

# 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)

## 運用報告書(全体版)

### 第3期

(決算日 2024年11月20日)

(作成対象期間 2023年11月21日～2024年11月20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	無期限（設定日：2022年2月18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	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

#### 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/>

設定以来の運用実績

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 分 配 込 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率		
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末(2022年11月21日)	10,053	0	0.5	10,138	1.4	96.6	2
2 期末(2023年11月20日)	12,238	0	21.7	12,242	20.8	96.3	7
3 期末(2024年11月20日)	12,985	0	6.1	13,027	6.4	97.5	10

(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らず情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 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。

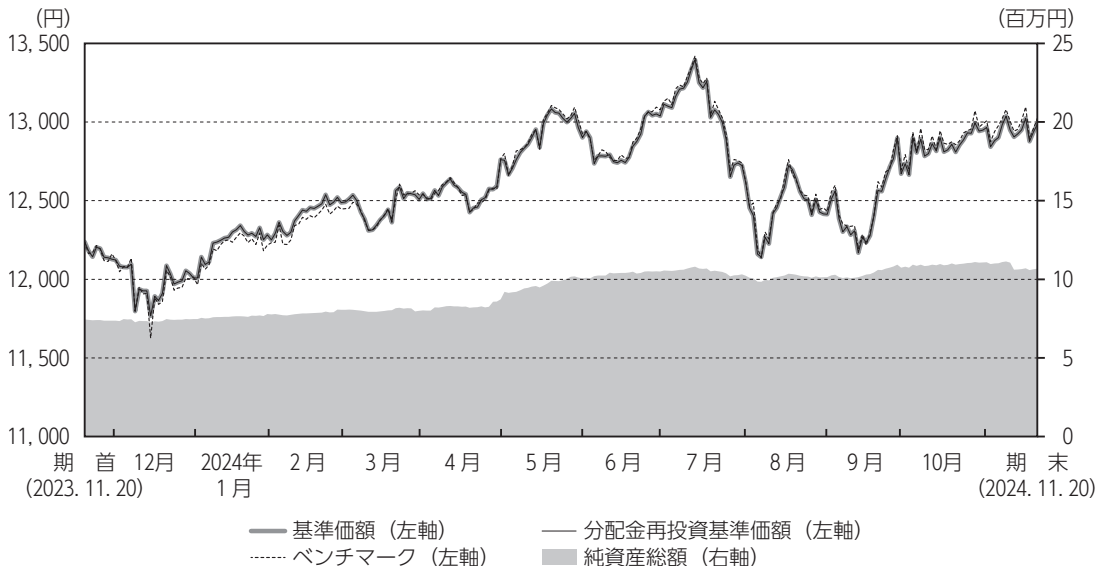
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：12,238円

期末：12,985円（分配金0円）

騰落率：6.1%（分配金込み）

#### 基準価額の変動要因

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、主に新興国債に投資した結果、投資対象国の債券価格はおおむね上昇し、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）したこともプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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）

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン デックスーエマージング・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) 2023年11月20日	12,238	—	12,242	—	96.3
11月末	12,127	△ 0.9	12,166	△ 0.6	96.6
12月末	12,008	△ 1.9	12,018	△ 1.8	96.0
2024年 1 月末	12,283	0.4	12,221	△ 0.2	96.5
2 月末	12,487	2.0	12,450	1.7	95.7
3 月末	12,508	2.2	12,540	2.4	96.3
4 月末	12,761	4.3	12,769	4.3	95.6
5 月末	12,901	5.4	12,928	5.6	94.5
6 月末	13,039	6.5	13,082	6.9	94.7
7 月末	12,614	3.1	12,624	3.1	95.8
8 月末	12,413	1.4	12,435	1.6	95.7
9 月末	12,671	3.5	12,698	3.7	96.6
10月末	12,965	5.9	13,011	6.3	96.8
(期末) 2024年11月20日	12,985	6.1	13,027	6.4	97.5

(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

（2023. 11. 21 ~ 2024. 11. 20）

## ■新興国債券市況

新興国債券市場では、タイなどを筆頭に債券価格は上昇しました。

新興国債券市場では、当作成期首より、米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下（債券価格は上昇）したことを受け、多くの新興国でも金利は低下しました。2024年2月は、米国金利の上昇（債券価格は下落）が新興国の金利上昇圧力となりましたが、国ごとの要因などから金利は国によってまちまちな動きとなりました。4月から5月にかけては、米国で利下げ期待が後退したことや、中東で地政学リスクが高まったことなどを受け、新興国の金利はおおむね上昇傾向となりました。6月から8月にかけては、米国の金利低下の影響を受けて多くの国で金利が低下しました。特に、近い将来の利下げ開始が見込まれる国や利下げ継続が見込まれる国の金利低下が目立ちました。10月以降は、11月の米国大統領選挙に向けてトランプ氏当選との観測が優勢となり、財政悪化も意識されて米国金利が上昇し、この影響を受けて、新興国債券市場においても幅広い国で金利が上昇しました。

## ■為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当作成期首より、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの思惑から円高が進行し、多くの新興国通貨は対円で下落（円高）しました。2024年2月には、日銀の副総裁がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する見通しと発言したことが円安材料となり、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。4月に入っても、日銀が緩和的な金融政策を維持したことなどが円安要因となり、新興国通貨は対円で上昇しました。6月は、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨が対円で下落し、8月から9月にかけては、低金利通貨を売って高金利通貨を買うキャリートレードの巻き戻しが発生したことから、多くの新興国通貨が対円で下落しました。当作成期末にかけては、米国金利の上昇や日銀の利上げを急がない姿勢などを受けて円安米ドル高が進行し、多くの新興国通貨が対米ドルで下落した一方、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

(2023. 11. 21 ~ 2024. 11. 20)

### ■当ファンド

「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。

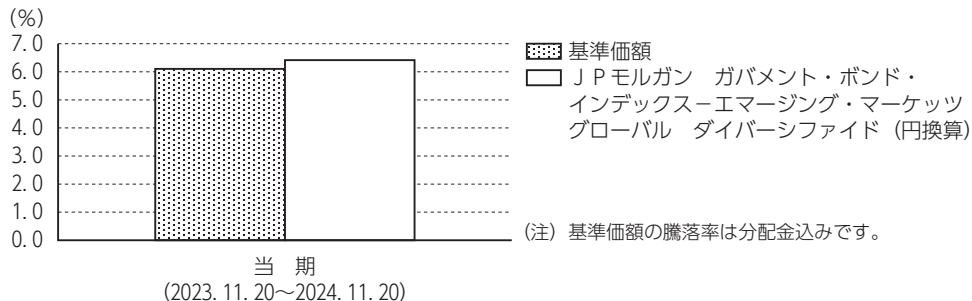
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は6.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.1%となりました。

マザーファンドで組み入れている債券ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、税金や売買に伴う費用などが主なかい離の要因です。

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JP Morgan Government Bond Index - Emerging Markets Global Diversified (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	
	2023年11月21日 ～2024年11月20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）	2,985

- （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 (2023. 11. 21～2024. 11. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	29円	0. 231%	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12, 584円です。
（投 信 会 社）	(25)	(0. 198)	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）	(1)	(0. 011)	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）	(3)	(0. 022)	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	12	0. 095	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）	(10)	(0. 080)	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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(1)	(0. 009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	41	0. 326	

(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。

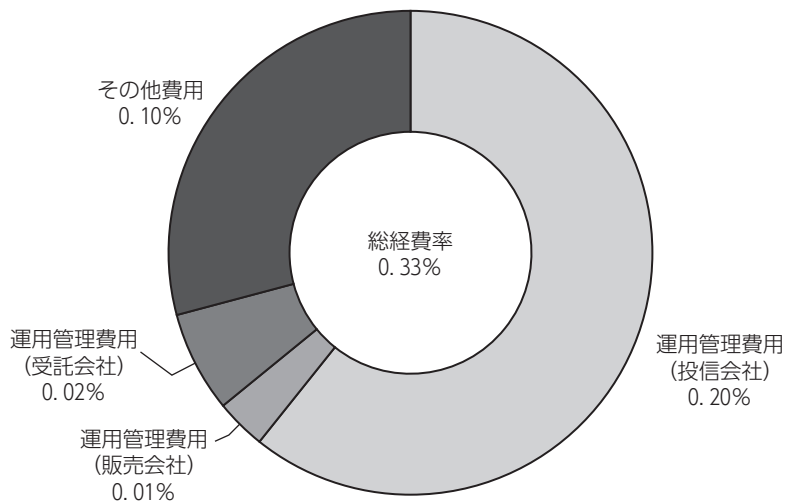
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.33%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

（2023年11月21日から2024年11月20日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	2,050	3,820	620	1,162

（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。

■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	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	□ 数	評 価 額
	□ 数	千□	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	4,122	5,552	10,643

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年11月20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	10,643	99.6
コール・ローン等、その他	44	0.4
投資信託財産総額	10,687	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、11月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.91円、100セルビア・ディナール=140.36円、1トルコ・リラ=4.494円、1メキシコ・ペソ=7.701円、1アルゼンチン・ペソ=0.154円、100チリ・ペソ=15.934円、100コロンビア・ペソ=3.526円、1インド・ルピー=1.84円、100インドネシア・ルピア=0.98円、1ブラジル・レアル=26.823円、1チェコ・コルナ=6.494円、1ルーマニア・レイ=33.001円、1オフショア・人民元=21.415円、1マレーシア・リンギット=34.667円、1南アフリカ・ランド=8.58円、1タイ・バーツ=4.49円、1ペルー・ソル=40.809円、1ポーランド・ズロチ=37.904円、100ハンガリー・フォリント=40.243円、1ウルグアイ・ペソ=3.631円、1ドミニカ・ペソ=2.57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（50,954,857千円）の投資信託財産総額（51,099,035千円）に対する比率は、99.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年11月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,687,668円
コール・ローン等	44,216
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	10,643,452
(B) 負債	12,440
未払信託報酬	12,072
その他未払費用	368
(C) 純資産総額（A－B）	10,675,228
元本	8,221,105
次期繰越損益金	2,454,123
(D) 受益権総口数	8,221,105口
1万口当り基準価額（C/D）	12,985円

\* 期首における元本額は6,087,911円、当作成期間中における追加設定元本額は3,338,409円、同解約元本額は1,205,215円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,985円です。

# 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）

## ■損益の状況

当期 自 2023年11月21日 至 2024年11月20日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	511,196円
売買益	558,137
売買損	△ 46,941
(B) 信託報酬等	△ 21,699
(C) 当期損益金 (A + B)	489,497
(D) 前期繰越損益金	733,438
(E) 追加信託差損益金	1,231,188
(配当等相当額)	( 497,507)
(売買損益相当額)	( 733,681)
(F) 合計 (C + D + E)	2,454,123
次期繰越損益金 (F)	2,454,123
追加信託差損益金	1,231,188
(配当等相当額)	( 497,507)
(売買損益相当額)	( 733,681)
分配準備積立金	1,222,935

(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	489,497
(c) 収益調整金	1,231,188
(d) 分配準備積立金	733,438
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,454,123
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,454,123
(h) 受益権総口数	8,221,105口

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2024年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年11月20日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2023年11月21日から2024年11月20日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
MEXICAN BONOS (メキシコ) 8.5% 2029/3/1	316,662	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	480,906
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7% 2026/9/3	293,492	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/7/1	414,654
BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F (ブラジル) 10% 2035/1/1	249,157	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2024/9/5	345,850
TURKEY GOVERNMENT BOND (トルコ) 26.2% 2033/10/5	243,522	Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	268,656
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 4.75% 2029/7/25	237,977	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2024/10/25	250,170
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 6% 2033/10/25	236,212	Poland Government Bond (ポーランド) 0.75% 2025/4/25	208,219
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2027/7/1	230,926	MEXICAN BONOS (メキシコ) 5% 2025/3/6	185,766
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2027/1/1	226,127	Thailand Government Bond (タイ) 1.45% 2024/12/17	178,016
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2034/11/23	216,662	THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 0.75% 2024/9/17	176,568
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7.5% 2033/5/26	215,224	BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 2.5% 2025/3/1	156,380

(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

下記は、2024年11月20日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（26,652,008千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	2024年11月20日現在						
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	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
セルビア	千セルビア・ディナール 113,000	千セルビア・ディナール 117,485	千円 164,903	% 0.3	% —	% 0.2	% 0.1	% 0.1
トルコ	千トルコ・リラ 195,540	千トルコ・リラ 155,953	700,965	1.4	1.4	0.6	0.7	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 725,650	千メキシコ・ペソ 652,991	5,029,206	9.8	—	4.9	3.2	1.7
チリ	千チリ・ペソ 5,635,000	千チリ・ペソ 5,610,651	894,034	1.7	—	1.2	0.4	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 64,540,000	千コロンビア・ペソ 56,445,611	1,990,272	3.9	—	2.8	0.7	0.4
インド	千インド・ルピー 1,352,000	千インド・ルピー 1,367,366	2,515,954	4.9	—	3.9	1.0	—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

作成期		2024年11月20日現在						
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
インドネシア	千インドネシア・ルピア 497,869,000	千インドネシア・ルピア 508,002,980	千円 4,978,429	% 9.7	% —	% 6.5	% 2.2	% 1.0
ブラジル	千ブラジル・レアル 176,950	千ブラジル・レアル 148,935	3,995,032	7.8	—	1.4	3.0	3.5
チェコ	千チェコ・コルナ 443,100	千チェコ・コルナ 417,938	2,714,262	5.3	—	3.1	1.4	0.8
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 57,350	千ルーマニア・レイ 55,238	1,822,966	3.6	—	1.7	1.2	0.7
中国	千オフショア・人民元 222,200	千オフショア・人民元 233,798	5,006,962	9.8	—	5.0	3.3	1.5
マレーシア	千マレーシア・リンギット 141,370	千マレーシア・リンギット 143,808	4,985,512	9.8	—	5.7	2.8	1.2
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 555,610	千南アフリカ・ランド 489,834	4,202,776	8.2	—	7.2	1.0	—
タイ	千タイ・バーツ 1,038,660	千タイ・バーツ 1,062,153	4,769,069	9.3	—	5.1	3.2	1.0
ペルー	千ペルー・ソル 25,580	千ペルー・ソル 25,454	1,038,796	2.0	—	1.7	0.3	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 102,510	千ポーランド・ズロチ 96,153	3,644,628	7.1	—	2.1	3.3	1.7
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,676,500	千ハンガリー・フォリント 3,247,447	1,306,876	2.6	—	1.0	0.9	0.7
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 25,800	千ウルグアイ・ペソ 25,254	91,698	0.2	—	0.2	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 43,900	千ドミニカ・ペソ 48,711	125,197	0.2	0.2	0.2	—	—
合計	—	—	49,977,546	97.8	1.6	54.5	28.7	14.6

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月20日現在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)

2024年11月20日現在								
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		
セルビア	Serbia Treasury Bonds	国債証券	% 4.5000	千セルビア・ディナール 24,000	千セルビア・ディナール 24,072	千円 33,787	2026/01/11	
	Serbia Treasury Bonds	国債証券	5.8750	25,000	26,475	37,160	2028/02/08	
	Serbia Treasury Bonds	国債証券	4.5000	35,000	34,168	47,959	2032/08/20	
	SERBIA TREASURY BONDS	国債証券	7.0000	29,000	32,770	45,996	2031/10/26	
通貨小計	銘柄数 金額	4銘柄		113,000	117,485	164,903		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	千トルコ・リラ 5,570	千トルコ・リラ 4,086	18,369	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,002	8,999	2027/02/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	5,461	24,546	2027/08/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	20,500	12,721	57,179	2028/03/08	

2024年11月20日現在

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	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000%	千トルコ・リラ 9,100	千トルコ・リラ 7,330	千円 32,947	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	13,900	7,784	34,986	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	6,311	28,369	2026/09/02
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.8000	11,500	7,648	34,376	2033/07/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.3000	23,000	15,880	71,378	2028/07/19
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	26.2000	52,000	48,609	218,485	2033/10/05
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	31.0800	39,500	38,117	171,326	2028/11/08
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金 額			195,540	155,953	700,965	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 65,500	千メキシコ・ペソ 62,262	479,537	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	44,700	36,351	279,974	2047/11/07
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	68,700	62,675	482,710	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	54,800	44,056	339,314	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	55,400	48,054	370,106	2033/05/26
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	52,000	49,611	382,098	2026/09/03
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	47,500	45,399	349,658	2029/03/01
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	57,530	54,858	422,507	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	16,890	17,123	131,881	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	54,730	52,351	403,200	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	36,600	32,660	251,543	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	67,850	61,670	474,976	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	62,620	50,417	388,308	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	40,830	35,496	273,389	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			725,650	652,991	5,029,206	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 496,460	79,108	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	970,000	913,846	145,617	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	687,462	109,544	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	1,035,000	982,204	156,510	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	720,000	704,448	112,250	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	240,264	38,285	2034/05/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	850,000	859,843	137,012	2033/04/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.2000	200,000	214,144	34,122	2040/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.8000	510,000	511,978	81,581	2029/10/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			5,635,000	5,610,651	894,034	
コロンビア	Colombian TES	国債証券	6.0000	千コロンビア・ペソ 6,320,000	千コロンビア・ペソ 5,677,129	200,175	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	5,325,928	187,792	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	4,900,000	4,433,520	156,325	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	5,300,000	4,387,764	154,712	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	600,000	594,462	20,960	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	5,900,000	4,719,587	166,412	2034/10/18

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	
	Colombian TES	国債証券	5.7500%	千コロンビア・ペソ 4,400,000	千コロンビア・ペソ 4,015,484	千円 141,585	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	6,410,000	4,274,059	150,703	2050/10/26
	Colombian TES	国債証券	6.2500	3,000,000	2,111,340	74,445	2036/07/09
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,632,930	163,357	2031/03/26
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	9,300,000	7,922,670	279,353	2042/05/28
	COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	5,200,000	5,953,376	209,916	2033/02/09
	COLOMBIAN TES	国債証券	11.5000	2,400,000	2,397,360	84,530	2046/07/25
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			64,540,000	56,445,611	1,990,272	
インド	India Government Bond	国債証券	5.8500	千インド・ルピー 48,000	千インド・ルピー 45,756	84,191	2030/12/01
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	57,000	58,510	107,659	2032/08/22
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	74,000	75,435	138,801	2033/08/14
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	46,000	46,855	86,213	2029/01/14
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.7200	33,000	35,980	66,204	2049/06/15
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.4500	36,000	35,564	65,438	2029/10/07
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1600	38,000	38,866	71,514	2050/09/20
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7900	37,000	35,340	65,025	2030/05/11
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7700	48,000	45,774	84,225	2030/08/03
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.6700	51,000	49,278	90,672	2050/12/17
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.1000	58,000	55,878	102,816	2031/07/12
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.9900	58,000	58,016	106,750	2051/12/15
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5400	53,000	52,244	96,130	2032/01/17
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	51,000	51,581	94,909	2029/04/18
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5400	57,000	59,787	110,008	2036/05/23
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3800	42,000	42,740	78,643	2027/06/20
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3600	56,000	58,380	107,419	2052/09/12
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.4100	51,000	53,037	97,588	2036/12/19
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	54,000	55,444	102,017	2033/02/06
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0600	39,000	39,442	72,574	2028/04/10
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1700	40,000	40,632	74,763	2030/04/17
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	70,000	72,843	134,031	2053/06/19
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	65,000	66,707	122,741	2037/07/24
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3700	27,000	27,568	50,725	2028/10/23
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3200	24,000	24,646	45,349	2030/11/13
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3700	8,000	8,396	15,449	2054/01/23
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	66,000	67,140	123,538	2034/04/08
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0400	29,000	29,283	53,882	2029/06/03
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0200	18,000	18,189	33,467	2031/06/18
	INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7900	18,000	18,041	33,195	2034/10/07
通貨小計	銘柄数	30銘柄					
	金 額			1,352,000	1,367,366	2,515,954	
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 15,250,000	千インドネシア・ルピア 16,771,187	164,357	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	10,000,000	10,967,200	107,478	2031/05/15



ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	7.5000	7,000,000	7,257,950	71,127	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,000,000	9,357,300	91,701	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,700,000	8,629,313	84,567	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	17,000,000	18,025,440	176,649	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	24,300,000	24,520,887	240,304	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	6,700,000	6,707,906	65,737	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	22,000,000	22,864,380	224,070	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	19,000,000	19,874,380	194,768	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	20,600,000	20,298,622	198,926	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	26,300,000	25,862,631	253,453	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	6,964,784	68,254	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	36,300,000	35,334,057	346,273	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	15,700,000	15,226,331	149,218	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	15,000,000	15,151,650	148,486	2042/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,585,790	25,340	2037/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	19,800,000	19,920,780	195,223	2033/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	16,100,000	15,955,422	156,363	2028/08/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,300,000	11,431,532	112,029	2043/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	13,000,000	13,165,750	129,024	2038/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.6250	20,000,000	19,674,000	192,805	2034/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.8750	20,200,000	20,352,914	199,458	2029/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.7500	5,500,000	5,421,350	53,129	2035/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.5000	7,500,000	7,426,650	72,781	2030/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	2,900,000	3,002,892	29,428	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,080,926	39,993	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,403,709	33,356	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	22,024,000	22,745,065	222,901	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,127,387	50,248	2032/01/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	16,030,000	16,194,628	158,707	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	16,450,000	16,229,076	159,044	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	14,075,000	13,839,666	135,628	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	26,920,000	29,512,665	289,224	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	13,020,000	14,118,757	138,363	2029/03/15
通貨小計	銘柄数 金 額	35銘柄		497,869,000	508,002,980	4,978,429	
ブラジル				千ブラジル・リアル	千ブラジル・リアル		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	19,350	18,270	490,085	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	21,400	19,450	521,725	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	11,300	9,971	267,470	2031/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	10,400	9,001	241,466	2033/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	3,850	3,279	87,967	2035/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	17,300	16,124	432,530	2025/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	28,200	24,583	659,413	2026/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	31,500	25,789	691,762	2026/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	15,900	11,502	308,530	2027/07/01

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	千ブラジル・リアル 7,150	千ブラジル・リアル 3,816	千円 102,364	2030/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	9,200	6,252	167,706	2028/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	1,400	895	24,009	2028/07/01
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			176,950	148,935	3,995,032	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	千チェコ・コルナ 26,600	千チェコ・コルナ 25,562	166,012	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	15,967	103,702	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	27,400	26,290	170,743	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	27,500	23,765	154,340	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	27,000	25,088	162,932	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	29,500	28,333	184,009	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	29,500	25,231	163,862	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	28,700	24,576	159,607	2031/03/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	15,500	12,966	84,209	2029/11/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	15,300	15,502	100,680	2036/12/04
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	29,500	25,500	165,613	2032/06/23
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	16,500	11,618	75,452	2040/04/24
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	15,700	14,971	97,229	2035/05/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	19,500	20,117	130,648	2026/02/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	26,000	27,722	180,042	2030/09/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	20,500	21,993	142,835	2028/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	14,000	11,078	71,947	2037/07/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	16,000	17,092	111,002	2034/04/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	12,000	13,015	84,528	2029/03/29
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2000	8,000	9,133	59,317	2031/06/16
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	14,300	14,851	96,450	2032/11/11
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,000	3,736	24,265	2033/03/03
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6000	4,000	3,823	24,828	2036/06/03
通貨小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			443,100	417,938	2,714,262	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	千ルーマニア・レイ 2,800	千ルーマニア・レイ 2,765	91,257	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,440	80,532	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,453	80,955	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,405	79,401	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,263	74,690	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	2,600	2,437	80,446	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,750	2,624	86,612	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,173	71,716	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,267	74,841	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	2,058	67,937	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,120	69,990	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	3,000	2,940	97,052	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,300	1,803	59,515	2036/04/28

2024年11月20日現在

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	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000%	千ルーマニア・レイ 2,000	千ルーマニア・レイ 1,951	千円 64,401	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	2,500	2,675	88,294	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	2,700	2,872	94,798	2028/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	2,700	2,822	93,161	2030/04/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	2,600	2,780	91,761	2038/02/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,400	1,419	46,833	2026/10/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	2,700	2,722	89,840	2033/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3500	2,500	2,542	83,908	2031/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,800	1,827	60,310	2027/05/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	1,400	1,400	46,219	2034/07/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.3000	1,500	1,469	48,484	2029/04/25
通貨小計	銘柄数	24銘柄					
	金 額			57,350	55,238	1,822,966	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 2,200	千オフショア・人民元 2,243	48,056	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,111	109,466	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,330	135,568	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	3,400	3,499	74,933	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,345	93,071	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	6,089	130,414	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,965	106,339	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	4,000	4,186	89,649	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	3.0200	4,000	4,063	87,023	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	3,700	3,901	83,561	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,834	146,357	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,987	85,387	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	7,448	159,513	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,243	112,287	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,547	54,551	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,486	160,319	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,599	98,507	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,885	40,368	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	2,000	2,479	53,092	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,717	79,612	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,854	61,135	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,159	67,660	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,656	78,315	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,253	48,250	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	2,000	2,397	51,350	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,633	56,390	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,760	80,539	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,791	81,193	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,144	67,347	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	1,900	1,909	40,899	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,665	35,673	2032/09/01

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	2.6200	3,300	3,433	73,534	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,281	70,282	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,393	29,839	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,908	83,694	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	3,027	64,834	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,149	67,447	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,200	3,306	70,821	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,634	56,411	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,657	56,918	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,890	83,307	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,412	73,071	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	2,200	2,589	55,458	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	2,000	2,026	43,396	2026/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,344	71,619	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	3,123	66,887	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	3,000	3,079	65,954	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	1,000	1,032	22,116	2033/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	4,500	4,560	97,656	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	1,200	1,235	26,464	2028/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	4,700	4,893	104,795	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,000	2,290	49,044	2053/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	4,000	4,130	88,460	2028/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	3,000	3,056	65,458	2026/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	2,400	2,509	53,734	2033/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	4,300	4,458	95,476	2030/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	4,000	4,051	86,761	2027/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	5,500	5,604	120,034	2034/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	800	816	17,476	2031/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,200	2,232	47,804	2029/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,514	32,427	2027/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4900	1,700	1,741	37,297	2044/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	3,900	3,947	84,535	2034/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1200	600	605	12,976	2031/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5700	2,300	2,426	51,967	2054/05/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	1,700	1,750	37,487	2054/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6200	1,000	1,004	21,509	2027/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1100	3,000	3,003	64,319	2034/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3300	500	499	10,703	2044/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8700	1,000	996	21,330	2031/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1700	3,300	3,304	70,767	2034/08/29
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	998	21,387	2039/08/29
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1900	700	683	14,648	2054/09/25
通貨小計	銘柄数 金 額	73銘柄		222,200	233,798	5,006,962	

2024年11月20日現在

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	
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 4,650	千マレーシア・リンギット 4,704	千円 163,092	2026/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,835	63,647	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	4,400	4,527	156,942	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	3,700	3,773	130,832	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,219	146,289	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	5,028	174,325	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,850	3,841	133,178	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,700	3,522	122,124	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,457	119,859	2041/09/30
	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,823	132,553	2025/10/15
	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.8040	1,100	1,099	38,106	2031/10/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	4,850	4,850	168,164	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,850	3,869	134,133	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	2,350	2,362	81,911	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	3,100	3,185	110,435	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,700	3,735	129,499	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,861	133,873	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,630	160,545	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	4,200	4,445	154,109	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	4,450	4,869	168,807	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	3,100	3,125	108,351	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	4,350	4,396	152,424	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,750	3,072	106,532	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,993	103,775	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	4,400	4,267	147,949	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,242	147,093	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	5,400	5,045	174,931	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	3,100	3,046	105,627	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	3,400	3,477	120,555	2032/10/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	4,100	4,420	153,254	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	1,000	1,036	35,922	2029/04/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	3,900	3,905	135,389	2028/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	4,500	4,613	159,941	2043/08/14
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,497	51,919	2038/03/31	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	3,600	3,697	128,195	2030/09/30	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	2,650	2,771	96,069	2053/03/31	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	2,300	2,296	79,602	2028/04/20	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4670	4,900	5,164	179,033	2039/09/15	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0540	500	504	17,501	2039/04/18	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1800	700	709	24,607	2044/05/16	
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1190	3,800	3,876	134,402	2034/11/30	
通貨小計	銘柄数 金 額	41銘柄		141,370	143,808	4,985,512	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	千南アフリカ・ランド 58,650	千南アフリカ・ランド 61,108	524,306	2026/12/21

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	6.2500%	17,720	12,738	109,298	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	10,848	93,082	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	35,040	31,027	266,213	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	78,020	62,653	537,570	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	58,800	49,810	427,370	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	63,000	60,185	516,394	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	47,700	38,541	330,682	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	59,800	55,245	474,007	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	61,700	55,917	479,771	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	49,400	41,880	359,333	2040/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	11.6250	9,500	9,876	84,743	2053/03/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			555,610	489,834	4,202,776	
タイ				千タイ・パート	千タイ・パート		
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	48,050	53,643	240,857	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	33,610	34,262	153,838	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	39,200	42,509	190,868	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	34,600	37,637	168,990	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	43,400	43,453	195,107	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	48,500	53,285	239,254	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	34,214	153,621	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	44,500	45,713	205,255	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	49,500	53,144	238,617	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	38,500	37,368	167,786	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	20,500	18,875	84,753	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	32,000	31,786	142,721	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	40,900	37,486	168,312	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	66,500	65,352	293,431	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	29,000	25,816	115,915	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	61,000	59,320	266,347	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	56,000	56,995	255,908	2028/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	48,500	52,717	236,699	2037/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	43,500	43,685	196,147	2026/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	47,000	50,900	228,541	2043/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	49,000	52,583	236,101	2033/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	50,000	50,202	225,406	2027/03/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	37,000	37,325	167,591	2029/03/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	21,000	21,677	97,329	2034/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	21,000	21,183	95,113	2027/11/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	1,013	4,550	2029/11/17
通貨小計	銘柄数	26銘柄					
	金 額			1,038,660	1,062,153	4,769,069	
ペルー				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,270	1,328	54,200	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	3,350	3,315	135,291	2032/08/12

2024年11月20日現在

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	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400%	千ペルー・ソル 2,300	千ペルー・ソル 2,364	千円 96,493	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,850	2,584	105,460	2034/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	2,100	1,754	71,582	2040/08/12
	PERU GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	3,900	4,088	166,863	2033/08/12
	PERU GOVERNMENT BOND	国債証券	7.6000	1,800	1,877	76,619	2039/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	175	185	7,572	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	4,465	4,417	180,290	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,370	3,538	144,421	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	10銘柄					
	金 額			25,580	25,454	1,038,796	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 8,190	千ポーランド・ズロチ 7,873	298,444	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	6,540	6,141	232,782	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	10,850	9,678	366,845	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	9,400	7,466	283,012	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	6,300	5,768	218,633	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,150	6,312	239,267	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,150	5,978	226,616	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	9,400	10,139	384,337	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,350	4,186	158,675	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	9,900	10,179	385,830	2033/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	6,300	6,163	233,639	2029/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	3,680	3,500	132,693	2034/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	600	590	22,368	2030/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,459	244,836	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	5,750	5,715	216,644	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			102,510	96,153	3,644,628	
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 270,000	千ハンガリー・フォリント 246,920	99,368	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	170,000	159,026	63,997	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	373,000	378,464	152,306	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	190,617	76,710	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	332,000	276,184	111,145	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	243,000	232,516	93,572	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	136,091	54,767	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	224,000	210,913	84,878	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	265,000	222,141	89,396	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	315,000	230,123	92,608	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	92,763	37,330	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	130,000	82,962	33,386	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	52,581	21,160	2034/06/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	94,676	38,100	2028/03/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	235,000	210,400	84,671	2032/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	9.5000	190,000	200,983	80,882	2026/10/21

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2024年11月20日現在

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	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND Hungary Government Bond	国債証券 国債証券	7.0000 5.5000	千ハンガリー・フォリント 90,000 137,500	千ハンガリー・フォリント 92,682 137,398	千円 37,298 55,293	2035/10/24 2025/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		3,676,500	3,247,447	1,306,876	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond Uruguay Government International Bond URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	国債証券 国債証券 国債証券	8.5000 8.2500 9.7500	千ウルグアイ・ペソ 2,800 12,000 11,000	千ウルグアイ・ペソ 2,751 11,310 11,192	9,991 41,066 40,639	2028/03/15 2031/05/21 2033/07/20
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		25,800	25,254	91,698	
ドミニカ共和国	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券 国債証券 国債証券	13.6250 11.2500 10.7500	千ドミニカ・ペソ 11,400 12,500 20,000	千ドミニカ・ペソ 13,785 13,705 21,220	35,432 35,225 54,539	2033/02/03 2035/09/15 2036/06/01
通貨小計	銘柄数 金 額	3銘柄		43,900	48,711	125,197	
合 計	銘柄数 金 額	376銘柄				49,977,546	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月20日現在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

## 運用報告書 第14期（決算日 2024年7月5日）

（作成対象期間 2023年7月6日～2024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

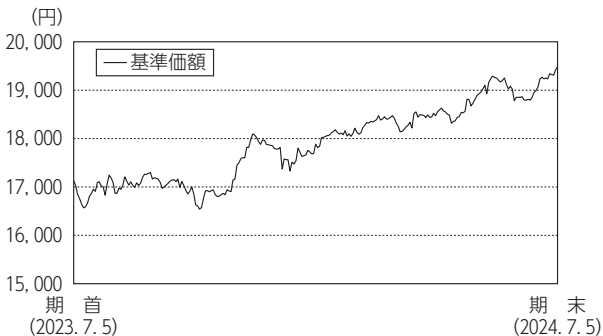
## 大和アセットマネジメント

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》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：17,126円 期末：19,484円 騰落率：13.8%

【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

新興国債券市場では、金利は国によってまちまちの動きとなりました。

新興国債券市況は、当作成期首より、米国金利の上昇（債券価格は下落）が金利上昇圧力となりましたが、国によってまちまちな動きとなりました。2023年10月は、ブラジルでは、ルラ大統領が財政健全化を軽視する発言をしたことから財政悪化懸念が高まり、金利は上昇しました。年末にかけては、米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下（債券価格は上昇）したことなどをを受け、多くの国で金利は低下しました。2024年に入り、米国の早期利下げ期待の後退を受けた米国金利の上昇が新興国の金利上昇圧力となりましたが、国ごとの個別要因などから、金利は国によってまちまちな動きとなりました。その後は、当作成期末にかけて米国金利低下の影響を受け、新興国全体では金利が低下しました。

○ 為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当作成期首より、F R B（米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する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。2023年8月には、米国の金融引き締めの長期化観測から米国金利が上昇し、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。10月から年末にかけても、米国の金融引き締め観測の後退が通貨への上昇圧力となり、続伸しました。2024年に入り、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことなどで円安が進行し、ポーランド・ズロチや南アフリカ・ランドなどを筆頭に、対円で上昇しました。3月以降も、日銀が大規模な金融緩和を終了した後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことなどをを受け、新興国通貨は対円で上昇基調が継続しました。しかし当作成期末にかけては、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨などが対円で下落（円高）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12.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.8%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。当ファンドが保有するロシア国債の評価額を0としていましたが、当作成期中に時価で売却できたことなどがプラスに寄与しました。

\*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・エマーゼン・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・エマーゼン・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) 2023年7月5日	円 17,126	% —	円 18,554	% —	% 96.8
7月末	17,067	△ 0.3	18,480	△ 0.4	96.8
8月末	17,297	1.0	18,775	1.2	96.0
9月末	16,904	△ 1.3	18,293	△ 1.4	96.2
10月末	16,907	△ 1.3	18,364	△ 1.0	96.6
11月末	17,859	4.3	19,177	3.4	96.9
12月末	17,686	3.3	18,944	2.1	96.3
2024年1月末	18,096	5.7	19,263	3.8	96.8
2月末	18,401	7.4	19,625	5.8	95.9
3月末	18,435	7.6	19,768	6.5	96.6
4月末	18,814	9.9	20,128	8.5	95.8
5月末	19,024	11.1	20,378	9.8	94.8
6月末	19,232	12.3	20,622	11.1	94.9
(期末) 2024年7月5日	19,484	13.8	20,870	12.5	97.8

(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・エマーゼン・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・エマーゼン・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・エマーゼン・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。

《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)	15 ( 14)
(その他)	( 1)
合 計	15

(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

(2023年 7 月 6 日から2024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 26, 271	千エジプト・ポンド 77, 570 ( —)
	トルコ	千トルコ・リラ 114, 613	千トルコ・リラ 1, 407 ( —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 235, 031	千メキシコ・ペソ 78, 584 ( —)
	フィリピン	千フィリピン・ペソ —	千フィリピン・ペソ 9, 310 ( —)
	チリ	千チリ・ペソ 1, 069, 595	千チリ・ペソ 217, 205 ( —)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 12, 195, 367	千コロンビア・ペソ 5, 204, 464 ( —)
	国	インド	千インド・ルピー 250, 348
インドネシア		千インドネシア・ルピア 177, 819, 828	千インドネシア・ルピア 25, 406, 325 ( —)
ブラジル		千ブラジル・リアル 71, 473	千ブラジル・リアル 42, 777 ( —)

		買 付 額	売 付 額	
外	チェコ	千チェコ・コルナ 154, 238	千チェコ・コルナ 17, 014 ( —)	
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 19, 760	千ルーマニア・レイ 6, 222 ( —)	
	中国	千オフショア・人民元 55, 565	千オフショア・人民元 20, 581 ( —)	
	ロシア	千ロシア・ルーブル —	千ロシア・ルーブル 314, 682 ( —)	
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 38, 169	千マレーシア・リンギット 11, 777 ( —)	
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 123, 287	千南アフリカ・ランド 45, 297 ( —)	
	タイ	千タイ・バーツ 293, 278	千タイ・バーツ 143, 105 ( —)	
	ペルー	千ペルー・ソル 7, 105	千ペルー・ソル 3, 851 ( —)	
	国	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 29, 506	千ポーランド・ズロチ 12, 123 ( —)
		ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 724, 731	千ハンガリー・フォリント 309, 925 ( —)
ウルグアイ		千ウルグアイ・ペソ 16, 146	千ウルグアイ・ペソ — ( —)	
	ドミニカ	千ドミニカ・ペソ 12, 879	千ドミニカ・ペソ 10, 798 ( —)	

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

当 期		期 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2027/7/1	335,554	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	480,906
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 6% 2033/10/25	319,054	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/7/1	414,654
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7% 2026/9/3	313,690	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2024/9/5	345,850
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2027/1/1	274,848	Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	268,656
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7.5% 2033/5/26	266,269	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2024/10/25	250,170
MEXICAN BONOS (メキシコ) 5.5% 2027/3/4	264,642	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25	197,143
MEXICAN BONOS (メキシコ) 8.5% 2029/3/1	257,259	Thailand Government Bond (タイ) 1.45% 2024/12/17	178,016
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	239,547	THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 0.75% 2024/9/17	176,568
BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F (ブラジル) 10% 2035/1/1	232,872	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2024/3/15	148,644
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.875% 2035/2/28	228,890	ARAB REP EGYPT (エジプト) 14.06% 2026/1/12	144,467

(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				期 末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	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
		千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	180,230	154,349	762,318	1.5	1.5	0.6	0.8	0.1	
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ							
メキシコ	623,950	553,665	4,938,307	9.9	—	4.9	3.7	1.3	
	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ							
チリ	5,555,000	5,387,353	927,556	1.9	—	1.3	0.1	0.5	
	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ							
コロンビア	62,640,000	53,549,290	2,108,289	4.2	—	2.9	1.2	0.2	
	千インド・ルピー	千インド・ルピー							
インド	250,000	250,436	485,846	1.0	—	0.8	0.1	—	
	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	488,969,000	495,964,825	4,910,051	9.8	—	6.3	2.6	0.9	
	千ブラジル・リアル	千ブラジル・リアル							
ブラジル	179,650	152,187	4,467,944	8.9	—	1.5	3.5	4.0	
	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ							
チェコ	467,100	435,080	3,016,847	6.0	—	3.6	1.3	1.2	
	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ							
ルーマニア	58,300	56,761	1,988,036	4.0	—	2.0	1.1	0.8	
	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元							
中国	212,300	221,406	4,892,292	9.8	—	4.5	3.7	1.6	
	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	141,570	143,898	4,924,200	9.8	—	5.8	2.9	1.2	
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド							
南アフリカ	575,710	487,914	4,308,281	8.6	—	7.4	1.2	—	
	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ							
タイ	1,035,660	1,038,378	4,568,866	9.1	—	5.0	3.1	1.1	
	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル							
ペルー	26,330	25,739	1,092,820	2.2	—	1.6	0.6	—	

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			未 期			
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比率	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
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 104,180	千ポーランド・ズロチ 96,204	千円 3,914,876	% 7.8	% —	% 3.1	% 3.5	% 1.3
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,718,500	千ハンガリー・フォリント 3,200,150	1,419,273	2.8	—	1.1	1.1	0.7
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 25,800	千ウルグアイ・ペソ 24,884	99,942	0.2	—	0.2	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 23,900	千ドミニカ・ペソ 26,733	72,895	0.1	0.1	0.1	—	—
合計	—	—	48,898,647	97.8	1.7	52.7	30.3	14.8

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千円		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	千トルコ・リラ 2,690	千トルコ・リラ 2,219	10,963	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	5,570	3,991	19,711	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	1,986	9,812	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	5,995	29,611	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	20,500	13,718	67,753	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	9,100	7,041	34,779	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	13,900	8,618	42,563	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	6,552	32,362	2026/09/02
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.8000	11,500	8,663	42,788	2033/07/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.3000	18,000	13,828	68,295	2028/07/19
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	26.2000	42,000	42,924	211,997	2033/10/05
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	31.0800	36,500	38,810	191,679	2028/11/08
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		180,230	154,349	762,318	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 56,400	千メキシコ・ペソ 52,281	466,315	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	40,400	32,821	292,743	2047/11/07
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	58,000	51,739	461,479	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	20,200	19,536	174,249	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	42,500	34,113	304,268	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	49,900	42,703	380,889	2033/05/26
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	38,500	35,820	319,489	2026/09/03
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	30,500	28,630	255,368	2029/03/01
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	51,030	47,559	424,201	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	12,890	12,941	115,427	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	45,730	42,991	383,455	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	33,100	29,214	260,574	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	61,850	55,071	491,196	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	55,120	44,298	395,109	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	27,830	23,941	213,537	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		623,950	553,665	4,938,307	

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		当 期		末		償 還 年 月 日
										評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
										千 千 円	千 千 円			
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	千チリ・ペソ	498,405	千円	85,811	2026/03/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	970,000	千チリ・ペソ	884,746	千円	152,329	2035/03/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	千チリ・ペソ	622,269	千円	107,138	2043/01/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	915,000	千チリ・ペソ	855,845	千円	147,353	2030/09/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	千チリ・ペソ	986,070	千円	169,774	2025/03/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	270,000	千チリ・ペソ	262,726	千円	45,234	2028/10/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	千チリ・ペソ	234,176	千円	40,318	2034/05/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	850,000	千チリ・ペソ	841,763	千円	144,928	2033/04/01				
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.2000	200,000	千チリ・ペソ	201,350	千円	34,667	2040/10/01				
通貨小計	銘柄数	9銘柄												
	金 額				5,555,000		5,387,353		927,556					
コロンビア		Colombian TES	国債証券	6.0000	6,320,000	千コロンビア・ペソ	5,541,818	千円	218,186	2028/04/28				
		Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	千コロンビア・ペソ	5,219,622	千円	205,501	2026/08/26				
		Colombian TES	国債証券	7.7500	4,900,000	千コロンビア・ペソ	4,352,082	千円	171,345	2030/09/18				
		Colombian TES	国債証券	7.0000	5,300,000	千コロンビア・ペソ	4,320,295	千円	170,094	2032/06/30				
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,400,000	千コロンビア・ペソ	2,331,408	千円	91,789	2025/11/26				
		Colombian TES	国債証券	7.2500	5,900,000	千コロンビア・ペソ	4,643,182	千円	182,806	2034/10/18				
		Colombian TES	国債証券	5.7500	4,400,000	千コロンビア・ペソ	3,898,576	千円	153,490	2027/11/03				
		Colombian TES	国債証券	7.2500	6,410,000	千コロンビア・ペソ	4,156,564	千円	163,648	2050/10/26				
		Colombian TES	国債証券	6.2500	3,000,000	千コロンビア・ペソ	2,064,540	千円	81,283	2036/07/09				
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	千コロンビア・ペソ	4,544,910	千円	178,937	2031/03/26				
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	8,400,000	千コロンビア・ペソ	6,995,604	千円	275,423	2042/05/28				
		COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	4,800,000	千コロンビア・ペソ	5,480,688	千円	215,780	2033/02/09				
通貨小計	銘柄数	12銘柄												
	金 額				62,640,000		53,549,290		2,108,289					
インド		India Government Bond	国債証券	5.8500	14,000	千インド・ルピー	13,153	千円	25,516	2030/12/01				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	18,000	千インド・ルピー	18,231	千円	35,368	2032/08/22				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	25,000	千インド・ルピー	25,229	千円	48,944	2033/08/14				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	14,000	千インド・ルピー	14,147	千円	27,447	2029/01/14				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1600	14,000	千インド・ルピー	14,140	千円	27,431	2050/09/20				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7700	14,000	千インド・ルピー	13,142	千円	25,495	2030/08/03				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.1000	18,000	千インド・ルピー	17,073	千円	33,121	2031/07/12				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.9900	18,000	千インド・ルピー	17,874	千円	34,675	2051/12/15				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5400	18,000	千インド・ルピー	18,727	千円	36,331	2036/05/23				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.4100	18,000	千インド・ルピー	18,556	千円	35,999	2036/12/19				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0600	13,000	千インド・ルピー	13,031	千円	25,282	2028/04/10				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1700	14,000	千インド・ルピー	14,091	千円	27,337	2030/04/17				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	25,000	千インド・ルピー	25,757	千円	49,970	2053/06/19				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	22,000	千インド・ルピー	22,269	千円	43,201	2037/07/24				
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0400	5,000	千インド・ルピー	5,011	千円	9,723	2029/06/03				
通貨小計	銘柄数	15銘柄												
	金 額				250,000		250,436		485,846					
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	15,250,000	千インドネシア・ルピア	16,667,030	千円	165,003	2036/05/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	10,000,000	千インドネシア・ルピア	10,918,000	千円	108,088	2031/05/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,000,000	千インドネシア・ルピア	7,179,550	千円	71,077	2032/08/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,800,000	千インドネシア・ルピア	11,159,100	千円	110,475	2038/05/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,700,000	千インドネシア・ルピア	8,577,569	千円	84,917	2039/04/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	17,000,000	千インドネシア・ルピア	17,873,970	千円	176,952	2029/05/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	24,300,000	千インドネシア・ルピア	24,357,105	千円	241,135	2030/09/15				
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	19,700,000	千インドネシア・ルピア	19,676,360	千円	194,795	2025/06/15				

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	7.5000	22,000,000	22,700,040	224,730	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	20,500,000	21,258,910	210,463	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	18,100,000	17,746,145	175,686	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	26,300,000	25,592,004	253,360	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	6,849,371	67,808	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	36,300,000	34,932,579	345,832	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	15,700,000	15,071,843	149,211	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	15,000,000	15,002,100	148,520	2042/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,545,182	25,197	2037/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	19,800,000	19,783,566	195,857	2033/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	16,100,000	15,878,947	157,201	2028/08/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,300,000	11,308,588	111,955	2043/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,000,000	11,050,930	109,404	2038/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.6250	14,500,000	14,057,025	139,164	2034/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.8750	16,500,000	16,456,935	162,923	2029/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	6,400,000	6,715,392	66,482	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,079,116	40,383	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,380,483	33,466	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	20,024,000	20,722,437	205,152	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,085,112	50,342	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	16,030,000	16,154,873	159,933	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	16,450,000	16,080,533	159,197	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	14,075,000	13,684,559	135,477	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	26,920,000	29,361,644	290,680	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	13,020,000	14,057,824	139,172	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金額			488,969,000	495,964,825	4,910,051	
				千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	21,650	20,950	615,053	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	22,400	21,025	617,256	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	11,100	10,124	297,250	2031/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	10,400	9,338	274,147	2033/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	3,100	2,755	80,895	2035/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	17,300	15,588	457,649	2025/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	29,700	25,215	740,290	2026/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	33,500	26,863	788,675	2026/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	15,900	11,335	332,795	2027/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	5,600	2,956	86,797	2030/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	9,000	6,033	177,132	2028/01/01
通貨小計	銘柄数	11銘柄					
	金額			179,650	152,187	4,467,944	
				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	26,600	25,119	174,178	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	24,100	23,631	163,857	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	27,400	25,851	179,251	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	27,500	23,187	160,871	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	31,500	28,649	198,653	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	29,500	27,883	193,345	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	29,500	24,766	171,728	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	28,700	24,010	166,488	2031/03/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	15,500	12,605	87,408	2029/11/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	15,300	15,318	106,215	2036/12/04
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	29,500	24,898	172,644	2032/06/23
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	17,196	119,238	2025/02/14

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	1.5000	16,500	11,318	78,481	2040/04/24
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	15,700	14,769	102,412	2035/05/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	19,500	20,132	139,600	2026/02/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	26,000	27,414	190,095	2030/09/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	20,500	21,778	151,011	2028/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	14,000	10,829	75,093	2037/07/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	16,000	16,927	117,374	2034/04/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	14,000	15,071	104,509	2029/03/29
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2000	8,000	9,036	62,658	2031/06/16
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	14,300	14,683	101,818	2032/11/11
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		467,100	435,080	3,016,847	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	千ルーマニア・レイ 2,450	千ルーマニア・レイ 2,431	85,156	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,771	97,076	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,451	85,861	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,451	85,855	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,407	84,317	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,248	78,747	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	2,600	2,439	85,440	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,750	2,611	91,478	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,192	76,783	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,300	80,577	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	2,053	71,905	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,148	75,259	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	3,000	2,988	104,678	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,300	1,833	64,226	2036/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,937	67,857	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	3,100	3,375	118,207	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	2,700	2,928	102,585	2028/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	2,700	2,877	100,795	2030/04/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	2,600	2,847	99,734	2038/02/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,400	1,429	50,083	2026/10/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	2,300	2,370	83,013	2033/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3500	2,500	2,602	91,138	2031/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,800	1,844	64,613	2027/05/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	1,000	1,018	35,666	2034/07/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.3000	200	199	6,975	2029/04/25
通貨小計	銘柄数 金 額	25銘柄		58,300	56,761	1,988,036	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 3,700	千オフショア・人民元 3,785	83,655	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,078	112,223	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,275	138,662	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,952	109,432	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,342	95,955	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	6,021	133,060	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,941	109,187	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	4,000	4,123	91,106	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,521	144,110	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,129	157,536	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,250	116,024	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,761	149,400	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,992	88,224	2026/03/11



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	千円	千円	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	7,171	158,461	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,206	115,036	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,447	54,073	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,391	163,335	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,591	101,456	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,867	41,265	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	2,000	2,379	52,569	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,668	81,057	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,838	62,728	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,114	68,809	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,623	80,071	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,239	49,479	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	2,000	2,302	50,877	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,593	57,303	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,723	82,265	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,770	83,313	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,095	68,401	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,923	86,699	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,640	36,245	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,396	75,041	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,254	71,921	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,334	29,484	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,855	85,183	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	3,026	66,876	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,112	68,773	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,200	3,278	72,450	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,631	58,146	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,620	57,894	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,836	84,776	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,378	74,652	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	2,200	2,509	55,441	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,309	73,123	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	3,082	68,122	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	3,000	3,046	67,326	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	1,000	1,017	22,483	2033/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	4,500	4,543	100,389	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	4,700	4,824	106,594	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,000	2,222	49,102	2053/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	4,000	4,088	90,351	2028/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	3,000	3,043	67,247	2026/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	2,400	2,472	54,641	2033/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	4,300	4,403	97,311	2030/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	4,000	4,025	88,945	2027/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	5,500	5,519	121,962	2034/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,502	33,206	2027/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	1,300	1,303	28,808	2034/05/25
通貨小計	銘柄数	59銘柄					
	金 額			212,300	221,406	4,892,292	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	4,650	4,712	161,253	2026/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,837	62,886	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	4,400	4,527	154,918	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,916	65,598	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	3,700	3,778	129,285	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,221	144,463	2026/03/31

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		
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	5,013	171,554	2030/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	4,450	4,435	151,769	2027/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,700	3,521	120,513	2036/07/15	
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,443	117,849	2041/09/30	
	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,832	131,140	2025/10/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	3,650	3,648	124,837	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,850	3,868	132,396	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,350	4,383	150,008	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	3,100	3,185	109,018	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	4,300	4,347	148,781	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,864	132,242	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,633	158,565	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	2,800	2,811	96,219	2025/03/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	4,200	4,454	152,430	2033/11/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	4,450	4,874	166,821	2038/06/08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	3,500	3,534	120,935	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	4,350	4,397	150,486	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,750	3,045	104,230	2048/07/06	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,990	102,325	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	4,400	4,246	145,308	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,193	143,508	2050/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	4,400	4,097	140,203	2031/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	3,100	3,044	104,178	2032/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	3,400	3,481	119,141	2032/10/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	4,100	4,406	150,794	2042/10/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	1,000	1,037	35,498	2029/04/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	3,900	3,897	133,384	2028/07/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	3,500	3,579	122,487	2043/08/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,501	51,379	2038/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	3,600	3,697	126,522	2030/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	3,150	3,273	112,017	2053/03/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	2,300	2,294	78,516	2028/04/20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4670	4,900	5,159	176,572	2039/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1800	700	705	24,154	2044/05/16	
通貨小計	銘柄数 金 額	40銘柄		141,570	143,898	4,924,200		
南アフリカ				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド			
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	66,150	68,875	608,169	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	17,720	12,023	106,171	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	10,163	89,744	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	35,040	29,686	262,132	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	82,020	62,433	551,288	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	58,800	47,072	415,648	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	67,200	62,228	549,478	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	47,700	36,542	322,674	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	64,200	56,605	499,823	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	61,700	53,160	469,409	2035/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	49,400	39,707	350,619	2040/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	11.6250	9,500	9,413	83,121	2053/03/31	
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		575,710	487,914	4,308,281		
タイ				千タイ・バーツ	千タイ・バーツ			
	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	48,050	53,383	234,885	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	37,610	38,393	168,931	2025/12/12	

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		
			%	千タイ・パーツ	千タイ・パーツ	千円		
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	39,200	41,807	183,955	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	34,600	36,508	160,636	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	48,400	48,129	211,769	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	48,500	52,386	230,499	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	32,123	141,344	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	44,500	45,324	199,428	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	56,500	58,875	259,051	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	38,500	36,768	161,780	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	20,500	18,254	80,318	2035/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	43,000	42,440	186,738	2025/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	40,900	36,214	159,341	2035/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	66,500	63,812	280,776	2031/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	29,000	24,458	107,615	2042/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	61,000	58,617	257,918	2027/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	56,000	56,510	248,647	2028/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	48,500	51,153	225,077	2037/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	43,500	43,491	191,363	2026/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	39,000	40,194	176,857	2043/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	49,000	51,612	227,093	2033/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	50,000	49,835	219,274	2027/03/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	37,000	36,880	162,272	2029/03/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	21,000	21,202	93,289	2034/06/17	
通貨小計	銘柄数	24銘柄						
	金 額			1,035,660	1,038,378	4,568,866		
				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,270	2,334	99,108	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	3,350	3,231	137,222	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	3,400	3,420	145,208	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,850	2,516	106,826	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,500	1,211	51,436	2040/08/12	
	PERU GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	3,900	4,001	169,874	2033/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	725	767	32,589	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	4,465	4,284	181,920	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,870	3,971	168,633	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			26,330	25,739	1,092,820		
				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	9,190	8,712	354,522	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	6,540	6,016	244,825	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	10,850	9,468	385,321	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	5,550	5,380	218,944	2025/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	9,400	7,271	295,900	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	6,300	5,627	229,003	2026/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,150	6,166	250,917	2032/04/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,150	5,885	239,510	2027/05/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	9,400	10,054	409,141	2028/07/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,350	4,083	166,174	2025/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	9,900	10,081	410,265	2033/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,800	3,661	148,992	2029/07/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,100	1,037	42,212	2034/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,318	257,110	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,550	6,439	262,034	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			104,180	96,204	3,914,876		

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		
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	270,000	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント	千円	2027/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000		240,985	106,877	2026/12/22
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	443,000		118,800	52,688	2028/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000		443,208	196,563	2030/08/21
		Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000		183,640	81,444	2031/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000		218,105	96,730	2025/11/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000		250,857	111,255	2038/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	224,000		132,697	58,851	2026/04/22
		Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000		205,266	91,036	2029/05/23
		Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	315,000		109,119	48,394	2033/04/20
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000		222,226	98,557	2026/08/26
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	240,000		90,149	39,981	2041/04/25
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000		149,834	66,451	2034/06/22
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000		50,716	22,492	2028/03/23
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	235,000		92,834	41,172	2032/11/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	9.5000	110,000		204,482	90,688	2026/10/21
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0000	90,000		116,367	51,609	2035/10/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500		90,852	40,293	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄							
	金 額			3,718,500	3,200,150	1,419,273			
ウルグアイ		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		2028/03/15
		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	12,000		2,744	11,021	2031/05/21
		URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	国債証券	9.7500	11,000		11,124	44,676	2033/07/20
通貨小計	銘柄数	3銘柄							
	金 額			25,800	24,884	99,942			
ドミニカ共和国		DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,400	千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		2033/02/03
		DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	11.2500	12,500		13,503	36,820	2035/09/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄							
	金 額			23,900	26,733	72,895			
合 計		銘柄数	336銘柄						
	金 額					48,898,647			

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	48,898,647千円	95.9%
コール・ローン等、その他	2,095,956	4.1
投資信託財産総額	50,994,603	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=161.17円、1エジプト・ポンド=3.352円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100チリ・ペソ=17.217円、100コロンビア・ペソ=3.937円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1チエコ・コルナ=6.934円、1ルーマニア・レイ=35.024円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円、1ペルー・ソール=42.457円、1ポーランド・ズロチ=40.693円、100ハンガリー・フォリント=44.35円、1ウルグアイ・ペソ=4.016円、1ドミニカ・ペソ=2.726円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(49,724,916千円)の投資信託財産総額(50,994,603千円)に対する比率は、97.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>51,284,109,571円</b>
コール・ローン等	1,283,056,398
公社債(評価額)	48,898,647,009
未収入金	305,801,413
未収利息	718,836,181
前払費用	77,768,570
<b>(B) 負債</b>	<b>1,260,233,684</b>
未払金	1,211,701,319
未払解約金	48,526,425
その他未払費用	5,940
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>50,023,875,887</b>
元本	25,673,892,724
次期繰越損益金	24,349,983,163
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>25,673,892,724口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	19,484円

\* 期首における元本額は21,584,689,967円、当作成期間中における追加設定元本額は4,952,885,960円、同解約元本額は863,683,203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)	566,573,779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)	471,719,952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)	554,580,579円
D-I's 新興国債券インデックス	68,244,463円
iFree 新興国債券インデックス	9,163,794,594円
iFree 8資産バランス	4,957,148,762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)	5,424,061円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	9,723,288,730円
スタイル9(8資産分散・保守型)	34,302円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	757,476円
スタイル9(8資産分散・積極型)	905,888円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	122,575,478円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	38,844,660円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,484円です。

■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,535,809,448円
受取利息	2,535,873,185
その他収益金	6,746
支払利息	△ 70,483
(B) 有価証券売買損益	3,178,756,572
売買益	4,353,709,694
売買損	△ 1,174,953,122
(C) その他費用	△ 35,631,088
(D) 当期損益金 (A + B + C)	5,678,934,932
(E) 前期繰越損益金	15,380,943,998
(F) 解約差損益金	△ 683,369,721
(G) 追加信託差損益金	3,973,473,954
(H) 合計 (D + E + F + G)	24,349,983,163
次期繰越損益金 (H)	24,349,983,163

(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。