

DCダイワ新興国株式 ファンダメンタル・ インデックスファンド

運用報告書(全体版) 第11期

(決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021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／株式／インデックス型 | | |
| 信託期間 | 無期限 | | |
| 運用方針 | 投資成果を FTSE RAFI エマージング インデックス (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 | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券 | |
| | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます)。 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券) | |
| 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 | | |
| 分配方針 | 分配対象額は、経費控除後の配当等収益とし、原則として、配当等収益の中から分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、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、新興国の株式に投資し、投資成果を FTSE RAFI エマージング インデックス (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 | | | FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 投資信託 証券 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 |
| 7期末(2017年7月5日) | 13,670 | 0 | 35.2 | 15,859 | 38.2 | 91.8 | — | 5.6 | 1,085 |
| 8期末(2018年7月5日) | 14,056 | 0 | 2.8 | 16,627 | 4.8 | 81.6 | 0.7 | 15.8 | 1,264 |
| 9期末(2019年7月5日) | 14,943 | 0 | 6.3 | 18,098 | 8.8 | 87.4 | 1.3 | 10.7 | 1,489 |
| 10期末(2020年7月6日) | 12,729 | 0 | △ 14.8 | 15,645 | △ 13.6 | 82.6 | 3.0 | 13.7 | 1,445 |
| 11期末(2021年7月5日) | 17,524 | 0 | 37.7 | 21,635 | 38.3 | 88.1 | 8.7 | 2.9 | 2,227 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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。

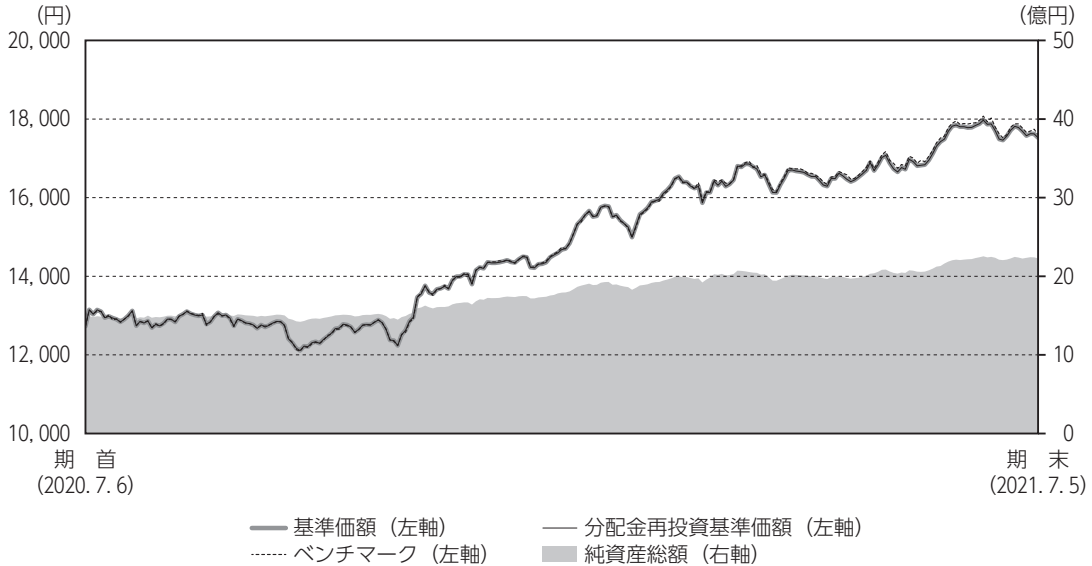
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 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 FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）です。

基準価額・騰落率

期首：12,729円

期末：17,524円（分配金0円）

騰落率：37.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。経済回復への期待から世界的な株高となる中で新興国株式市場は上昇し、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) | | 株 式 組入比率 | 株 式 先物比率 | 投資信託 証 券 組入比率 |
|------------------|---------|----------|-------------------------------------|-------|-------------|-------------|---------------------|
| | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % |
| (期首) 2020年 7月 6日 | 12,729 | — | 15,645 | — | 82.6 | 3.0 | 13.7 |
| 7月末 | 12,691 | △ 0.3 | 15,586 | △ 0.4 | 87.5 | 2.7 | 9.5 |
| 8月末 | 12,938 | 1.6 | 15,863 | 1.4 | 93.2 | 2.9 | 3.9 |
| 9月末 | 12,209 | △ 4.1 | 14,980 | △ 4.2 | 95.6 | 4.0 | 0.4 |
| 10月末 | 12,367 | △ 2.8 | 15,175 | △ 3.0 | 94.6 | 2.6 | 2.6 |
| 11月末 | 14,045 | 10.3 | 17,279 | 10.4 | 94.0 | 2.9 | 3.2 |
| 12月末 | 14,541 | 14.2 | 17,902 | 14.4 | 91.9 | 3.6 | 4.2 |
| 2021年 1月末 | 15,252 | 19.8 | 18,706 | 19.6 | 88.1 | 4.6 | 6.9 |
| 2月末 | 16,288 | 28.0 | 20,139 | 28.7 | 88.2 | 4.0 | 7.8 |
| 3月末 | 16,695 | 31.2 | 20,599 | 31.7 | 86.2 | 11.2 | 1.0 |
| 4月末 | 16,892 | 32.7 | 20,813 | 33.0 | 94.1 | 2.3 | 3.1 |
| 5月末 | 17,426 | 36.9 | 21,532 | 37.6 | 91.5 | 2.2 | 5.9 |
| 6月末 | 17,577 | 38.1 | 21,707 | 38.7 | 88.6 | 5.1 | 6.1 |
| (期末) 2021年 7月 5日 | 17,524 | 37.7 | 21,635 | 38.3 | 88.1 | 8.7 | 2.9 |

(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

(2020.7.7～2021.7.5)

■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念が継続する一方で、市場予想を上回る米国の経済指標や中国の景気持ち直しから上昇しました。その後2020年9月に入ると、高値警戒感や欧州でのウイルス感染拡大による行動制限を嫌気したことなどから、下落基調へと転換しました。11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、米国での大規模経済対策などの政策期待から上昇しました。2021年1月末から当作成期末にかけては、金利上昇に伴って軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から堅調な展開になり、当作成期は大幅な上昇となりました。

■為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円で上昇（円安）しました。

新興国の為替相場は、当作成期首から2020年12月末にかけて、緩和的な金融環境によって米国の実質金利が低下したことなどが米ドルの下落要因となり、新興国通貨高で推移しました。また、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念、米中関係の動向や追加経済対策をめぐる先行きの見通しの不透明感なども、米ドル安要因となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・連邦議会上下両院を制したことやワクチンの実用化などから市場のリスク選好姿勢が強まりました。また、FRB（米国連邦準備制度理事会）高官の量的緩和政策の縮小時期をめぐる発言が、米国の金利上昇とともに米ドル買いにつながったことで、新興国通貨は米ドルに対して横ばいの推移となりました。一方この期間の円は弱く、対円でも上昇しました。4月から当作成期末にかけては、再び米ドル安となり新興国通貨高で当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）にも一部投資します。なお、株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

ポートフォリオについて

(2020.7.7～2021.7.5)

■当ファンド

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券組入比率をおおむね100%程度に維持しました。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からETF（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

* 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 |
|---------------------------------|------------------------------|
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算） |

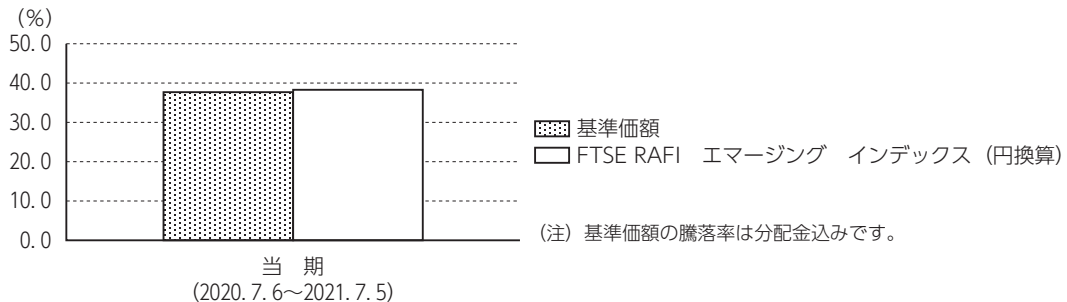
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は38.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は37.7%となりました。

配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

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FTSE RAFI エマージング インデックス (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（1万口当たり）

| 項 目 | 当 期 | |
|------------|-------------------------|-------|
| | 2020年7月7日 ～2021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） | — |
| 翌期繰越分配可能額 | （円） | 7,524 |

（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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益です。



今後の運用方針

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 (2020.7.7~2021.7.5) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|----------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 56円 | 0.373% | 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14,889円です。 |
| (投 信 会 社) | (31) | (0.206) | 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) | (21) | (0.143) | 販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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) | (0.024) | 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 | 17 | 0.112 | 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 |
| (株 式) | (12) | (0.081) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.010) | |
| (投資信託証券) | (3) | (0.021) | |
| 有 価 証 券 取 引 税 | 9 | 0.060 | 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 |
| (株 式) | (9) | (0.060) | |
| (新株予約権証券) | (0) | (0.000) | |
| (投資信託証券) | (0) | (0.000) | |
| そ の 他 費 用 | 30 | 0.202 | 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) | (20) | (0.135) | 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) | (0.005) | 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) | (9) | (0.062) | 信託事務の処理等に関するその他の費用 |
| 合 計 | 111 | 0.747 | |

(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。

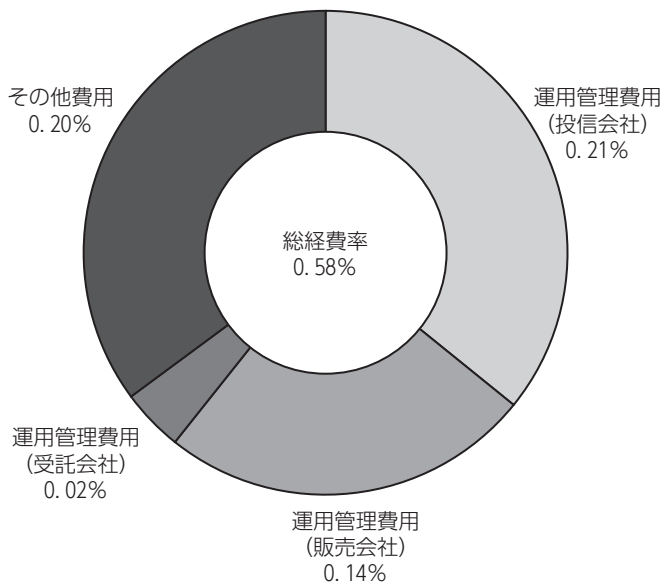
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.58%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

(2020年7月7日から2021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 |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 279,857 | 458,043 | 158,608 | 259,055 |

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------------------------|
| | ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 9,721,323千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 11,381,445千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.85 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

| 種 類 | 期 首 | | 当 期 末 | |
|---------------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|
| | □ 数 千口 | 金 額 千円 | □ 数 千口 | 評 価 額 千円 |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 1,048,944 | 1,170,193 | 2,227,345 | |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------------------|-------------|----------|
| | 評 価 額 千円 | 比 率 % |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド | 2,227,345 | 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 7,634 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 2,234,979 | 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=111.16円、1香港・ドル=14.31円、1シンガポール・ドル=82.49円、1台湾・ドル=3.97円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、100チリ・ペソ=15.112円、1サウジアラビア・リアル=29.68円、1インド・ルピー=1.50円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=21.971円、1オフショア・人民元=17.174円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・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(16,010,106千円)の投資信託財産総額(16,144,512千円)に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------------------|----------------|
| (A) 資産 | 2,234,979,983円 |
| コール・ローン等 | 5,645,453 |
| ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(評価額) | 2,227,345,470 |
| 未収入金 | 1,989,060 |
| (B) 負債 | 7,246,105 |
| 未払解約金 | 3,450,247 |
| 未払信託報酬 | 3,740,927 |
| その他未払費用 | 54,931 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,227,733,878 |
| 元本 | 1,271,244,456 |
| 次期繰越損益金 | 956,489,422 |
| (D) 受益権総口数 | 1,271,244,456口 |
| 1万口当り基準価額(C/D) | 17,524円 |

* 期首における元本額は1,135,417,833円、当作成期間中における追加設定元本額は560,626,101円、同解約元本額は424,799,478円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,524円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

| 項 目 | 当 期 |
|--------------------------------|---------------------|
| (A) 配当等収益 | △ 1,278円 |
| 受取利息 | 244 |
| 支払利息 | △ 1,522 |
| (B) 有価証券売買損益 | 492,712,191 |
| 売買益 | 582,728,670 |
| 売買損 | △ 90,016,479 |
| (C) 信託報酬等 | △ 6,767,638 |
| (D) 当期繰越損益金 (A + B + C) | 485,943,275 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 61,168,869 |
| (F) 追加信託差損益金 | 531,715,016 |
| (配当等相当額) | (442,630,569) |
| (売買損益相当額) | (89,084,447) |
| (G) 合計 (D + E + F) | 956,489,422 |
| 次期繰越損益金 (G) | 956,489,422 |
| 追加信託差損益金 | 531,715,016 |
| (配当等相当額) | (442,630,569) |
| (売買損益相当額) | (89,084,447) |
| 分配準備積立金 | 424,775,684 |
| 繰越損益金 | △ 1,278 |

(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 | 357,841,099 |
| (c) 収益調整金 | 531,715,016 |
| (d) 分配準備積立金 | 66,934,585 |
| (e) 当期分配可能額 (a + b + c + d) | 956,490,700 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配可能額 (e - f) | 956,490,700 |
| (h) 受益権総口数 | 1,271,244,456口 |

【注記】

出典：FTSE International Limited (以下、「FTSE」)® FTSE。FTSE® は、ロンドン証券取引所グループ会社が所有する商標であり、ライセンスに基づき FTSE International Limited によって使用されています。Fundamental Index® および RAFI® は Research Affiliates, LLC の登録商標です。FTSE RAFI® エマージング インデックスは Research Affiliates LLC (以下、「RAI」) と共同し FTSE International Limited (以下、「FTSE」) によって計算されます。本インデックスに関する知的財産権はすべて FTSE に帰属します。FTSE のインデックス、FTSE Ratings、またはその基礎データに関する瑕疵や不作為については、FTSE 並びにライセンス各社はいずれも一切の責任を負いません。また、書面に基づく FTSE の同意がない限り、FTSE のデータの再配信も許可されません。

Source: FTSE International Limited ("FTSE")® FTSE. "FTSE®" is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE International Limited under licence. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC. The FTSE RAFI® Emerging Index is calculated by FTSE in conjunction with Research Affiliates LLC. All intellectual property rights in the Index vest in FTSE. Neither FTSE nor its licensors accept any liability for any errors or omissions in the FTSE indices and / or FTSE ratings or underlying data. No further distribution of FTSE Data is permitted without FTSE's express written consent.

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・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FTSE RAFI エマージング インデックス (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 | 1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券) |
| 株式組入制限 | 無制限 |

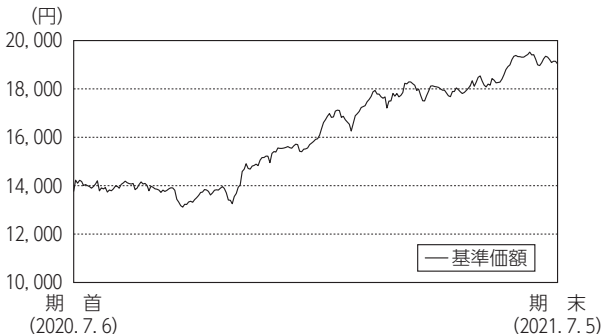
大和アセットマネジメント

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：13,774円 期末：19,034円 騰落率：38.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。経済回復への期待から世界的な株高となる中で新興国株式市況は上昇し、基準価額も上昇しました。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

○ 新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念が継続する一方で、市場予想を上回る米国の経済指標や中国の景気持ち直しから上昇しました。その後2020年9月に入ると、高値警戒感や欧州でのウイルス感染拡大による行動制限を嫌気したことなどから、下落基調へと転換しました。11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、米国の大規模経済対策などの政策期待から上昇しました。2021年1月末から当作成期末にかけては、金利上昇に伴って軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から堅調な展開になり、当作成期は大幅な上昇となりました。

○ 為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円で上昇（円安）しました。

新興国の為替相場は、当作成期首から2020年12月末にかけて、緩和的な金融環境によって米国の実質金利が低下したことなどが米ドルの下落要因となり、新興国通貨高で推移しました。また、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念、米中間味の動向や追加経済対策をめぐる先行きの見通しの不透明感なども、米ドル安要因となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・連邦議会上下両院を制したことやワクチンの実用化などから市場のリスク選好姿勢が強まりました。また、FRB（米国連邦準備制度理事会）高官の量的緩和政策の縮小時期をめぐる発言が、米国の金利上昇とともに米ドル買いにつながったことで、新興国通貨は米ドルに対して横ばいの推移となりました。一方この期間の円は弱く、対円でも上昇しました。4月から当作成期末にかけては、再び米ドル安となり新興国通貨高で当作成期末を迎えました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式（D R（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点から FTSE RAFI エマージング インデックス（配当込み、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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

◆ ポートフォリオについて

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点から E T F（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

| 年月日 | 基準価額 | | FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) | | 株 組 比 | 式 入 率 | 株 先 比 | 式 物 率 | 投資信託 証券 組入比率 |
|---------------|--------|----------|--|----------|-------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|
| | 円 | 騰落率 % | (ベンチマーク) | 騰落率 % | | | | | |
| (期首)2020年7月6日 | 13,774 | — | 15,645 | — | 82.7 | 3.0 | 3.0 | 13.8 | |
| 7月末 | 13,738 | △ 0.3 | 15,586 | △ 0.4 | 87.5 | 2.7 | 2.7 | 9.5 | |
| 8月末 | 14,010 | 1.7 | 15,863 | 1.4 | 93.2 | 2.9 | 2.9 | 3.9 | |
| 9月末 | 13,221 | △ 4.0 | 14,980 | △ 4.2 | 95.6 | 4.0 | 4.0 | 0.4 | |
| 10月末 | 13,397 | △ 2.7 | 15,175 | △ 3.0 | 94.7 | 2.6 | 2.6 | 2.6 | |
| 11月末 | 15,220 | 10.5 | 17,279 | 10.4 | 94.1 | 2.9 | 2.9 | 3.2 | |
| 12月末 | 15,763 | 14.4 | 17,902 | 14.4 | 91.9 | 3.6 | 3.6 | 4.2 | |
| 2021年1月末 | 16,539 | 20.1 | 18,706 | 19.6 | 88.1 | 4.6 | 4.6 | 6.9 | |
| 2月末 | 17,668 | 28.3 | 20,139 | 28.7 | 88.2 | 4.0 | 4.0 | 7.8 | |
| 3月末 | 18,118 | 31.5 | 20,599 | 31.7 | 86.2 | 11.2 | 11.2 | 1.0 | |
| 4月末 | 18,338 | 33.1 | 20,813 | 33.0 | 94.1 | 2.3 | 2.3 | 3.1 | |
| 5月末 | 18,921 | 37.4 | 21,532 | 37.6 | 91.5 | 2.2 | 2.2 | 5.9 | |
| 6月末 | 19,090 | 38.6 | 21,707 | 38.7 | 88.6 | 5.1 | 5.1 | 6.1 | |
| (期末)2021年7月5日 | 19,034 | 38.2 | 21,635 | 38.3 | 88.1 | 8.7 | 8.7 | 2.9 | |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス（配当込み、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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(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) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◆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38.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38.2%となりました。

配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) です。

●今後の運用方針

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■1万口当りの費用の明細

| 項 目 | 当 期 |
|-----------------|--------------|
| 売買委託手数料 (株式) | 18円 (13) |
| (新株予約権証券) | (0) |
| (先物・オプション) | (2) |
| (投資信託証券) | (3) |
| 有価証券取引税 (株式) | 10 (10) |
| (新株予約権証券) | (0) |
| (投資信託証券) | (0) |
| その他費用 (保管費用) | 32 (22) |
| (その他) | (10) |
| 合 計 | 60 |

(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

(1)株 式

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | | |
|-----|---------|----------------------------|-----------------------------------|-----------------|-----------------------|
| | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 | |
| 外 国 | アメリカ | 百株 48,920.05 (2) | 千アメリカ・ドル 5,867 (△ 95) | 百株 54,215.61 | 千アメリカ・ドル 4,625 |
| | 香港 | 百株 172,167 (486.74) | 千香港・ドル 137,155 (△ 43) | 百株 90,792.54 | 千香港・ドル 67,975 |
| | シンガポール | 百株 540 (1) | 千シンガポール・ドル 57 (1) | 百株 — | 千シンガポール・ドル — |
| | 台湾 | 百株 40,550 (304.98) | 千台湾・ドル 240,294 (△ 217) | 百株 30,847.47 | 千台湾・ドル 213,730 |
| | トルコ | 百株 10,320.93 (1) | 千トルコ・リラ 8,416 (1) | 百株 2,239.54 | 千トルコ・リラ 1,404 |
| | メキシコ | 百株 8,819 (1) | 千メキシコ・ペソ 23,420 (△ 33) | 百株 8,129.23 | 千メキシコ・ペソ 20,332 |
| | チリ | 百株 26,824.87 (2.74) | 千チリ・ペソ 303,684 (1) | 百株 23,591.85 | 千チリ・ペソ 188,530 |
| | サウジアラビア | 百株 1,226.07 (1) | 千サウジアラビア・リアル 4,176 (1) | 百株 962.7 | 千サウジアラビア・リアル 4,914 |
| | インド | 百株 15,624.43 (3.51) | 千インド・ルピー 333,172 (791) | 百株 17,150.95 | 千インド・ルピー 115,090 |
| | インドネシア | 百株 44,534 (1) | 千インドネシア・ルピア 14,948,841 (1) | 百株 — | 千インドネシア・ルピア — |
| 国 | ブラジル | 百株 29,729 (3,286.6) | 千ブラジル・リアル 61,962 (1) | 百株 1,156.89 | 千ブラジル・リアル 6,496 |
| | 中国 | 百株 23,707.07 (1) | 千オフショア・人民元 16,868 (1) | 百株 7,461.07 | 千オフショア・人民元 6,036 |
| | マレーシア | 百株 2,639 (1,796) | 千マレーシア・リンギット 1,586 (1) | 百株 991 | 千マレーシア・リンギット 744 |
| | 南アフリカ | 百株 3,281.3 (3.21) | 千南アフリカ・ランド 28,767 (△ 63) | 百株 5,065.75 | 千南アフリカ・ランド 33,160 |
| | タイ | 百株 57,946 (1) | 千タイ・バーツ 80,478 (△ 128) | 百株 4,250 | 千タイ・バーツ 8,166 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

(2) 新株予約権証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|----|----------|--------------|-------------|---------------|
| | 証 券 数 | 金 額 | 証 券 数 | 金 額 |
| 外国 | 証券 — | 千タイ・パーツ — | 証券 7,487 | 千タイ・パーツ 40 |
| タイ | (7,487) | (34) | (—) | (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未满是切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------|--------------|--------------|----------|----------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 外国 | 百万円 8,120 | 百万円 7,077 | 百万円 — | 百万円 — |
| 株式先物取引 | | | | |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未满是切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| | 買 付 | | 売 付 | |
|-------|-------------|--------------------|-------------|---------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外国 | 千口 963.6 | 千アメリカ・ドル 21,090 | 千口 1,436 | 千アメリカ・ドル 30,083 |
| アメリカ | (—) | (—) | (—) | (—) |
| メキシコ | 千口 20.2 | 千メキシコ・ペソ 343 | 千口 100.4 | 千メキシコ・ペソ 2,391 |
| | (—) | (△ 40) | (—) | (—) |
| 南アフリカ | 千口 — | 千南アフリカ・ランド — | 千口 76.93 | 千南アフリカ・ランド 1,017 |
| | (—) | (—) | (—) | (—) |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付()内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付()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4) 金額の単位未满是切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| 銘 柄 | 当 期 | | | 銘 柄 | 期 付 | | |
|-------------------------------------|------------|---------------|------------|---------------------------------------|-----------|---------------|------------|
| | 株 数 | 金 額 | 平均単価 | | 株 数 | 金 額 | 平均単価 |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島) | 千株 95.1 | 千円 313,294 | 円 3,294 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾) | 千株 155 | 千円 354,624 | 円 2,287 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾) | 549 | 241,857 | 440 | ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島) | 8.5 | 225,640 | 26,545 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾) | 103 | 175,474 | 1,703 | CHINA MOBILE LTD (香港) | 282 | 177,806 | 630 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H (中国) | 2,407 | 170,280 | 70 | BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島) | 3 | 85,509 | 28,503 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル) | 302.4 | 160,751 | 531 | VALE SA (ブラジル) | 46 | 83,384 | 1,812 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル) | 313.8 | 143,431 | 457 | CNOOC LTD (香港) | 773 | 81,115 | 104 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国) | 1,635 | 131,283 | 80 | MEDIATEK INC (台湾) | 22 | 75,353 | 3,425 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国) | 102.5 | 130,526 | 1,273 | UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾) | 410 | 73,223 | 178 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル) | 285.2 | 129,148 | 452 | CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国) | 738 | 67,886 | 91 |
| BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル) | 239.2 | 119,232 | 498 | BANK OF CHINA LTD-H (中国) | 1,371 | 56,132 | 40 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未满是切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

| 当 期 | | | | 期 末 | | | |
|-------------------------------------|-------|-----------|-------|-------------------------------------|-------|-----------|-------|
| 買 付 | | 金 額 | | 売 付 | | 金 額 | |
| 銘 柄 | 口 数 | 金 額 | 平均単価 | 銘 柄 | 口 数 | 金 額 | 平均単価 |
| | 千口 | 千円 | 円 | | 千口 | 千円 | 円 |
| INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ) | 963.6 | 2,269,015 | 2,354 | INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ) | 1,436 | 3,264,963 | 2,273 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ) | 20.2 | 1,630 | 80 | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ) | 100.4 | 12,867 | 128 |
| | | | | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ) | 76.93 | 7,549 | 98 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

| 銘 柄 | 株 数 | 金 額 | 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|---------------|-----------|-----------|---------|-----------|----------------|
| | | | 株 数 | 金 額 | | |
| | | | | | | 外貨建金額 |
| 百株 | 百株 | 千円 | 千アメリカ・ドル | 千円 | | |
| (アメリカ) | | | | | | |
| JOYY INC-ADR | — | — | 10 | 64 | 7,137 | コミュニケーション・サービス |
| NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | — | — | 52 | 39 | 4,375 | 一般消費財・サービス |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF | 337 | 290 | 181 | 20,212 | 20,212 | エネルギー |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 64 | — | — | — | — | 一般消費財・サービス |
| BAIDU INC - SPON ADR | 44 | 28 | 550 | 61,222 | 61,222 | コミュニケーション・サービス |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR | 80 | 56 | 106 | 11,808 | 11,808 | 一般消費財・サービス |
| CANADIAN SOLAR INC | 28 | 23 | 99 | 11,014 | 11,014 | 情報技術 |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR | 25 | 34 | 99 | 11,073 | 11,073 | 資本財・サービス |
| MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR | 199.5 | 353.5 | 340 | 37,841 | 37,841 | コミュニケーション・サービス |
| JD.COM INC-ADR | 82 | 78 | 594 | 66,095 | 66,095 | 一般消費財・サービス |
| NETEASE INC-ADR | 5 | 30 | 339 | 37,786 | 37,786 | コミュニケーション・サービス |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR | 56 | 93 | 330 | 36,689 | 36,689 | 一般消費財・サービス |
| VTB BANK JSC -GDR-REG S | 1,642.98 | 1,912.17 | 249 | 27,759 | 27,759 | 金融 |
| NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR | 45.6 | 72.9 | 227 | 25,331 | 25,331 | 素材 |
| TATNEFT PAO-SPONSORED ADR | 60.5 | 96.08 | 424 | 47,131 | 47,131 | エネルギー |
| SURGUTNEFTEGAS-SP ADR | 296 | 360.75 | 179 | 19,914 | 19,914 | エネルギー |
| MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR | 92.1 | 169.93 | 580 | 64,564 | 64,564 | 素材 |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | 249.7 | 206.94 | 295 | 32,894 | 32,894 | 生活必需品 |
| RUSHYDRO PJSC-ADR | 604.95 | — | — | — | — | 公益事業 |
| SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR | 811 | 1,569.77 | 2,626 | 291,931 | 291,931 | 金融 |
| NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | 12.2 | 24.98 | 561 | 62,449 | 62,449 | エネルギー |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR | 168.3 | 202.88 | 1,890 | 210,185 | 210,185 | エネルギー |
| ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR | 487 | 912.99 | 698 | 77,699 | 77,699 | エネルギー |
| GAZPROM PJSC-SPON ADR | 3,272.9 | 3,923.39 | 3,041 | 338,083 | 338,083 | エネルギー |
| SEVERSTAL - GDR REG S | 102.7 | 134.6 | 288 | 32,108 | 32,108 | 素材 |
| TATNEFT PJSC - PREF | 35.1 | 155.09 | 106 | 11,849 | 11,849 | エネルギー |
| SISTEMA PJSC | 147 | 3,192 | 137 | 15,283 | 15,283 | コミュニケーション・サービス |
| ROSSETI PJSC | 29,890 | — | — | — | — | 公益事業 |
| INTER RAO UES PJSC | 10,160 | 27,261 | 173 | 19,320 | 19,320 | 公益事業 |
| ALROSA PJSC | 791.6 | 1,803.1 | 309 | 34,354 | 34,354 | 素材 |
| MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | 362.29 | 566.19 | 131 | 14,644 | 14,644 | 金融 |
| AEROFLOT PJSC | 402.5 | 1,649.1 | 153 | 17,112 | 17,112 | 資本財・サービス |
| アメリカ・ドル通貨計 | 株 数、金 額 | 50,554.92 | 45,261.36 | 14,824 | 1,647,876 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 30 銘柄 | 29 銘柄 | | <10.2%> | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | 当 | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|--------|---------|--------|---------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | | |
| (香港) | | | | | |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H | 1,410 | — | — | — | 資本財・サービス |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 2,770 | 4,600 | 1,849 | 26,462 | 資本財・サービス |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING | 400 | 620 | 706 | 10,114 | 資本財・サービス |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 760 | 780 | 1,817 | 26,006 | 一般消費財・サービス |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT | 1,100 | — | — | — | 資本財・サービス |
| JIANGXI COPPER CO LTD-H | 750 | 510 | 801 | 11,472 | 素材 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,400 | — | — | — | 公益事業 |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 196 | 492 | 1,163 | 16,650 | 公益事業 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 17,438 | 20,798 | 8,132 | 116,369 | エネルギー |
| BEIJING ENTERPRISES HLDGS | 155 | — | — | — | 公益事業 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 1,060 | 2,460 | 1,699 | 24,324 | 一般消費財・サービス |
| GOME RETAIL HOLDINGS LTD | — | 3,540 | 350 | 5,015 | 一般消費財・サービス |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H | 980 | — | — | — | 資本財・サービス |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 135 | 290 | 932 | 13,341 | 資本財・サービス |
| FOSUN INTERNATIONAL LTD | 930 | 715 | 795 | 11,377 | 資本財・サービス |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 182 | 215 | 12,351 | 176,753 | コミュニケーション・サービス |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H | 6,920 | — | — | — | コミュニケーション・サービス |
| AIR CHINA LTD-H | 600 | 1,100 | 621 | 8,893 | 資本財・サービス |
| CHINA UNICOM HONG KONG LTD | 3,320 | — | — | — | コミュニケーション・サービス |
| SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | 470 | 605 | 1,161 | 16,622 | 不動産 |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP | 1,500 | 2,580 | 670 | 9,599 | 不動産 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDIN | 580 | — | — | — | 公益事業 |
| PETROCHINA CO LTD-H | 12,580 | 20,520 | 7,777 | 111,290 | エネルギー |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS | — | 155 | 1,079 | 15,448 | 一般消費財・サービス |
| CNOOC LTD | 5,930 | — | — | — | エネルギー |
| CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | 880 | — | — | — | 不動産 |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 3,380 | 6,120 | 1,817 | 26,010 | 公益事業 |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H | 195 | 355 | 1,444 | 20,675 | 素材 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 1,150 | 1,050 | 1,377 | 19,713 | 公益事業 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 38,110 | 47,080 | 28,577 | 408,944 | 金融 |
| CHINA MOBILE LTD | 2,150 | — | — | — | コミュニケーション・サービス |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLD | 656 | 1,242 | 1,602 | 22,927 | 金融 |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-H | 5,380 | 7,040 | 2,583 | 36,972 | 金融 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 306 | 500 | 501 | 7,169 | 金融 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 284 | 484 | 541 | 7,743 | 金融 |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 140 | 275 | 1,454 | 20,817 | 生活必需品 |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H | 2,660 | 4,750 | 2,484 | 35,549 | 金融 |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H | 700 | 760 | 364 | 5,209 | 資本財・サービス |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H | 1,420 | — | — | — | 公益事業 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-H | 1,705 | 2,450 | 3,660 | 52,378 | エネルギー |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT | 312 | 1,091.2 | 1,204 | 17,239 | ヘルスケア |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 512 | 1,028 | 2,343 | 33,540 | ヘルスケア |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 700 | 1,100 | 3,465 | 49,584 | 不動産 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 260 | — | — | — | その他 |
| YANZHOU COAL MINING CO-H | 1,000 | 1,820 | 1,856 | 26,565 | エネルギー |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 430 | 1,285 | 959 | 13,736 | ヘルスケア |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | — | 220 | 1,016 | 14,544 | 公益事業 |
| BYD CO LTD-H | 80 | 50 | 1,106 | 15,826 | 一般消費財・サービス |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 14,670 | 25,230 | 6,812 | 97,481 | 金融 |
| CHINA RESOURCES CEMENT | — | 820 | 594 | 8,507 | 素材 |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H | — | 254 | 276 | 3,961 | 金融 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 210 | 358 | 930 | 13,319 | 金融 |
| PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H | 2,120 | 3,900 | 1,014 | 14,510 | 金融 |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|------------|-----------|---------|---------|----------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千香港・ドル | 千円 | | |
| CITIC LTD | 880 | 2,150 | 1,806 | 25,843 | 資本財・サービス | |
| CHINA HONGQIAO GROUP LTD | — | 1,165 | 1,211 | 17,337 | 素材 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 30,830 | 54,900 | 24,979 | 357,456 | 金融 | |
| CHINA TOWER CORP LTD-H | 5,820 | 16,760 | 1,776 | 25,422 | コミュニケーション・サービス | |
| XIAOMI CORP-CLASS B | 916 | — | — | — | 情報技術 | |
| MEITUAN-CLASS B | 106 | 52 | 1,580 | 22,621 | 一般消費財・サービス | |
| SEAZEN GROUP LTD | — | 1,240 | 908 | 13,006 | 不動産 | |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | — | 951 | 20,161 | 288,506 | 一般消費財・サービス | |
| GUANGDONG INVESTMENT LTD | 420 | 860 | 949 | 13,586 | 公益事業 | |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-H | 2,150 | 2,150 | 380 | 5,445 | 資本財・サービス | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H | — | 250 | 673 | 9,641 | 一般消費財・サービス | |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVEST | 1,220 | 3,180 | 5,673 | 81,182 | 不動産 | |
| CRRG CORP LTD - H | 1,240 | — | — | — | 資本財・サービス | |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 3,110 | — | — | — | 資本財・サービス | |
| CGN POWER CO LTD-H | — | 4,570 | 776 | 11,117 | 公益事業 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 915 | 1,940 | 14,530 | 207,932 | 金融 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 290 | 1,040 | 2,766 | 39,587 | 不動産 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H | — | 585 | 1,172 | 16,784 | 資本財・サービス | |
| CHINA MINSHENG BANKING COR-H | 3,845.8 | 7,335.8 | 2,721 | 38,945 | 金融 | |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 2,200 | 2,440 | 2,110 | 30,202 | 不動産 | |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 70 | 60 | 1,055 | 15,102 | 一般消費財・サービス | |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 409 | 899 | 2,198 | 31,454 | 不動産 | |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 1,940 | 2,900 | 522 | 7,469 | 素材 | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H | 560 | 960 | 655 | 9,382 | 一般消費財・サービス | |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 55 | 64 | 1,223 | 17,510 | 一般消費財・サービス | |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | — | 330 | 1,504 | 21,533 | 生活必需品 | |
| PICC PROPERTY & CASUALTY-H | 2,020 | 3,600 | 2,480 | 35,494 | 金融 | |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 1,075 | 415 | 1,016 | 14,549 | 一般消費財・サービス | |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 440 | 560 | 937 | 13,414 | 資本財・サービス | |
| SUNNY OPTICAL TECH | — | 37 | 875 | 12,527 | 情報技術 | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 2,680 | 2,920 | 1,316 | 18,845 | 素材 | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 646 | 882 | 2,125 | 30,417 | 金融 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 349 | 606 | 993 | 14,221 | ヘルスケア | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 1,210 | 1,950 | 2,987 | 42,749 | 金融 | |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 100 | 132 | 1,958 | 28,031 | 公益事業 | |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 620 | 660 | 728 | 10,426 | 素材 | |
| KUNLUN ENERGY CO LTD | 1,400 | 2,020 | 1,442 | 20,639 | 公益事業 | |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H | 804 | — | — | — | 不動産 | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H | 1,140 | 620 | 648 | 9,280 | 素材 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | — | 1,280 | 670 | 9,598 | 資本財・サービス | |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 2,300 | 2,680 | 2,420 | 34,630 | 素材 | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 4,381 | 8,521 | 4,447 | 63,650 | 金融 | |
| CHINA EVERGRANDE GROUP | 800 | 1,420 | 1,428 | 20,442 | 不動産 | |
| AGILE GROUP HOLDINGS LTD | 520 | — | — | — | 不動産 | |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | — | 1,980 | 605 | 8,670 | 金融 | |
| GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 12,260 | 3,800 | 752 | 10,766 | 情報技術 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 915 | 1,010 | 6,534 | 93,511 | 金融 | |
| BANK OF CHINA LTD-H | 33,860 | 33,500 | 9,313 | 133,269 | 金融 | |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 335 | 440 | 837 | 11,988 | 金融 | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 1,600 | 2,400 | 698 | 9,994 | 金融 | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 680 | 1,272 | 859 | 12,304 | 金融 | |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | — | 940 | 686 | 9,819 | 一般消費財・サービス | |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | 300 | 580 | 2,479 | 35,481 | 不動産 | |
| 香港・ドル通貨計 | 株数、金額 | 268,387.8 | 350,249 | 250,487 | 3,584,473 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 90銘柄 | 88銘柄 | | <22.2%> | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------------------|------------|--------------|---------------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (シンガポール) | 百株 | 百株 | 千シンガポール・ドル | 千円 | |
| YANGZHIJIANG SHIPBUILDING | 887 | 1,427 | 205 | 16,950 | 資本財・サービス |
| シンガポール・ドル通貨計 | 株数・金額 銘柄数 < 比率 > | 887 1銘柄 | 1,427 1銘柄 | 205 <0.1%> | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO | 200 | 220 | 3,388 | 13,450 | 情報技術 |
| TAIWAN CEMENT | 1,272.32 | 1,481.45 | 7,481 | 29,701 | 素材 |
| ASIA CEMENT CORP | 630 | — | — | — | 素材 |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT | 940 | 1,160 | 12,992 | 51,579 | 情報技術 |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA | 420 | — | — | — | 金融 |
| WALSIN TECHNOLOGY CORP | — | 90 | 1,899 | 7,539 | 情報技術 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 821.12 | 881.12 | 6,467 | 25,676 | 生活必需品 |
| FORMOSA PLASTICS CORP | 496 | 806 | 8,463 | 33,598 | 素材 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 441.4 | 621.4 | 5,250 | 20,846 | 素材 |
| FORMOSA CHEMICALS & FIBRE | 433.9 | 593.9 | 5,054 | 20,065 | 素材 |
| CHINA STEEL CORP | 976.86 | 3,206.86 | 12,490 | 49,589 | 素材 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 30 | — | — | — | 一般消費財・サービス |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 586.16 | 676.16 | 3,847 | 15,274 | 情報技術 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 470 | 340 | 10,166 | 40,360 | 情報技術 |
| YAGEO CORPORATION | 60 | 80 | 4,448 | 17,659 | 情報技術 |
| WINBOND ELECTRONICS CORP | — | 750 | 2,610 | 10,361 | 情報技術 |
| ACER INC | — | 1,730 | 4,956 | 19,677 | 情報技術 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 300 | 670 | 4,355 | 17,289 | 情報技術 |
| QUANTA COMPUTER INC | 850 | 720 | 6,400 | 25,411 | 情報技術 |
| AU OPTRONICS CORP | 7,450 | 6,680 | 15,096 | 59,935 | 情報技術 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 884 | 834 | 9,507 | 37,746 | コミュニケーション・サービス |
| MEDIA TEK INC | 280.03 | 160.03 | 15,314 | 60,801 | 情報技術 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 230 | 360 | 6,516 | 25,869 | 情報技術 |
| EVA AIRWAYS CORP | — | 1,690 | 3,405 | 13,519 | 資本財・サービス |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | — | 1,180 | 3,068 | 12,180 | 金融 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO | 1,234.11 | 1,884.11 | 13,735 | 54,529 | 金融 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO | 1,548.38 | 1,968.38 | 10,609 | 42,121 | 金融 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL | 2,240 | 4,120 | 5,417 | 21,509 | 金融 |
| E. SUN FINANCIAL HOLDING CO | 1,440.27 | 2,065.05 | 5,369 | 21,315 | 金融 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 1,388.28 | 2,553.81 | 6,767 | 26,868 | 金融 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 1,589.93 | 1,769.93 | 5,761 | 22,872 | 金融 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDING | 1,287.68 | — | — | — | 金融 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDING | 4,193.34 | 4,243.34 | 4,001 | 15,886 | 金融 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 1,670 | — | — | — | 金融 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT | 2,720.28 | 2,470.28 | 5,533 | 21,968 | 金融 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 1,191.72 | 1,467.47 | 3,294 | 13,079 | 金融 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 10 | 20 | 6,210 | 24,654 | 情報技術 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS COR | 110 | 80 | 3,948 | 15,673 | 情報技術 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 310 | 340 | 3,468 | 13,768 | コミュニケーション・サービス |
| WISTRON CORP | 1,291.1 | 1,331.1 | 4,306 | 17,095 | 情報技術 |
| INNOLUX CORP | 9,660 | 6,600 | 14,025 | 55,680 | 情報技術 |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 310 | — | — | — | コミュニケーション・サービス |
| PEGATRON CORP | 630 | 1,680 | 11,424 | 45,354 | 情報技術 |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 150 | 240 | 2,496 | 9,909 | 情報技術 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 214.71 | 264.71 | 5,333 | 21,176 | 金融 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 194 | 324 | 3,483 | 13,827 | 情報技術 |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 |
|------------------------------|---------------------|-------------------|-------------------|---------------------------------|----------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | 百株 | 百株 | 千台湾・ドル | 千円 | |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 320 | 360 | 3,960 | 15,721 | エネルギー |
| COMPAL ELECTRONICS | 1,070 | 1,850 | 4,079 | 16,195 | 情報技術 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC | 2,660 | 2,140 | 125,832 | 499,565 | 情報技術 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 3,679.02 | 9,169.02 | 102,234 | 405,881 | 情報技術 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 80 | 130 | 3,386 | 13,444 | 生活必需品 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 137.6 | 317.6 | 11,782 | 46,779 | 情報技術 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORP | 690 | — | — | — | 資本財・サービス |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 4,580 | 2,060 | 10,835 | 43,018 | 情報技術 |
| 台湾・ドル通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 64,372.21 49銘柄 | 74,379.72 47銘柄 | 530,473 2,106,031 <13.1%> | |
| (トルコ) | 百株 | 百株 | 千トルコ・リラ | 千円 | |
| IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A | — | 324.96 | 475 | 6,094 | 金融 |
| TURKIYE GARANTI BANKASI | 1,060.2 | 2,418.41 | 2,031 | 26,041 | 金融 |
| AKBANK T. A. S. | 1,492.72 | 3,342.74 | 1,781 | 22,839 | 金融 |
| TURKIYE IS BANKASI-C | 1,271 | 2,498.56 | 1,286 | 16,495 | 金融 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 696.6 | 877.6 | 1,408 | 18,056 | コミュニケーション・サービス |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | 90.9 | 199.9 | 1,912 | 24,511 | エネルギー |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | 868.81 | 842.22 | 1,530 | 19,617 | 素材 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | 803.9 | 1,279.23 | 1,169 | 14,988 | 金融 |
| TURKIYE HALK BANKASI | 1,108.3 | 1,108.22 | 549 | 7,046 | 金融 |
| YAPI VE KREDI BANKASI | — | 2,377.87 | 520 | 6,675 | 金融 |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D | 961.2 | — | — | — | 金融 |
| KOC HOLDING AS | 399.15 | 807.81 | 1,571 | 20,141 | 資本財・サービス |
| TURK HAVA YOLLARI AO | 567.8 | 1,294.89 | 1,779 | 22,807 | 資本財・サービス |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | 94.4 | 123.96 | 774 | 9,923 | 生活必需品 |
| トルコ・リラ通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 9,414.98 12銘柄 | 17,496.37 13銘柄 | 16,790 215,240 <1.3%> | |
| (メキシコ) | 百株 | 百株 | 千メキシコ・ペソ | 千円 | |
| COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | 134 | — | — | — | 生活必需品 |
| GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B | — | 88 | 1,866 | 10,477 | 資本財・サービス |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 7,766 | 8,965 | 13,268 | 74,474 | コミュニケーション・サービス |
| GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO | 719 | 758 | 4,358 | 24,464 | コミュニケーション・サービス |
| CEMEX SAB-CPO | 10,067.19 | 8,967.19 | 14,768 | 82,898 | 素材 |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 430 | 756 | 12,675 | 71,149 | 生活必需品 |
| ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | 296.23 | — | — | — | 素材 |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B | 648 | 574 | 5,441 | 30,543 | 素材 |
| WALMART DE MEXICO SAB DE CV | 956 | 1,593 | 10,163 | 57,046 | 生活必需品 |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 648 | 653 | 8,513 | 47,788 | 金融 |
| メキシコ・ペソ通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 21,664.42 9銘柄 | 22,354.19 8銘柄 | 71,056 398,841 <2.5%> | |
| (チリ) | 百株 | 百株 | 千チリ・ペソ | 千円 | |
| ENEL CHILE SA | 6,997.67 | — | — | — | 公益事業 |
| CENCOSUD SA | — | 461.15 | 65,944 | 9,965 | 生活必需品 |
| BANCO SANTANDER CHILE | 21,058.8 | 28,986.96 | 102,816 | 15,537 | 金融 |
| ENEL AMERICAS SA | 8,533.63 | 12,217.63 | 133,172 | 20,125 | 公益事業 |
| SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B | — | 14.72 | 51,888 | 7,841 | 素材 |
| FALABELLA SA | 218 | 215.93 | 67,478 | 10,197 | 一般消費財・サービス |
| BANCO DE CHILE | 12,197.92 | 10,345.39 | 73,969 | 11,178 | 金融 |
| チリ・ペソ通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 49,006.02 5銘柄 | 52,241.78 6銘柄 | 495,269 74,846 <0.5%> | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|---------------------|------------------|-----------------|-----------------|----------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千サウジアラビア・リアル | 千円 | | |
| (サウジアラビア) | | | | | | |
| SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP | 214.6 | 131.73 | 1,604 | 47,620 | 素材 | |
| SAUDI TELECOM CO | 75 | 54.52 | 717 | 21,294 | コミュニケーション・サービス | |
| AL RAJHI BANK | 174 | 241.62 | 2,725 | 80,892 | 金融 | |
| SAMBA FINANCIAL GROUP | 126.2 | — | — | — | 金融 | |
| RIYAD BANK | 163.6 | — | — | — | 金融 | |
| ETIHAD ETISALAT CO | 120.7 | 176.9 | 574 | 17,063 | コミュニケーション・サービス | |
| SAVOLA | 71.2 | — | — | — | 生活必需品 | |
| YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 62.1 | — | — | — | 素材 | |
| ALINMA BANK | 174.26 | 329.25 | 723 | 21,459 | 金融 | |
| THE SAUDI NATIONAL BANK | 130.5 | 118.42 | 688 | 20,420 | 金融 | |
| SAUDI ARABIAN OIL CO | 98.8 | 280.37 | 982 | 29,166 | エネルギー | |
| SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 309.9 | 285.25 | 552 | 16,407 | 素材 | |
| SAUDI ELECTRICITY CO | — | 366.17 | 884 | 26,256 | 公益事業 | |
| サウジアラビア・リアル通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 1,720.86 12銘柄 | 1,984.23 9銘柄 | 9,453 <1.7%> | 280,582 | |
| | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | | |
| (インド) | | | | | | |
| RELANCE INDUSTRIES-PARTLY P | — | 25.19 | 3,791 | 5,686 | エネルギー | |
| TATA STEEL LTD | 185.4 | 348.72 | 39,614 | 59,421 | 素材 | |
| AXIS BANK LTD | 233.9 | 431.9 | 32,420 | 48,630 | 金融 | |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 13.5 | 19.5 | 14,769 | 22,153 | 一般消費財・サービス | |
| TATA POWER CO LTD | — | 794.37 | 9,607 | 14,411 | 公益事業 | |
| BANK OF BARODA | — | 736.29 | 6,273 | 9,409 | 金融 | |
| HINDUSTAN UNILEVER LTD | 27.3 | 52.23 | 12,991 | 19,486 | 生活必需品 | |
| HINDUSTAN PETROLEUM CORP | 469.4 | 664.96 | 19,812 | 29,718 | エネルギー | |
| STATE BANK OF INDIA | 554.7 | 782.7 | 33,217 | 49,826 | 金融 | |
| NTPC LTD | 916 | 2,405.22 | 28,261 | 42,392 | 公益事業 | |
| POWER FINANCE CORPORATION | 359.4 | — | — | — | 金融 | |
| JSW STEEL LTD | 335.2 | 317.64 | 21,323 | 31,984 | 素材 | |
| POWER GRID CORP OF INDIA LTD | — | 650.99 | 14,839 | 22,258 | 公益事業 | |
| INDIAN OIL CORP LTD | 1,020.7 | 2,304.71 | 24,994 | 37,491 | エネルギー | |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 422.05 | 686.05 | 31,746 | 47,620 | エネルギー | |
| VODAFONE IDEA LTD | 11,058.9 | — | — | — | コミュニケーション・サービス | |
| JINDAL STEEL & POWER LTD | 276.9 | 220.88 | 8,573 | 12,860 | 素材 | |
| ULTRATECH CEMENT LTD | — | 10.97 | 7,371 | 11,057 | 素材 | |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 30.5 | 53.46 | 7,282 | 10,923 | 金融 | |
| TECH MAHINDRA LTD | 58.2 | 92.74 | 10,103 | 15,154 | 情報技術 | |
| YES BANK LTD | 176.4 | 176.4 | 239 | 358 | 金融 | |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR | 318.2 | 282.02 | 4,399 | 6,599 | 一般消費財・サービス | |
| REC LTD | 383.6 | 530.6 | 7,664 | 11,496 | 金融 | |
| COAL INDIA LTD | 725.1 | 1,440.5 | 21,268 | 31,903 | エネルギー | |
| INDUS TOWERS LTD | 206.8 | — | — | — | コミュニケーション・サービス | |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE L | 217.4 | 622.66 | 16,189 | 24,283 | 金融 | |
| GAIL INDIA LTD | 378.66 | 691.94 | 10,469 | 15,703 | 公益事業 | |
| HINDALCO INDUSTRIES LTD | 528 | 640.18 | 24,073 | 36,110 | 素材 | |
| GRASIM INDUSTRIES LTD | 106.8 | 136.2 | 20,290 | 30,435 | 素材 | |
| WIPRO LTD | 204.23 | 160.49 | 8,643 | 12,965 | 情報技術 | |
| TATA CONSULTANCY SVCS LTD | 84.16 | 108.98 | 36,240 | 54,361 | 情報技術 | |
| INFOSYS LTD | 472.4 | 487.24 | 76,389 | 114,584 | 情報技術 | |
| LARSEN & TOUBRO LTD | 55.72 | 135.49 | 20,129 | 30,193 | 資本財・サービス | |
| TATA MOTORS LTD | 1,066.8 | 1,103.73 | 38,067 | 57,101 | 一般消費財・サービス | |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 147.9 | 218.9 | 54,193 | 81,289 | 金融 | |
| ICICI BANK LTD | — | 222.99 | 14,276 | 21,415 | 金融 | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 当株数 | 期末 | | 業種等 | |
|----------------------------------|------------|-----------|-----------|-------------|----------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千インド・ルピー | 千円 | | |
| RELIANCE INDUSTRIES LTD | 400.4 | 526.81 | 112,160 | 168,240 | エネルギー | |
| OIL & NATURAL GAS CORP LTD | 1,211.25 | 2,380.25 | 28,194 | 42,291 | エネルギー | |
| ITC LTD | 432.9 | 804.34 | 16,279 | 24,419 | 生活必需品 | |
| MAHINDRA & MAHINDRA LTD | 169.5 | 234.85 | 18,379 | 27,569 | 一般消費財・サービス | |
| HERO MOTOCORP LTD | 25.1 | 29.67 | 8,663 | 12,994 | 一般消費財・サービス | |
| BHARTI AIRTEL LTD | 211.42 | 290.16 | 15,233 | 22,850 | コミュニケーション・サービス | |
| UPL LTD | — | 137.76 | 11,011 | 16,517 | 素材 | |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS | 152.4 | 147.6 | 10,055 | 15,082 | ヘルスケア | |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 151.4 | 162.74 | 16,024 | 24,036 | 情報技術 | |
| VEDANTA LTD | 1,334.6 | 1,329.16 | 34,830 | 52,245 | 素材 | |
| インド・ルピー通貨計 | 株数、金額 | 25,123.19 | 23,600.18 | 950,361 | 1,425,542 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 39銘柄 | 43銘柄 | | < 8.8% > | |
| (インドネシア) | | 百株 | 百株 | 千インドネシア・ルピア | 千円 | |
| ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | 2,563 | 4,933 | 2,466,500 | 18,992 | 一般消費財・サービス | |
| INDAH KIAT PULP & PAPER TBK | — | 1,013 | 780,010 | 6,006 | 素材 | |
| TELKOM INDONESIA PERSERO TBK | 9,272 | 18,061 | 5,544,727 | 42,694 | コミュニケーション・サービス | |
| BANK NEGARA INDONESIA PERSER | 1,727 | 4,250 | 2,052,750 | 15,806 | 金融 | |
| BANK CENTRAL ASIA TBK PT | 615 | 1,194 | 3,641,700 | 28,041 | 金融 | |
| BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | 3,370 | 5,474 | 3,257,030 | 25,079 | 金融 | |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT | — | 8,570 | 886,995 | 6,829 | 公益事業 | |
| BANK RAKYAT INDONESIA PERSER | 7,761 | 13,452 | 5,367,348 | 41,328 | 金融 | |
| ADARO ENERGY TBK PT | — | 12,895 | 1,624,770 | 12,510 | エネルギー | |
| インドネシア・ルピア通貨計 | 株数、金額 | 25,308 | 69,842 | 25,621,830 | 197,288 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 6銘柄 | 9銘柄 | | < 1.2% > | |
| (ブラジル) | | 百株 | 百株 | 千ブラジル・リアル | 千円 | |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES RIGHTS SA | — | 902.93 | 0 | 19 | エネルギー | |
| CIA PARANAENSE DE ENERGIA | 6 | 164 | 92 | 2,025 | 公益事業 | |
| ENERGISA SA-UNITS | — | 106 | 483 | 10,633 | 公益事業 | |
| RUMO SA | — | 285 | 562 | 12,367 | 資本財・サービス | |
| IRB BRASIL RESSEGUROS SA | 146 | 1,765 | 1,009 | 22,181 | 金融 | |
| BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | 36 | 184 | 578 | 12,718 | 金融 | |
| PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA | 268 | 755 | 2,218 | 48,752 | 一般消費財・サービス | |
| CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC | 66 | 108 | 423 | 9,304 | 生活必需品 | |
| TIM SA | — | 485.26 | 557 | 12,239 | コミュニケーション・サービス | |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR | 1,300 | 4,438 | 12,950 | 284,528 | エネルギー | |
| BANCO BRADESCO SA-PREF | 1,437.26 | 4,212.18 | 10,951 | 240,621 | 金融 | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | 1,833.36 | 4,857.36 | 14,576 | 320,272 | 金融 | |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 246 | 185 | 833 | 18,319 | 素材 | |
| VALE SA | 1,035.9 | 948.9 | 10,777 | 236,796 | 素材 | |
| GERDAU SA-PREF | 367 | 570 | 1,696 | 37,270 | 素材 | |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 821 | 3,673 | 11,030 | 242,342 | エネルギー | |
| CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF | 413.97 | 1,074.87 | 1,301 | 28,599 | 公益事業 | |
| ITAUSA SA | — | 1,361 | 1,528 | 33,580 | 金融 | |
| BRASKEM SA-PREF A | 125 | 261 | 1,566 | 34,406 | 素材 | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B | 48 | 222 | 960 | 21,095 | 公益事業 | |
| BANCO DO BRASIL S. A. | 453 | 1,543 | 4,959 | 108,959 | 金融 | |
| COSAN SA | — | 644 | 1,573 | 34,567 | エネルギー | |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER | 123 | 372 | 1,620 | 35,602 | 公益事業 | |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 33 | 792 | 472 | 10,388 | 公益事業 | |
| EMBRAER SA | 282 | 712 | 1,349 | 29,644 | 資本財・サービス | |
| METALURGICA GERDAU SA-PREF | 753 | 949 | 1,327 | 29,170 | 素材 | |
| CCR SA | 252 | 886 | 1,189 | 26,124 | 資本財・サービス | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 | |
|-------------------------------|------------|-----------|------------|---------|----------------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千ブラジル・リアル | 千円 | | |
| BRF SA | 197 | 571 | 1,533 | 33,697 | 生活必需品 | |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | 68 | 260 | 949 | 20,867 | 公益事業 | |
| TIM PARTICIPACOES SA | 194.26 | — | — | — | その他 | |
| TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF | 153 | — | — | — | その他 | |
| LOJAS RENNEN S. A. | 50.05 | 197.05 | 854 | 18,785 | 一般消費財・サービス | |
| LOJAS AMERICANAS SA-PREF | 85.84 | 147.84 | 315 | 6,941 | 一般消費財・サービス | |
| JBS SA | 429 | 965 | 2,849 | 62,610 | 生活必需品 | |
| SUZANO SA | 89.45 | 122.45 | 724 | 15,927 | 素材 | |
| MARFRIG GLOBAL FOODS SA | 197 | 379 | 729 | 16,037 | 生活必需品 | |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | 141 | 906 | 1,487 | 32,685 | 金融 | |
| CIELO SA | 752.28 | 2,442.28 | 886 | 19,478 | 情報技術 | |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 90 | 370 | 905 | 19,884 | 公益事業 | |
| SUL AMERICA SA - UNITS | — | 188.18 | 641 | 14,102 | 金融 | |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER | 32 | 186.54 | 270 | 5,938 | 公益事業 | |
| BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT | 146 | 332 | 1,356 | 29,812 | 金融 | |
| RAIA DROGASIL SA | — | 235 | 582 | 12,804 | 生活必需品 | |
| TELEFONICA BRASIL S. A. | 10 | 369 | 1,548 | 34,018 | コミュニケーション・サービス | |
| KLABIN SA - UNIT | 144 | — | — | — | 素材 | |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | 565 | 732 | 1,387 | 30,477 | エネルギー | |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 199 | 516 | 1,376 | 30,236 | 金融 | |
| LOJAS AMERICANAS SA | 22.93 | 46.93 | 95 | 2,104 | 一般消費財・サービス | |
| COGNA EDUCACAO | 475 | 2,643 | 1,147 | 25,202 | 一般消費財・サービス | |
| BANCO BRADESCO S. A. | 382.41 | 1,267.65 | 2,786 | 61,218 | 金融 | |
| AMBEV SA | 878 | 1,872 | 3,262 | 71,689 | 生活必需品 | |
| ブラジル・リアル通貨計 | 株数、金額 | 15,346.71 | 47,205.42 | 112,285 | 2,467,055 | |
| | 銘柄数 < 比率 > | 43銘柄 | 48銘柄 | | <15.3%> | |
| (中国) | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | | |
| INDUSTRIAL BANK CO LTD -A | 650 | 737 | 1,532 | 26,315 | 金融 | |
| BANK OF BEIJING CO LTD -A | — | 1,495 | 729 | 12,530 | 金融 | |
| CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A | 682 | — | — | — | 資本財・サービス | |
| GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A | — | 175 | 291 | 5,001 | 金融 | |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-A | 131 | 249 | 1,551 | 26,642 | 金融 | |
| IND & COMM BK OF CHINA-A | 2,318 | 3,796 | 1,992 | 34,227 | 金融 | |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A | 55 | 93 | 193 | 3,319 | ヘルスケア | |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-A | 60 | 94 | 300 | 5,164 | 金融 | |
| GREAT WALL MOTOR CO LTD-A | 84 | 29 | 121 | 2,085 | 一般消費財・サービス | |
| KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A | 4 | 3 | 603 | 10,371 | 生活必需品 | |
| ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | 46 | 80 | 322 | 5,541 | 素材 | |
| POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A | — | 500 | 604 | 10,382 | 不動産 | |
| SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A | 996 | 1,733 | 1,720 | 29,555 | 金融 | |
| HUADIAN POWER INTL CORP-A | 404 | — | — | — | 公益事業 | |
| CITIC SECURITIES CO-A | 110 | 148 | 350 | 6,011 | 金融 | |
| CHINA MERCHANTS BANK-A | 359 | 388 | 2,058 | 35,351 | 金融 | |
| PING AN BANK CO LTD-A | 378 | 464 | 1,011 | 17,380 | 金融 | |
| GF SECURITIES CO LTD-A | 98 | 134 | 197 | 3,390 | 金融 | |
| CHINA STATE CONSTRUCTION -A | 2,175 | 3,940 | 1,824 | 31,330 | 資本財・サービス | |
| HAIER SMART HOME CO LTD-A | — | 101 | 259 | 4,458 | 一般消費財・サービス | |
| SAIC MOTOR CORP LTD-A | 379 | 630 | 1,325 | 22,765 | 一般消費財・サービス | |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A | 238 | 337 | 124 | 2,135 | 素材 | |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A | 291 | 421 | 250 | 4,302 | 資本財・サービス | |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A | — | 289 | 114 | 1,965 | 金融 | |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A | — | 132 | 404 | 6,950 | 資本財・サービス | |
| METALLURGICAL CORP OF CHIN-A | 845 | 903 | 267 | 4,590 | 資本財・サービス | |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A | 621 | 704 | 361 | 6,214 | 素材 | |

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 期首 | | 期末 | | 業種等 | | |
|------------------------------|---------|----------|--------------|--------|----------------|---------|--|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| | 百株 | 百株 | 千オフショア・人民元 | 千円 | | | |
| JIANGXI COPPER CO LTD-A | 96 | 68 | 150 | 2,576 | 素材 | | |
| YANZHOU COAL MINING CO-A | 49 | 81 | 119 | 2,049 | エネルギー | | |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-A | 303 | 306 | 204 | 3,510 | 金融 | | |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A | 4,834 | 8,046 | 2,437 | 41,871 | 金融 | | |
| BANK OF CHINA LTD-A | 2,442 | 2,581 | 794 | 13,653 | 金融 | | |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A | 1,704 | 2,089 | 900 | 15,463 | エネルギー | | |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-A | 1,733 | 3,315 | 1,624 | 27,898 | 金融 | | |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO-A | 263 | 398 | 767 | 13,179 | エネルギー | | |
| CHINA VANKE CO LTD -A | 191 | 344 | 822 | 14,209 | 不動産 | | |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A | 122 | 153 | 431 | 7,407 | 金融 | | |
| CHINA CITIC BANK CORP LTD-A | 412 | 487 | 247 | 4,257 | 金融 | | |
| CHINA MINSHENG BANKING-A | 1,525 | 3,033 | 1,331 | 22,868 | 金融 | | |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A | 1,551 | 2,530 | 951 | 16,338 | 金融 | | |
| CRRC CORP LTD-A | 552 | — | — | — | 資本財・サービス | | |
| CHINA UNITED NETWORK-A | 913 | — | — | — | コミュニケーション・サービス | | |
| CGN POWER CO LTD-A | — | 189 | 50 | 866 | 公益事業 | | |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-A | 90 | 154 | 239 | 4,112 | 金融 | | |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-A | 123 | 229 | 261 | 4,491 | 金融 | | |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-A | — | 1,850 | 965 | 16,585 | 資本財・サービス | | |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-A | 268 | — | — | — | 資本財・サービス | | |
| BAOSHAN IRON & STEEL CO-A | 815 | 915 | 698 | 11,990 | 素材 | | |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A | 35 | 52 | 231 | 3,978 | 金融 | | |
| HUAXIA BANK CO LTD-A | 603 | 1,174 | 725 | 12,460 | 金融 | | |
| AIR CHINA LTD-A | 148 | 207 | 157 | 2,709 | 資本財・サービス | | |
| BYD CO LTD -A | 18 | 7 | 167 | 2,873 | 一般消費財・サービス | | |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A | 44 | 71 | 93 | 1,599 | 一般消費財・サービス | | |
| WEICHAI POWER CO LTD-A | 98 | 98 | 167 | 2,884 | 資本財・サービス | | |
| ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A | 259 | 130 | 127 | 2,197 | 素材 | | |
| HUANENG POWER INTL INC-A | 386 | 665 | 280 | 4,819 | 公益事業 | | |
| オフショア・人民元通貨計 | 株数 | 金額 | 30,501 | 46,747 | 33,469 | 574,840 | |
| | 銘柄数 | <比率> | 48銘柄 | 51銘柄 | | <3.6%> | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千マレーシア・リンギット | 千円 | | | |
| MISC BHD | 429 | — | — | — | 資本財・サービス | | |
| MALAYAN BANKING BHD | 675 | 583 | 472 | 12,649 | 金融 | | |
| GENTING BHD | — | 878 | 434 | 11,627 | 一般消費財・サービス | | |
| PUBLIC BANK BERHAD | 349 | 2,617 | 1,075 | 28,775 | 金融 | | |
| CIMB GROUP HOLDINGS BHD | 691 | 1,360 | 631 | 16,882 | 金融 | | |
| TENAGA NASIONAL BHD | 347 | 497 | 483 | 12,937 | 公益事業 | | |
| マレーシア・リンギット通貨計 | 株数 | 金額 | 2,491 | 5,935 | 3,097 | 82,871 | |
| | 銘柄数 | <比率> | 5銘柄 | 5銘柄 | | <0.5%> | |
| (南アフリカ) | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | | | |
| GOLD FIELDS LTD | 154.2 | 241.42 | 3,195 | 24,894 | 素材 | | |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | — | 15.03 | 2,510 | 19,552 | 金融 | | |
| NEPI ROCKCASTLE PLC | 75 | 151.07 | 1,540 | 12,001 | 不動産 | | |
| MULTICHOICE GROUP LTD | 127.3 | 118.08 | 1,395 | 10,870 | コミュニケーション・サービス | | |
| OLD MUTUAL LTD | 1,695.4 | 1,295.77 | 1,709 | 13,314 | 金融 | | |
| VODACOM GROUP LTD | 171.2 | 141.5 | 1,807 | 14,083 | コミュニケーション・サービス | | |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 227.2 | 157.17 | 2,444 | 19,046 | 生活必需品 | | |
| NEDBANK GROUP LTD | 119 | 139.46 | 2,347 | 18,287 | 金融 | | |
| BIDVEST GROUP LTD | 88.7 | 90.87 | 1,701 | 13,252 | 資本財・サービス | | |
| BID CORP LTD | 73.1 | 68.49 | 2,139 | 16,670 | 生活必需品 | | |
| NETCARE LTD | 566.9 | — | — | — | ヘルスケア | | |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 364.2 | 320.36 | 4,040 | 31,477 | 金融 | | |
| SASOL LTD | 236.4 | 273.1 | 5,977 | 46,563 | 素材 | | |

ダイワ新興株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

| 銘柄 | 株数 | 当 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|---------------------|--------------------|--------------------|-------------------|----------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| | 百株 | 百株 | 千南アフリカ・ランド | 千円 | | |
| REMGRO LTD | 124.1 | — | — | — | 金融 | |
| DISCOVERY LTD | 89.4 | 130.47 | 1,603 | 12,491 | 金融 | |
| EXXARO RESOURCES LTD | 80.3 | — | — | — | エネルギー | |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 210.2 | — | — | — | 一般消費財・サービス | |
| SANLAM LTD | 427.2 | 530.72 | 3,234 | 25,194 | 金融 | |
| TIGER BRANDS LTD | 66.8 | — | — | — | 生活必需品 | |
| FIRSTRAND LTD | 889.3 | 1,215.28 | 6,445 | 50,213 | 金融 | |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 399.6 | 278.95 | 1,506 | 11,734 | 一般消費財・サービス | |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 78.4 | — | — | — | 一般消費財・サービス | |
| ABSA GROUP LTD | 254.6 | 255.81 | 3,396 | 26,461 | 金融 | |
| NASPERS LTD-N SHS | 17.29 | 26.73 | 7,910 | 61,626 | 一般消費財・サービス | |
| MTN GROUP LTD | 385.9 | 433.66 | 4,531 | 35,298 | コミュニケーション・サービス | |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 64.3 | 64.45 | 1,554 | 12,105 | 素材 | |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 132.8 | 119.7 | 1,936 | 15,084 | ヘルスケア | |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 54.5 | 122.25 | 3,309 | 25,783 | 素材 | |
| SAPPI LIMITED | 470.8 | — | — | — | 素材 | |
| TELKOM SA SOC LTD | 350 | — | — | — | コミュニケーション・サービス | |
| SPAR GROUP LIMITED/THE | 77.7 | — | — | — | 生活必需品 | |
| MR PRICE GROUP LTD | 59 | 79.44 | 1,659 | 12,924 | 一般消費財・サービス | |
| SIBANYE STILLWATER LTD | 265 | 344.77 | 2,064 | 16,082 | 素材 | |
| 南アフリカ・ランド通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 8,395.79 32銘柄 | 6,614.55 24銘柄 | 69,963 <3.4%> | 545,014 | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千タイ・パーツ | 千円 | | |
| BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG | 208 | 271 | 3,035 | 10,501 | 金融 | |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR | 309 | 458 | 19,602 | 67,824 | 素材 | |
| KASIKORNBANK PCL-FOREIGN | 227 | 385 | 4,620 | 15,985 | 金融 | |
| MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR | — | 1,139 | 3,388 | 11,724 | 一般消費財・サービス | |
| KASIKORNBANK PCL-NVDR | 116 | 169 | 2,002 | 6,929 | 金融 | |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 1,068 | 1,641 | 15,876 | 54,933 | 金融 | |
| THANACHART CAPITAL PCL-NVDR | 372 | — | — | — | 金融 | |
| TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR | — | 31,683 | 3,548 | 12,277 | 金融 | |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 685 | 917 | 3,828 | 13,246 | 素材 | |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 221 | 412 | 7,065 | 24,447 | コミュニケーション・サービス | |
| KRUNG THAI BANK - NVDR | 2,994 | 6,418 | 6,803 | 23,538 | 金融 | |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 3,163 | 3,723 | 5,026 | 17,390 | エネルギー | |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | — | 1,520 | 3,556 | 12,306 | ヘルスケア | |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 384 | 670 | 7,906 | 27,354 | エネルギー | |
| IRPC PCL - NVDR | 8,853 | 11,202 | 4,323 | 14,960 | エネルギー | |
| BANGCHAK CORP PCL-NVDR | — | 1,048 | 2,588 | 8,956 | エネルギー | |
| PTT PCL-NVDR | 5,902 | 10,368 | 40,176 | 139,008 | エネルギー | |
| THAI OIL PCL-NVDR | 706 | 961 | 5,189 | 17,955 | エネルギー | |
| CP ALL PCL-NVDR | 693 | 1,447 | 8,645 | 29,914 | 生活必需品 | |
| AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR | — | 539 | 3,355 | 11,609 | 資本財・サービス | |
| BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR | — | 187 | 2,094 | 7,246 | 金融 | |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR | — | 3,271 | 2,616 | 9,054 | 不動産 | |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 1,316 | 2,294 | 6,079 | 21,033 | 生活必需品 | |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 1,214 | 1,404 | 8,424 | 29,147 | 素材 | |
| タイ・パーツ通貨計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 28,431 17銘柄 | 82,127 23銘柄 | 169,753 <3.6%> | 587,347 | |
| ファンド合計 | 株数、金額 銘柄数 < 比率 > | 601,604.9 398銘柄 | 847,464.8 404銘柄 | — <88.1%> | 14,204,803 | |

(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) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

| 銘柄 | 柄 | 期首 | 当期 | | 期末 |
|------------------------------|------------|--------|-------|------------|---------|
| | | □数 | □数 | 評価額 | 価額 |
| | | 千円 | 千円 | 千円 | 千円 |
| (アメリカ) | | | | 千アメリカ・ドル | 千円 |
| INVESCO FTSE RAFI EMERGING M | | 651 | 178.6 | 4,156 | 461,983 |
| アメリカ・ドル通貨計 | □数、金額 | 651 | 178.6 | 4,156 | 461,983 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 1銘柄 | 1銘柄 | | <2.9%> |
| (メキシコ) | | 千円 | 千円 | 千メキシコ・ペソ | 千円 |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | | 80.2 | — | — | — |
| メキシコ・ペソ通貨計 | □数、金額 | 80.2 | — | — | — |
| | 銘柄数 < 比率 > | 1銘柄 | | | <—> |
| (南アフリカ) | | 千円 | 千円 | 千南アフリカ・ランド | 千円 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | | 76.93 | — | — | — |
| 南アフリカ・ランド通貨計 | □数、金額 | 76.93 | — | — | — |
| | 銘柄数 < 比率 > | 1銘柄 | | | <—> |
| 合計 | □数、金額 | 808.13 | 178.6 | — | 461,983 |
| | 銘柄数 < 比率 > | 3銘柄 | 1銘柄 | | <2.9%> |

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

| 銘柄別 | 当期 | 期末 |
|-----------------------|--------------|----------|
| | 買建額 | 売建額 |
| 外国 MSCI EMGMKT (アメリカ) | 百万円 1,401 | 百万円 — |

(注1) 外貨建の評価額は、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) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

| 項目 | 当期 | 期末 |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 14,204,803 | % 88.0 |
| 投資信託証券 | 461,983 | 2.9 |
| コール・ローン等、その他 | 1,477,725 | 9.1 |
| 投資信託財産総額 | 16,144,512 | 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=111.16円、1香港・ドル=14.31円、1シンガポール・ドル=82.49円、1台湾・ドル=3.97円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、100チリ・ペソ=15.112円、1サウジアラビア・リアル=29.68円、1インド・ルピー=1.50円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=21.971円、1オフショア・人民元=17.174円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (16,010,106千円) の投資信託財産総額 (16,144,512千円) に対する比率は、99.2%です。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------------|------------------------|
| (A) 資産 | 16,467,168,379円 |
| コール・ローン等 | 842,077,407 |
| 株式（評価額） | 14,204,803,209 |
| 投資信託証券（評価額） | 461,983,406 |
| 未収入金 | 712,351,835 |
| 未取配当金 | 107,607,095 |
| 差入委託証拠金 | 138,345,427 |
| (B) 負債 | 340,596,345 |
| 未払金 | 333,023,836 |
| 未払解約金 | 7,566,569 |
| その他未払費用 | 5,940 |
| (C) 純資産総額（A－B） | 16,126,572,034 |
| 元本 | 8,472,556,221 |
| 次期繰越損益金 | 7,654,015,813 |
| (D) 受益権総口数 | 8,472,556,221口 |
| 1万口当り基準価額（C/D） | 19,034円 |

*期首における元本額は6,697,704,657円、当作成期間中における追加設定元本額は2,563,269,417円、同解約元本額は788,417,853円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）30,073,026円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）244,455,917円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）247,588,516円、D-1's 新興国株式インデックス135,184,864円、i F r e e 新興国株式インデックス3,368,872,878円、i F r e e 8資産バランス2,090,080,781円、新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし/適格機関投資家専用）171,072,972円、D Cダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド1,170,193,060円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式372,572,544円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド96,461,663円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は19,034円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------------|----------------------|
| (A) 配当等収益 | 420,452,414円 |
| 受取配当金 | 420,289,006 |
| 受取利息 | 198,675 |
| その他収益金 | 225 |
| 支払利息 | △ 35,492 |
| (B) 有価証券売買損益 | 3,619,866,641 |
| 売買益 | 4,235,122,648 |
| 売買損 | △ 615,256,007 |
| (C) 先物取引等損益 | 81,757,968 |
| 取引益 | 158,263,439 |
| 取引損 | △ 76,505,471 |
| (D) その他費用 | △ 24,606,978 |
| (E) 当期損益金（A+B+C+D） | 4,097,470,045 |
| (F) 前期繰越損益金 | 2,527,410,481 |
| (G) 解約差損益金 | △ 506,206,067 |
| (H) 追加信託差損益金 | 1,535,341,354 |
| (I) 合計（E+F+G+H） | 7,654,015,813 |
| 次期繰越損益金（I） | 7,654,015,813 |

(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。

【注記】

出典：FTSE International Limited（以下、「FTSE」）[®] FTSE。FTSE[®]は、ロンドン証券取引所グループ会社が所有する商標であり、ライセンスに基づき FTSE International Limited によって使用されています。Fundamental Index[®] および RAFI[®] は Research Affiliates, LLC の登録商標です。FTSE RAFI[®] エマージング インデックスは Research Affiliates LLC（以下、「RAI」）と共同し FTSE International Limited（以下、「FTSE」）によって計算されます。本インデックスに関する知的財産権はすべて FTSE に帰属します。FTSE のインデックス、FTSE Ratings、またはその基礎データに関する瑕疵や不作為については、FTSE 並びにライセンス各社はいずれも一切の責任を負いません。また、書面に基づく FTSE の同意がない限り、FTSE のデータの再配信も許可されません。

Source: FTSE International Limited ("FTSE")[®] FTSE. "FTSE"[®] is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE International Limited under licence. The trade names Fundamental Index[®] and RAFI[®] are registered trademarks of Research Affiliates, LLC. The FTSE RAFI[®] Emerging Index is calculated by FTSE in conjunction with Research Affiliates LLC. All intellectual property rights in the Index vest in FTSE. Neither FTSE nor its licensors accept any liability for any errors or omissions in the FTSE indices and / or FTSE ratings or underlying data. No further distribution of FTSE Data is permitted without FTSE's express written consent.