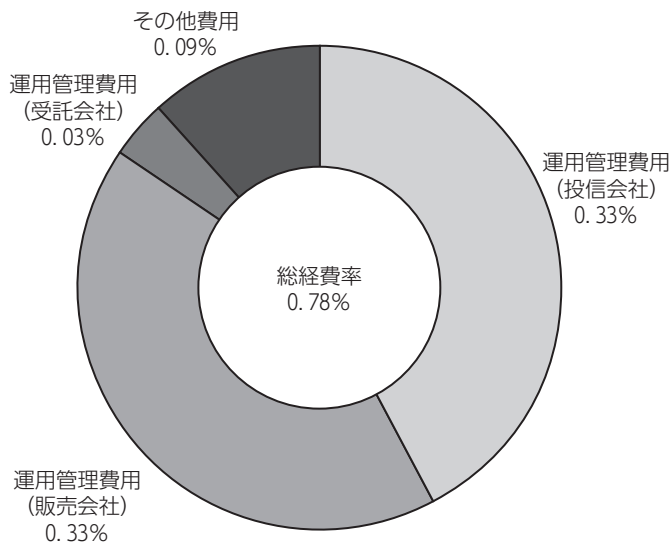
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.78%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 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	13,407	20,614	7,627	11,693

(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	当 期 末		
	□ 数 千口	□ 数 千口	評 価 額 千円
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	32,045	37,825	64,779

(注) 単位未満は切捨て。

■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

当作成期首 保有額 百万円	当作成期中 設定額 百万円	当作成期中 解約額 百万円	当作成期末 保有額 百万円	取引の理由
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。

■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 千円	比 率 %
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド	64,779	99.0
コール・ローン等、その他	678	1.0
投資信託財産総額	65,457	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	65,457,889円
コール・ローン等	586,592
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド(評価額)	64,779,834
未収入金	91,463
(B) 負債	426,275
未払解約金	234,225
未払信託報酬	189,876
その他未払費用	2,174
(C) 純資産総額(A-B)	65,031,614
元本	48,978,592
次期繰越損益金	16,053,022
(D) 受益権総口数	48,978,592口
1万口当り基準価額(C/D)	13,278円

* 期首における元本額は41,182,115円、当作成期間中における追加設定元本額は19,692,718円、同解約元本額は11,896,241円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,278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	△ 11円
支払利息	△ 11
(B) 有価証券売買損益	8,852,450
売買益	9,569,229
売買損	△ 716,779
(C) 信託報酬等	△ 357,105
(D) 当期損益金 (A + B + C)	8,495,334
(E) 前期繰越損益金	881,587
(F) 追加信託差損益金	6,676,101
(配当等相当額)	(3,916,565)
(売買損益相当額)	(2,759,536)
(G) 合計 (D + E + F)	16,053,022
次期繰越損益金 (G)	16,053,022
追加信託差損益金	6,676,101
(配当等相当額)	(3,916,565)
(売買損益相当額)	(2,759,536)
分配準備積立金	9,376,932
繰越損益金	△ 11

(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せん。

(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	7,977,820
(c) 収益調整金	6,676,101
(d) 分配準備積立金	1,399,112
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	16,053,033
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	16,053,033
(h) 受益権総口数	48,978,592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

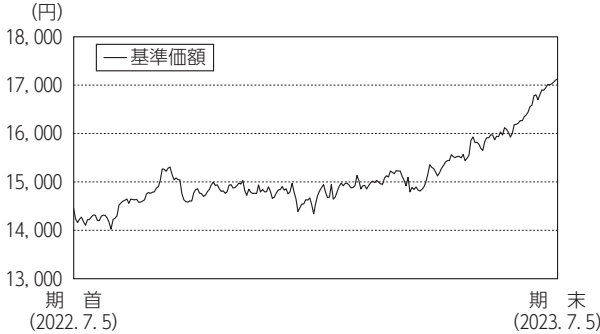
大和アセットマネジメント

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		騰落率		公社債 組 入 率
	円	%	円	%	
(期首) 2022年 7月 5日	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		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BRAZIL LETRAS DO TESOIRO 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 TESOIRO 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 TESOIRO 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	当 期				未				
	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	%	%	%	%	%
エジプト	千エジプト・ポンド 66,600	千エジプト・ポンド 54,706		255,756	0.7	0.7	0.1	0.5	0.1
トルコ	千トルコ・リラ 52,860	千トルコ・リラ 50,818		282,653	0.8	0.8	0.1	0.6	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 440,900	千メキシコ・ペソ 416,395		3,530,405	9.6	—	5.0	2.4	2.1
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,659		25,274	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 4,705,000	千チリ・ペソ 4,692,466		848,914	2.3	—	1.6	0.2	0.5
コロンビア	千コロンビア・ペソ 53,780,000	千コロンビア・ペソ 47,197,658		1,649,133	4.5	—	2.6	1.5	0.4
インドネシア	千インドネシア・ルピア 340,819,000	千インドネシア・ルピア 361,127,831		3,502,939	9.5	—	6.6	1.8	1.1
ブラジル	千ブラジル・リアル 139,540	千ブラジル・リアル 120,836		3,607,004	9.8	—	1.9	4.8	3.1
チェコ	千チェコ・コルナ 321,900	千チェコ・コルナ 286,859		1,902,136	5.1	—	3.2	1.4	0.6
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 45,250	千ルーマニア・レイ 42,438		1,348,624	3.6	—	1.7	1.2	0.7
中国	千オフショア・人民元 177,700	千オフショア・人民元 181,587		3,630,636	9.8	—	4.9	3.7	1.2
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,116,020	千ロシア・ルーブル —		—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 115,930	千マレーシア・リンギット 117,037		3,640,163	9.8	—	5.4	3.4	1.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 477,710	千南アフリカ・ランド 389,080		3,015,377	8.2	—	6.7	1.4	—
タイ	千タイ・バーツ 888,560	千タイ・バーツ 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	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 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	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千円		
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,162	5,434	2029/05/07
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	909	4,254	2024/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	2,858	13,365	2029/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,341	6,270	2025/01/14
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	3,170	14,822	2030/10/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,527	7,141	2027/10/13
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	7,670	35,860	2025/10/20
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	4,561	21,325	2028/01/05
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	18,800	15,673	73,274	2026/01/12
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	7,424	34,711	2026/04/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	816	3,818	2026/07/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	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	54,706	255,756
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	千トルコ・リラ 1,630	千トルコ・リラ 1,549	8,615	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,461	13,688	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	5,570	5,195	28,895	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,696	14,995	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	8,234	45,800	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	5,000	4,443	24,716	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	9,100	9,142	50,851	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	7,972	44,345	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	9,123	50,745	2026/09/02
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		52,860	50,818	282,653
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 47,910	406,212	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	29,300	26,825	227,443	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	39,000	37,773	320,262	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	23,000	20,475	173,599	2027/03/04

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	2036/11/20	
	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	2038/11/18	
	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	2034/11/23	
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 10,000	千フィリピン・ペソ 9,659	25,274	2036/01/14	
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 500,000	千チリ・ペソ 486,720	88,052	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	720,000	711,943	128,797	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	697,126	126,117	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	663,648	120,060	2030/09/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	937,740	169,646	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 90,000	千コロンビア・ペソ 86,933	3,037	2027/06/28	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,855,390	134,711	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	5,570,000	4,788,918	167,329	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	5,081,558	177,554	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	3,220,416	112,524	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,830,484	133,840	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	3,700,000	3,424,720	119,663	2025/11/26	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,900,000	3,951,850	138,081	2034/10/18	
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,761,600	96,493	2027/11/03	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,510,000	3,224,334	112,661	2050/10/26	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,388,482	48,514	2036/07/09	
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,575,096	159,858	2031/03/26	
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	4,500,000	4,051,350	141,558	2042/05/28	
	COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	2,500,000	2,956,525	103,303	2033/02/09	
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 11,250,000	千インドネシア・ルピア 13,028,062	126,372	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,000,000	9,216,880	89,403	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,958,205	57,794	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,923,128	76,854	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,191,500	98,857	2024/05/15	

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

		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	末 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		
	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	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	千ロシア・ルーブル 46,760	千ロシア・ルーブル —	—	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	21銘柄						
	金 額				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		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	2,800	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	40銘柄						
	金 額				115,930	117,037	3,640,163	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	65,650	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	
タイ					千タイ・パーツ	千タイ・パーツ		
		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	
ペルー					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
		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	
ポーランド					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
		Poland Government Bond	国債証券	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	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
	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	千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	2,800	2,669	10,283	2028/03/15
				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	千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,000	11,231	29,221	2026/06/05
				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	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。