

iFree 新興国債券 インデックス

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年7月5日)

(作成対象期間 2021年7月6日~2022年7月5日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2016年9月8日)		
運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公社債組入比率	純資産額
	(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
2 期末(2018年 7 月 5 日)	10,799	0	△ 5.2	11,004	△ 4.3	96.7	1,789
3 期末(2019年 7 月 5 日)	11,545	0	6.9	11,850	7.7	96.6	3,040
4 期末(2020年 7 月 6 日)	11,102	0	△ 3.8	11,446	△ 3.4	95.4	3,846
5 期末(2021年 7 月 5 日)	12,040	0	8.4	12,475	9.0	96.9	5,577
6 期末(2022年 7 月 5 日)	11,855	0	△ 1.5	12,373	△ 0.8	96.5	7,534

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

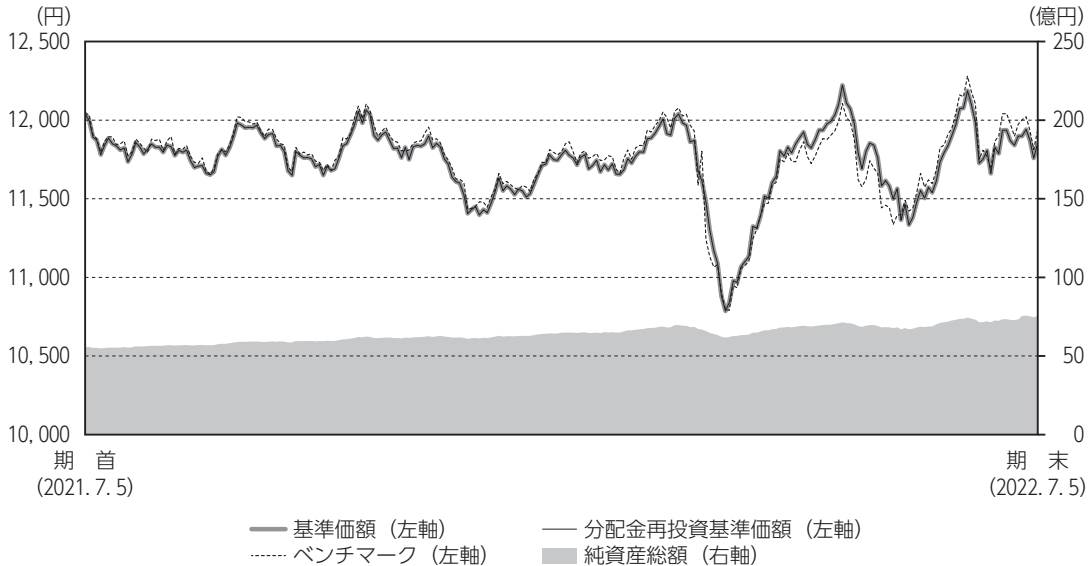
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

基準価額・騰落率

期首：12,040円

期末：11,855円（分配金0円）

騰落率：△1.5%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことがプラス要因となった一方で、金利が上昇（債券価格は下落）したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
	円	%		%	%
(期首)2021年7月5日	12,040	—	12,475	—	96.9
7月末	11,848	△ 1.6	12,309	△ 1.3	96.5
8月末	11,896	△ 1.2	12,351	△ 1.0	96.4
9月末	11,753	△ 2.4	12,212	△ 2.1	96.4
10月末	11,819	△ 1.8	12,295	△ 1.4	96.6
11月末	11,432	△ 5.0	11,853	△ 5.0	95.8
12月末	11,745	△ 2.5	12,204	△ 2.2	97.1
2022年1月末	11,726	△ 2.6	12,177	△ 2.4	96.6
2月末	11,616	△ 3.5	12,229	△ 2.0	97.2
3月末	11,828	△ 1.8	12,216	△ 2.1	96.3
4月末	11,802	△ 2.0	12,044	△ 3.5	95.5
5月末	11,736	△ 2.5	12,253	△ 1.8	95.8
6月末	11,940	△ 0.8	12,456	△ 0.2	96.7
(期末)2022年7月5日	11,855	△ 1.5	12,373	△ 0.8	96.5

(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

(2021.7.6 ~ 2022.7.5)

■新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が上昇しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より横ばいで推移したものの、2021年9月には、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから金利は上昇し、債券価格は下落しました。その後も、供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことや、F R B議長が毎会合での利上げの可能性を否定しなかったことから利上げの織り込みが加速し、金利は上昇しました。2022年2月後半には、ロシアがウクライナに侵攻したことで投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は大幅に上昇しました。当作成期末にかけても、各国で積極的な利上げの観測が高まったことなどから、金利はさらに上昇しました。

■為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より新型コロナウイルスの感染拡大により円に対して下落（円高）したものの、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、世界経済への楽観的な見方が強まったことで上昇に転じました。その後は、商品価格の上昇によるインフレ圧力の高まりを受けて各国が利上げを実施する中で、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、日本と各国の金融政策の相違がより明確となって、新興国通貨は対円で大きく上昇しました。

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

(2021.7.6～2022.7.5)

■当ファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

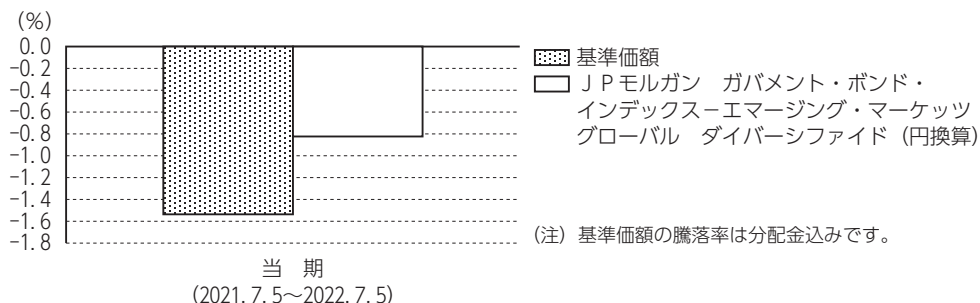
* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

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 $\Delta 0.8\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.5\%$ となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、運用管理費用や税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年7月6日 ～2022年7月5日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,854

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

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

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



今後の運用方針

当ファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

今後も、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 (2021.7.6~2022.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	28円	0.242%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,740円です。
(投 信 会 社)	(13)	(0.110)	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)	(13)	(0.110)	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	13	0.109	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(9)	(0.078)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(3)	(0.022)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	41	0.350	

(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。

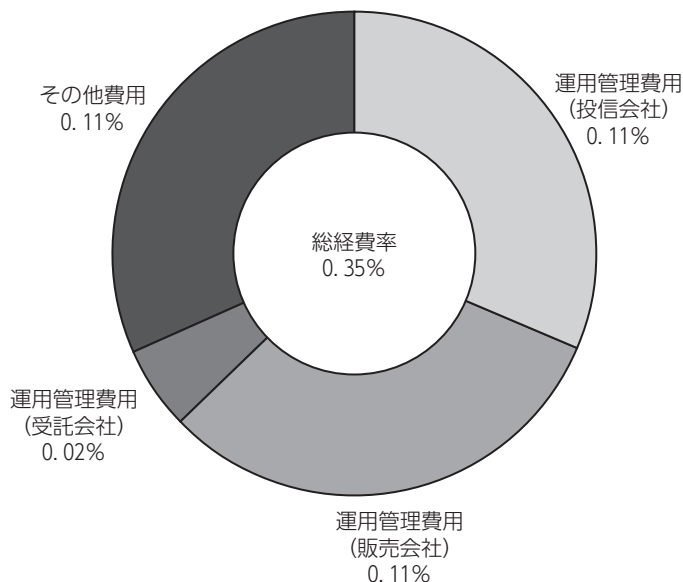
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.35%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

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1,524,397	2,179,329	122,971	174,888

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	3,803,181	5,204,607	7,518,055	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	7,518,055	99.4
コール・ローン等、その他	43,890	0.6
投資信託財産総額	7,561,945	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=136.14円、1エジプト・ポンド=7.216円、1トルコ・リラ=8.104円、1メキシコ・ペソ=6.721円、1フィリピン・ペソ=2.471円、1アルゼンチン・ペソ=1.08円、100チリ・ペソ=14.674円、100コロンビア・ペソ=3.249円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・レアル=25.537円、1チェコ・コルナ=5.743円、1ルーマニア・レイ=28.726円、1オフショア・人民元=20.329円、1マレーシア・リンギット=30.831円、1南アフリカ・ランド=8.35円、1タイ・バーツ=3.81円、1ペルー・ソル=35.572円、1ポーランド・ズロチ=30.126円、100ハンガリー・フォリント=35.324円、1ウルグアイ・ペソ=3.407円、1ドミニカ・ペソ=2.482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(25,218,677千円)の投資信託財産総額(26,140,817千円)に対する比率は、96.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,561,945,506円
コール・ローン等	43,890,162
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	7,518,055,344
(B) 負債	27,524,953
未払解約金	19,038,470
未払信託報酬	8,206,792
その他未払費用	279,691
(C) 純資産総額(A-B)	7,534,420,553
元本	6,355,624,516
次期繰越損益金	1,178,796,037
(D) 受益権総口数	6,355,624,516口
1万口当り基準価額(C/D)	11,855円

* 期首における元本額は4,632,396,845円、当作成期間中における追加設定元本額は3,083,624,954円、同解約元本額は1,360,397,283円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,855円です。

■損益の状況

当期 自 2021年7月6日 至 2022年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,309円
受取利息	463
その他収益金	622
支払利息	△ 6,394
(B) 有価証券売買損益	△ 18,425,951
売買益	34,834,020
売買損	△ 53,259,971
(C) 信託報酬等	△ 16,022,172
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 34,453,432
(E) 前期繰越損益金	241,142,921
(F) 追加信託差損益金	972,106,548
(配当等相当額)	(680,165,181)
(売買損益相当額)	(291,941,367)
(G) 合計(D+E+F)	1,178,796,037
次期繰越損益金(G)	1,178,796,037
追加信託差損益金	972,106,548
(配当等相当額)	(680,165,181)
(売買損益相当額)	(291,941,367)
分配準備積立金	241,146,186
繰越損益金	△ 34,456,697

(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	0
(c) 収益調整金	937,658,425
(d) 分配準備積立金	241,146,186
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,178,804,611
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,178,804,611
(h) 受益権総口数	6,355,624,516口

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2022年7月5日）

（作成対象期間 2021年7月6日～2022年7月5日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

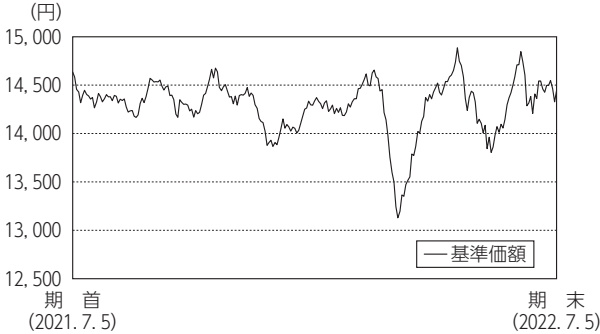
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：14,635円 期末：14,445円 騰落率：△1.3%

【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）したことがプラス要因となった一方で、金利が上昇（債券価格は下落）したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。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

○新興国債券市場

新興国債券市場は、多くの国で金利が上昇しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より横ばいで推移したものの、2021年9月には、F R B（米連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから金利は上昇し、債券価格は下落しました。その後も、供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことや、F R B議長が毎会合での利上げの可能性を否定しなかったことから利上げの織り込みが加速し、金利は上昇しました。2022年2月後半には、ロシアがウクライナに侵攻したことなど投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は大幅に上昇しました。当作成期末にかけても、各国で積極的な利上げの観測が高まったことなどから、金利はさらに上昇しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より新型コロナウイルスの感染拡大により円に対して下落（円高）したものの、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、世界経済への楽観的な見方が強まったことで上昇に転じました。その後は、商品価格の上昇によるインフレ圧力の高まりを受けて各国が利上げを実施する中で、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、日本と各国の金融政策の相違がより明確となって、新興国通貨は対円で大きく上昇しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.3%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

*ベンチマークはJ P Morgan 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。

【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。

年 月 日	基準 価 額		J P MORGAN 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) 2021年7月5日	円	%	円	%	%
	14,635	—	15,713	—	97.1
7月末	14,403	△ 1.6	15,504	△ 1.3	96.7
8月末	14,465	△ 1.2	15,557	△ 1.0	96.6
9月末	14,294	△ 2.3	15,382	△ 2.1	96.6
10月末	14,377	△ 1.8	15,487	△ 1.4	96.7
11月末	13,908	△ 5.0	14,929	△ 5.0	96.0
12月末	14,293	△ 2.3	15,372	△ 2.2	97.3
2022年1月末	14,273	△ 2.5	15,337	△ 2.4	96.8
2月末	14,142	△ 3.4	15,403	△ 2.0	97.4
3月末	14,403	△ 1.6	15,387	△ 2.1	96.5
4月末	14,374	△ 1.8	15,170	△ 3.5	95.7
5月末	14,297	△ 2.3	15,433	△ 1.8	96.0
6月末	14,549	△ 0.6	15,689	△ 0.2	96.9
(期末) 2022年7月5日	14,445	△ 1.3	15,584	△ 0.8	96.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J P Morgan 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 Morgan 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 Morgan 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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■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 (11)
(その他)	(3)
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

(2021年7月6日から2022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 52,664	千エジプト・ポンド (—)
	トルコ	千トルコ・リラ 9,915	千トルコ・リラ (9,970)
国	メキシコ	千メキシコ・ペソ 122,564	千メキシコ・ペソ (49,642)
	チリ	千チリ・ペソ 1,139,508	千チリ・ペソ (181,857)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 10,732,817	千コロンビア・ペソ (3,697,994)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 67,063,170	千インドネシア・ルピア (40,365,782)

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

買 付		当 期	売 付	
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	151,198		Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	209,806
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	149,929		Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	159,570
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 1% 2027/6/17	142,014		Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2023/1/25	132,408
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	140,106		Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2022/9/23	105,665
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	135,753		Colombian TES (コロンビア) 7% 2022/5/4	104,290
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.5% 2037/1/31	130,732		Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 3.948% 2022/4/14	94,312
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	127,532		Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	93,023
China Government Bond (中国) 3.02% 2031/5/27	125,668		Thailand Government Bond (タイ) 2% 2022/12/17	91,955
Thailand Government Bond (タイ) 2% 2031/12/17	122,269		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7% 2022/5/15	90,178
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.75% 2048/2/28	108,189		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	88,072

(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。

		買 付 額	売 付 額
外	ブラジル	千ブラジル・レアル 36,864	千ブラジル・レアル (20,695)
	チェコ	千チェコ・コルナ 101,016	千チェコ・コルナ (14,302)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 14,036	千ルーマニア・レイ (2,774)
	中国	千オフショア・人民元 23,805	千オフショア・人民元 (22,312)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 226,399	千ロシア・ルーブル (69,128)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 36,957	千マレーシア・リンギット (9,194)
国	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 123,999	千南アフリカ・ランド (19,292)
	タイ	千タイ・バーツ 256,179	千タイ・バーツ (64,749)
	ペルー	千ペルー・ソル 3,058	千ペルー・ソル (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 20,115	千ポーランド・ズロチ (13,767)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 813,731	千ハンガリー・フォリント (361,490)

(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。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期 区分	当期				期末			
	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
エジプト	千エジプト・ポンド 52,500	千エジプト・ポンド 50,411	千円 363,803	1.4%	1.4%	0.5%	0.9%	—%
トルコ	千トルコ・リラ 35,120	千トルコ・リラ 27,594	223,628	0.9	0.9	0.3	0.4	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 398,550	千メキシコ・ペソ 374,878	2,519,855	9.9	—	4.5	4.2	1.2
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,743	24,080	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 3,815,000	千チリ・ペソ 3,474,882	509,932	2.0	—	1.1	0.7	0.1
コロンビア	千コロンビア・ペソ 39,925,000	千コロンビア・ペソ 31,972,041	1,038,931	4.1	—	2.7	1.3	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 270,129,000	千インドネシア・ルピア 276,003,589	2,511,632	9.8	—	6.3	2.4	1.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 105,350	千ブラジル・レアル 91,705	2,341,904	9.2	—	1.1	2.2	5.8
チェコ	千チェコ・コルナ 257,800	千チェコ・コルナ 218,783	1,256,540	4.9	—	2.5	1.9	0.5
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 32,480	千ルーマニア・レイ 27,674	794,978	3.1	—	1.2	0.7	1.2
中国	千オフショア・人民元 122,950	千オフショア・人民元 125,027	2,541,692	9.9	—	4.8	3.4	1.7
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,194,420	千ロシア・ルーブル —	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 84,780	千マレーシア・リンギット 82,564	2,545,591	10.0	—	5.3	3.3	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 352,590	千南アフリカ・ランド 296,379	2,474,766	9.7	—	7.7	1.7	0.3
タイ	千タイ・バーツ 682,360	千タイ・バーツ 667,003	2,541,282	9.9	—	5.5	2.9	1.5
ペルー	千ペルー・ソル 18,100	千ペルー・ソル 16,507	587,207	2.3	—	2.0	0.3	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 67,260	千ポーランド・ズロチ 55,634	1,676,102	6.6	—	2.5	3.1	1.0
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,753,800	千ハンガリー・フォリント 2,093,349	739,454	2.9	—	1.3	1.1	0.4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 8,550	29,137	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,730	26,637	0.1	0.1	—	0.1	—
合計	—	—	24,747,159	96.7	2.4	49.6	30.7	16.5

(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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

(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	
					当	期	末	
				%	千エジプト・ポンド	千エジプト・ポンド	千円	
エジプト		ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	1,500	1,470	10,609	2029/05/07
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	988	7,135	2024/09/10
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	3,650	26,345	2029/09/10
		ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,449	10,461	2025/01/14
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	4,280	30,889	2030/10/06
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,973	14,239	2027/10/13
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	8,691	62,721	2025/10/20
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	5,571	40,204	2028/01/05
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	10,000	9,656	69,687	2026/01/12
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	8,735	63,038	2026/04/06
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	969	6,995	2026/07/06
		ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	3,000	2,975	21,472	2024/09/14
	通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			52,500	50,411	363,803
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,524	20,460	2023/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	572	4,638	2024/03/20
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,294	10,487	2024/07/24
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	1,970	15,971	2025/03/12
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,866	15,128	2026/02/11
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,227	18,053	2027/02/24
		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,872	15,175	2027/08/11
		Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,600	12,966	2028/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	2,800	2,659	21,551	2023/06/14
		Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	6,100	4,843	39,253	2025/10/01
		Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	6,162	49,941	2030/11/13
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄			35,120	27,594	223,628	
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	52,400	46,605	313,270	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	29,300	26,207	176,162	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	41,000	39,908	268,260	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,500	17,205	115,649	2023/03/09
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	13,000	11,173	75,103	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,700	1,525	10,255	2025/03/06
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	26,739	179,740	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	26,918	180,939	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	36,230	33,879	227,732	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	11,890	12,851	86,382	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	31,730	30,860	207,438	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,100	27,684	186,090	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	44,350	40,963	275,350	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	26,120	22,906	153,972	2042/11/13

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	
		Mexican Bonos	国債証券	%	千メキシコ・ペソ 10,430	千メキシコ・ペソ 9,448	千円 63,507	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			398,550	374,878	2,519,855	
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,743	24,080	2036/01/14
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄			10,000	9,743	24,080	
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 470,025	68,975	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	504,723	74,067	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	510,000	491,900	72,185	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	613,143	89,977	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	242,287	35,555	2023/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	850,000	769,428	112,912	2025/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	197,750	29,019	2028/10/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	185,624	27,239	2028/10/01
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			3,815,000	3,474,882	509,932	
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 88,662	2,881	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	43,025	1,398	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,844,032	124,911	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	4,870,000	3,830,108	124,459	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	4,710,000	4,209,750	136,795	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	2,927,556	95,130	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,451,881	112,168	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,372,787	77,103	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	4,200,000	3,040,464	98,799	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,534,624	82,362	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	7.2500	2,310,000	1,465,048	47,606	2050/10/26
		Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,208,609	39,273	2036/07/09
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	2,300,000	1,747,977	56,800	2031/03/26
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	1,500,000	1,207,515	39,238	2042/05/28
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			39,925,000	31,972,041	1,038,931	
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 8,250,000	千インドネシア・ルピア 8,711,670	79,276	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,000,000	8,677,120	78,961	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,536,960	50,386	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,273,647	66,190	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,529,200	95,815	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,700,000	5,010,811	45,598	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,767,760	116,186	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,167,725	128,926	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	12,400,000	12,696,732	115,540	2025/06/15

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	当 期		末		償還年月日
				年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					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	9,300,000	9,322,506	84,834	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	11,500,000	11,491,720	104,574	2040/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,147,280	128,740	2026/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,075,096	137,183	2031/02/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	4,300,000	3,881,438	35,321	2036/06/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	12,600,000	11,823,714	107,595	2032/04/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	9,000,000	8,619,210	78,434	2027/04/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	5,700,000	5,627,496	51,210	2042/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,116,312	37,458	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,680,000	5,556,283	50,562	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,375,405	30,716	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,845,431	125,993	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,006,025	45,554	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	12,879,837	117,206	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	6,910,000	7,006,256	63,756	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,218,366	102,087	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,681,630	60,802	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,314,018	121,157	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,947,496	145,122	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	11,696,443	106,437	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金額				270,129,000	276,003,589	2,511,632	
ブラジル					千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,710	10,529	268,880	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,890	10,261	262,047	2025/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,950	9,926	253,505	2027/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	8,100	7,082	180,865	2029/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	3,922	100,170	2031/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	19,300	16,986	433,776	2024/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	27,700	22,968	586,550	2024/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	10,200	7,997	204,238	2024/07/01
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	2,900	2,031	51,869	2025/07/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				105,350	91,705	2,341,904	
チェコ					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	19,600	17,223	98,920	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,033	69,113	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,257	110,603	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	15,209	87,353	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	12,230	70,243	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	11,900	11,028	63,338	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	18,056	103,706	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	18,000	15,951	91,612	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,850	85,288	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	16,200	12,376	71,083	2031/03/13

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円		
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	7,169	41,178	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	9,500	9,177	52,711	2036/12/04	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	14,500	11,393	65,435	2032/06/23	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	15,547	89,291	2025/02/14	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	6,294	36,151	2040/04/24	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,346	24,961	2024/12/12	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,000	5,460	31,358	2035/05/30	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	11,000	11,176	64,187	2026/02/26	
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		257,800	218,783	1,256,540		
				千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ			
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,399	40,196	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,044	30,007	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	1,852	53,223	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,459	41,923	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,441	41,398	2023/06/28	
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,118	60,843	2029/02/12	
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,405	40,362	2026/04/22	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	1,989	57,138	2031/09/24	
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	2,500	2,316	66,550	2024/06/17	
	Romania Government Bond	国債証券	4.4000	2,400	2,287	65,700	2023/09/25	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,304	37,473	2025/07/28	
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,600	1,513	43,468	2023/10/25	
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,283	36,861	2028/01/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	1,300	1,164	33,453	2024/11/25	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,728	49,650	2026/06/24	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	1,843	52,951	2030/10/24	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	558	16,049	2034/10/11	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	965	27,727	2027/10/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		32,480	27,674	794,978		
				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元			
中国	China Government Bond	国債証券	3.2900	2,700	2,741	55,734	2023/10/18	
	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,782	76,901	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,927	100,179	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,067	82,680	2024/04/11	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,087	123,760	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,921	100,056	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,288	87,174	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,795	117,822	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,557	92,651	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,837	98,341	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	7,874	160,090	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,417	130,467	2025/04/09	
	China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,169	125,415	2023/07/02	

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	当 期		末			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					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	2.8800	4,900	4,945	100,538	2023/11/05	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,109	144,525	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,152	104,745	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,493	132,005	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,965	80,624	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,253	127,129	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,038	82,091	2024/04/08	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,061	102,887	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,124	43,186	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,063	143,588	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	2,500	2,505	50,943	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,809	36,781	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,034	21,022	2051/10/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	1,000	1,000	20,344	2031/11/18	
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄		122,950	125,027	2,541,692		
ロシア				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル			
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,400	—	—	2023/01/25	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	—	—	2028/01/19	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	—	—	2023/08/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	43,000	—	—	2031/09/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	54,000	—	—	2022/12/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	2026/10/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	—	—	2024/07/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	—	—	2025/11/12	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	—	—	2030/04/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	—	—	2039/03/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	68,000	—	—	2027/10/06	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17	
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23	
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	50,000	—	—	2029/03/14	
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄		1,194,420	—	—		
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,814	55,940	2027/07/26	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,023	62,402	2023/11/30	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期				未		
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,536	109,026	2028/10/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,936	59,706	2025/08/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,601	49,377	2029/07/09	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	3,700	3,724	114,847	2024/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,212	129,869	2026/03/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	4,788	147,648	2030/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,300	2,237	68,991	2027/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,721	83,917	2036/07/15	
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	2,100	1,975	60,900	2041/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,396	73,875	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	2,500	2,508	77,332	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,250	3,179	98,019	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,771	54,617	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,450	4,488	138,378	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,212	68,221	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,409	43,468	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,798	117,110	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,748	53,916	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,506	77,280	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,645	81,579	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,500	1,516	46,754	2025/03/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,407	43,405	2023/04/20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,005	61,832	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,891	89,149	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,312	102,137	2024/06/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,000	1,857	57,280	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,100	2,710	83,558	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	3,600	3,135	96,661	2050/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,541	78,361	2031/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,000	950	29,309	2032/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	1,000	996	30,710	2032/10/07	
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		84,780	82,564	2,545,591		
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	47,950	50,922	425,206	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	14,720	9,607	80,224	2036/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	13,280	8,202	68,489	2041/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	19,540	15,462	129,107	2031/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,880	8,950	74,734	2023/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	45,520	35,298	294,742	2048/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	36,400	28,887	241,206	2037/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	45,900	40,089	334,743	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	27,600	21,574	180,150	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	34,900	29,387	245,386	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	34,800	29,285	244,537	2035/02/28	

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		
				%	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	9.0000	23,100	18,711	156,236	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				352,590	296,379	2,474,766	
					千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	41,091	156,560	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	23,864	90,923	2023/06/16	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	33,421	127,334	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	28,700	30,816	117,410	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	29,549	112,583	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	35,400	35,138	133,875	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	37,500	40,898	155,822	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	29,729	113,268	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	37,500	38,088	145,118	2023/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	26,944	102,659	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	40,500	39,659	151,103	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	42,000	41,598	158,490	2024/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	33,923	129,248	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	12,779	48,690	2035/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	34,000	33,000	125,732	2025/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	39,900	39,205	149,373	2024/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	26,970	102,757	2035/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	44,000	41,586	158,443	2031/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,699	56,003	2042/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	41,000	38,390	146,267	2027/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	16,000	15,647	59,615	2024/09/17	
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金 額				682,360	667,003	2,541,282	
					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	724	25,789	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,704	96,205	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	2,550	2,256	80,284	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	2,700	2,465	87,717	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,657	58,950	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	750	26,702	2040/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,632	58,070	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	1,873	66,646	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	2,570	2,441	86,840	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				18,100	16,507	587,207	
					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	7,490	6,313	190,212	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,274	128,770	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,700	4,328	130,411	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	8,250	6,485	195,382	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	5,000	4,480	134,976	2024/10/25	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,700	3,982	119,988	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,781	113,938	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	5,700	4,329	130,423	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,500	1,656	49,897	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,700	1,479	44,578	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	4,530	4,350	131,081	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,700	4,652	140,160	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,519	166,279	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		67,260	55,634	1,676,102	
ハンガリー				千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	89,293	31,541	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	132,348	46,750	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	103,307	36,492	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	81,587	28,819	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	158,782	56,088	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	220,000	193,721	68,430	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	189,080	66,790	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	37,600	13,281	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	200,000	157,550	55,652	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	111,239	39,294	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	132,479	46,796	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	92,738	32,758	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	128,290	45,317	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	76,502	27,023	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	70,000	36,554	12,912	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	42,712	15,087	2034/06/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	201,800	197,693	69,833	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	131,869	46,581	2025/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		2,753,800	2,093,349	739,454	
ウルグアイ				千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,555	8,706	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	5,995	20,430	2031/05/21
通貨小計	銘柄数 金 額	2銘柄		9,800	8,550	29,137	
ドミニカ共和国				千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	10,730	26,637	2026/06/05
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		11,000	10,730	26,637	
合 計	銘柄数 金 額	294銘柄				24,747,159	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	24,747,159	94.7
コール・ローン等、その他	1,393,658	5.3
投資信託財産総額	26,140,817	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=136.14円、1エジプト・ポンド=7.216円、1トルコ・リラ=8.104円、1メキシコ・ペソ=6.721円、1フィリピン・ペソ=2.471円、1アルゼンチン・ペソ=1.08円、100チリ・ペソ=14.674円、100コロンビア・ペソ=3.249円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・レアル=25.537円、1チエコ・コルナ=5.743円、1ルーマニア・レイ=28.726円、1オフショア・人民元=20.329円、1マレーシア・リンギット=30.831円、1南アフリカ・ランド=8.35円、1タイ・バーツ=3.81円、1ペルー・ソル=35.572円、1ポーランド・ズロチ=30.126円、100ハンガリー・フォリント=35.324円、1ウルグアイ・ペソ=3.407円、1ドミニカ・ペソ=2.482円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(25,218,677千円)の投資信託財産総額(26,140,817千円)に対する比率は、96.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	26,344,678,768円
コール・ローン等	1,017,664,060
公社債(評価額)	24,747,159,762
未収入金	207,480,589
未収利息	336,198,173
前払費用	36,176,184
(B) 負債	764,727,310
未払金	727,092,262
未払解約金	37,629,108
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額(A-B)	25,579,951,458
元本	17,708,826,793
次期繰越損益金	7,871,124,665
(D) 受益権総口数	17,708,826,793口
1万口当り基準価額(C/D)	14,445円

* 期首における元本額は14,553,919,275円、当作成期間中における追加設定元本額は3,933,705,045円、同解約元本額は778,797,527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)	236,473,927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)	320,249,481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)	332,025,577円
D-1's 新興国債券インデックス	59,523,115円
iFree 新興国債券インデックス	5,204,607,369円
iFree 8資産バランス	3,623,504,790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)	734,959円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	7,754,073,709円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	145,588,599円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	32,045,267円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,445円です。

■損益の状況

当期 自 2021年7月6日 至 2022年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,340,788,071円
受取利息	1,340,855,602
その他収益金	1,552
支払利息	△ 69,083
(B) 有価証券売買損益	1,524,211,635
売買益	3,946,750,939
売買損	△ 5,470,962,574
(C) その他費用	△ 23,867,804
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 207,291,368
(E) 前期繰越損益金	6,745,631,134
(F) 解約差損益金	△ 335,242,681
(G) 追加信託差損益金	1,668,027,580
(H) 合計(D+E+F+G)	7,871,124,665
次期繰越損益金(H)	7,871,124,665

(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。