

# ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用)

## 運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2023年11月20日)

(作成対象期間 2022年11月22日～2023年11月20日)

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限 (設定日: 2022年2月18日)		
運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			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	純資産額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率		
1 期末(2022年11月21日)	円 10,053	円 0	% 0.5	10,138	% 1.4	% 96.6	百万円 2
2 期末(2023年11月20日)	12,238	0	21.7	12,242	20.8	96.3	7

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、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 (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。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 (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。

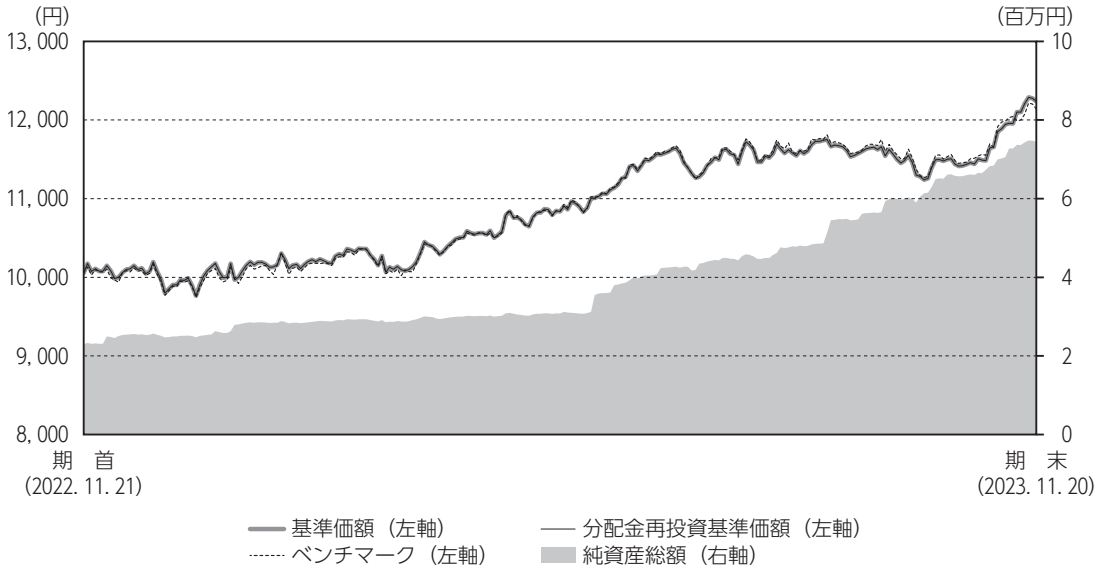
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### 基準価額・騰落率

期 首：10,053円

期 末：12,238円（分配金0円）

騰落率：21.7%（分配金込み）

#### 基準価額の変動要因

「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、主に新興国債に投資した結果、投資対象国の債券価格はおおむね上昇し、さらに投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したこともプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公 社 債 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%
(期首)2022年11月21日	10,053	—	10,138	—	96.6
11月末	10,147	0.9	10,189	0.5	95.9
12月末	9,892	△ 1.6	9,962	△ 1.7	95.4
2023年 1月末	10,168	1.1	10,236	1.0	96.3
2月末	10,297	2.4	10,347	2.1	96.3
3月末	10,449	3.9	10,509	3.7	96.2
4月末	10,581	5.3	10,651	5.1	96.3
5月末	10,900	8.4	10,992	8.4	96.1
6月末	11,578	15.2	11,703	15.4	95.2
7月末	11,600	15.4	11,724	15.6	96.5
8月末	11,753	16.9	11,911	17.5	95.7
9月末	11,485	14.2	11,605	14.5	95.9
10月末	11,485	14.2	11,650	14.9	96.3
(期末)2023年11月20日	12,238	21.7	12,242	20.8	96.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2022. 11. 22 ~ 2023. 11. 20）

### 新興国債券市況

新興国債券市場は、ブラジルを筆頭に金利は低下（債券価格は上昇）しました。

当作成期首より、米国金利が低下したことなどから、新興国債券金利は低下しました。2023年1月以降は、米国金利が低下する中、新興国債券金利も低下基調で推移しました。しかし5月に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇（債券価格は下落）し、新興国金利も上昇しました。7月から8月にかけて、底堅い経済指標を背景に利上げの継続スタンスが意識されたことなどをを受けて米国国債利回りは上昇し、新興国債券市場も同様に上昇しました。9月から当作成期末にかけても、引き続き米国金利の上昇に連れられ、新興国債券金利は上昇しました。

### 為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、米国金利が低下したことなどから日米金利差の縮小により円高米ドル安が進行し、新興国通貨の多くは対円で下落（円高）しました。2023年1月以降の新興国通貨は強弱まちまちで推移しましたが、3月は米国の地方銀行の経営破綻により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、インドネシア・ルピアを筆頭に多くの通貨が対円で下落しました。4月以降は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、新興国通貨も円に対し上昇基調で推移しました。9月以降も、中国の過度な景気減速懸念が後退したことなどから対円で上昇し、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

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

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

（2022. 11. 22 ～ 2023. 11. 20）

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

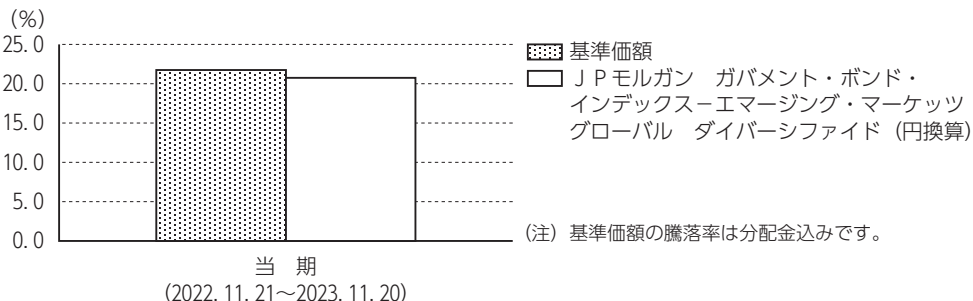
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）

## 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20.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は21.7%となりました。

マザーファンドで組み入れている債券ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買に伴う費用などがかい離の要因として挙げられます。

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 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ため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年11月22日 ～2023年11月20日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,237

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022. 11. 22～2023. 11. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0. 230%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 888円です。
（投 信 会 社）	(21)	(0. 197)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(1)	(0. 011)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(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	11	0. 098	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(10)	(0. 088)	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. 009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	36	0. 328	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

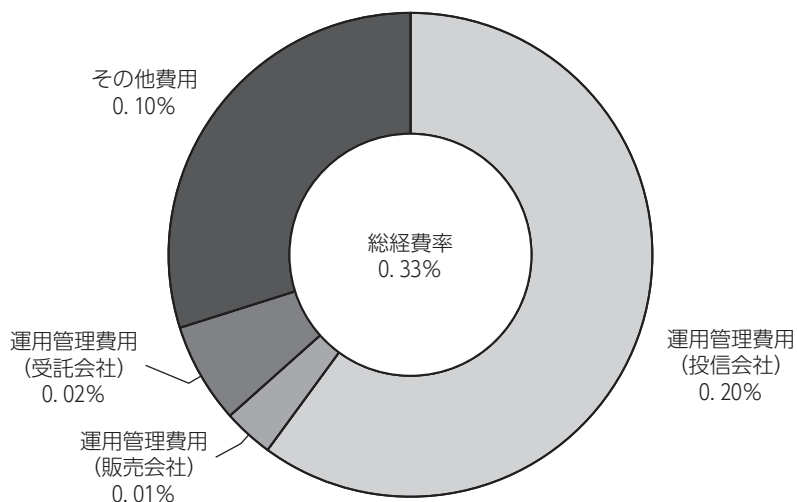
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.33%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## 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）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2022年11月22日から2023年11月20日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	2,698	4,471	130	210

（注）単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

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

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	□ 数	評 価 額
	□ 数	千□	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1,554	4,122	7,428

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2023年11月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	7,428	99.6
コール・ローン等、その他	27	0.4
投資信託財産総額	7,456	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.95円、1エジプト・ポンド=4.849円、1トルコ・リラ=5.234円、1メキシコ・ペソ=8.704円、1フィリピン・ペソ=2.692円、1アルゼンチン・ペソ=0.423円、100チリ・ペソ=16.87円、100コロンビア・ペソ=3.662円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=30.529円、1チェコ・コルナ=6.667円、1ルーマニア・レイ=32.887円、1オフショア・人民元=20.758円、1マレーシア・リンギット=32.015円、1南アフリカ・ランド=8.17円、1タイ・バーツ=4.27円、1ペルー・ソル=39.828円、1ポーランド・ズロチ=37.264円、100ハンガリー・フォリント=43.119円、1ウルグアイ・ペソ=3.786円、1ドミニカ・ペソ=2.636円、1ユーロ=163.54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（40,552,088千円）の投資信託財産総額（41,272,213千円）に対する比率は、98.3%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月20日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	7,456,132円
コール・ローン等	27,759
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	7,428,373
(B)負債	5,971
未払信託報酬	5,788
その他未払費用	183
(C)純資産総額（A－B）	7,450,161
元本	6,087,911
次期繰越損益金	1,362,250
(D)受益権総口数	6,087,911□
1万口当り基準価額（C/D）	12,238円

\*期首における元本額は2,289,338円、当作成期間中における追加設定元本額は4,066,516円、同解約元本額は267,943円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,238円です。

■損益の状況

当期 自 2022年11月22日 至 2023年11月20日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	850,330円
売買益	873,316
売買損	△ 22,986
(B) 信託報酬等	△ 9,287
(C) 当期損益金 (A + B)	841,043
(D) 前期繰越損益金	24,474
(E) 追加信託差損益金	496,733
(配当等相当額)	( 46,036)
(売買損益相当額)	( 450,697)
(F) 合計 (C + D + E)	1,362,250
次期繰越損益金 (F)	1,362,250
追加信託差損益金	496,733
(配当等相当額)	( 46,036)
(売買損益相当額)	( 450,697)
分配準備積立金	865,517

(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	841,043
(c) 収益調整金	496,733
(d) 分配準備積立金	24,474
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,362,250
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,362,250
(h) 受益権総口数	6,087,911口

## ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2023年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年11月20日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

（2022年11月22日から2023年11月20日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/7/1	674,817	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	1,033,090
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/1/1	400,296	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	431,002
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 7.5% 2028/7/25	292,896	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25	197,143
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	235,616	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2023/12/7	186,990
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	197,952	Thailand Government Bond (タイ) 2.4% 2023/12/17	151,324
MEXICAN BONOS (メキシコ) 5.5% 2027/3/4	191,034	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2024/3/15	148,644
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7.5% 2033/5/26	188,877	Poland Government Bond (ポーランド) 4% 2023/10/25	144,004
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.65% 2028/6/17	170,026	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.875% 2035/2/28	98,830
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.35% 2026/6/17	166,556	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.125% 2024/5/15	97,796
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.875% 2035/2/28	163,566	China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	96,933

（注1）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2023年11月20日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（22,790,213千円）の内容です。

#### (1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期	2023年11月20日現在								
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
エジプト	千エジプト・ポンド 97,293	千エジプト・ポンド 77,875	千円 377,631	%	%	%	%	%	
トルコ	千トルコ・リラ 52,860	千トルコ・リラ 34,376	千円 179,928	%	%	%	%	%	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 512,900	千メキシコ・ペソ 470,890	千円 4,098,821	%	%	%	%	%	
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,514	千円 25,620	%	%	%	%	%	
チリ	千チリ・ペソ 4,535,000	千チリ・ペソ 4,410,091	千円 743,986	%	%	%	%	%	
コロンビア	千コロンビア・ペソ 55,180,000	千コロンビア・ペソ 47,600,872	千円 1,743,143	%	%	%	%	%	

区 分	額 面 金 額	2023年11月20日現在						
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
インドネシア	千インドネシア・ルピア 400,169,000	千インドネシア・ルピア 411,399,964	千円 3,990,579	% 9.7	% —	% 6.8	% 2.3	% 0.6
ブラジル	千ブラジル・レアル 150,440	千ブラジル・レアル 132,741	4,052,481	9.9	—	2.2	4.7	3.0
チェコ	千チェコ・コルナ 404,300	千チェコ・コルナ 368,227	2,455,265	6.0	—	3.9	1.4	0.7
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 47,150	千ルーマニア・レイ 44,265	1,455,787	3.5	—	1.7	1.1	0.7
中国	千オフショア・人民元 185,500	千オフショア・人民元 189,264	3,928,786	9.6	—	5.0	3.2	1.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 121,780	千マレーシア・リンギット 122,510	3,922,252	9.6	—	4.9	2.9	1.8
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 502,210	千南アフリカ・ランド 415,625	3,395,664	8.3	—	6.9	1.4	—
タイ	千タイ・バーツ 946,060	千タイ・バーツ 929,487	3,968,911	9.7	—	5.5	2.5	1.6
ペルー	千ペルー・ソル 23,860	千ペルー・ソル 23,156	922,313	2.2	—	1.8	0.3	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 87,530	千ポーランド・ズロチ 80,444	2,997,730	7.3	—	2.0	3.5	1.8
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,477,000	千ハンガリー・フォリント 2,973,659	1,282,227	3.1	—	1.1	1.4	0.6
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 20,800	千ウルグアイ・ペソ 20,191	76,459	0.2	—	0.2	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 22,400	千ドミニカ・ペソ 24,032	63,358	0.2	0.2	0.1	0.1	—
合計	—	—	39,680,951	96.6	1.5	51.2	30.2	15.2

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月20日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

## (2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	2023年11月20日現在				償 還 年 月 日	
				評 価 額		額 面 金 額	償 還 年 月 日		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額				
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド	1,500	千エジプト・ポンド	1,102	5,346	2029/05/07
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500		1,000		919	4,456	2024/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000		4,000		2,710	13,141	2029/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360		1,500		1,320	6,402	2025/01/14
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640		4,500		2,984	14,471	2030/10/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560		9,500		6,968	33,789	2027/10/13
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690		14,693		12,263	59,468	2025/10/20
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920		6,000		4,369	21,190	2028/01/05
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600		36,300		29,536	143,230	2026/01/12
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830		9,000		7,253	35,173	2026/04/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630		1,000		796	3,864	2026/07/06

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2023年11月20日現在

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310%	千エジプト・ポンド 8,300	千エジプト・ポンド 7,649	千円 37,095	2024/09/14
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		97,293	77,875	377,631	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	千トルコ・リラ 1,630	千トルコ・リラ 1,404	7,350	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	1,968	10,305	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	5,570	3,707	19,406	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	1,747	9,145	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	5,257	27,519	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	5,000	2,931	15,342	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	9,100	6,252	32,725	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	4,899	25,643	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	6,207	32,490	2026/09/02
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		52,860	34,376	179,928	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 48,132	418,960	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	37,300	31,984	278,404	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	39,000	38,179	332,329	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	40,500	35,968	313,080	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	25,700	24,146	210,182	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	26,500	22,593	196,664	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	25,800	22,741	197,954	2033/05/26
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	14,500	13,579	118,197	2026/09/03
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	7,000	6,775	58,979	2029/03/01
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	30,550	30,307	263,808	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	40,030	37,607	327,349	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	9,390	9,796	85,271	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	35,230	34,009	296,030	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	25,100	23,059	200,715	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	55,350	50,557	440,070	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	38,120	32,187	280,175	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,265	80,646	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄		512,900	470,890	4,098,821	
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 9,514	25,620	2036/01/14
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		10,000	9,514	25,620	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 484,195	81,684	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	720,000	673,416	113,605	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	651,905	109,977	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	644,338	108,700	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	947,420	159,830	2025/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	80,000	68,787	11,604	2028/10/01

2023年11月20日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000%	千ペソ 200,000	千ペソ 194,976	千円 32,892	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	239,844	40,461	2034/05/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	500,000	505,210	85,229	2033/04/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金額			4,535,000	4,410,091	743,986	
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 85,407	3,127	2027/06/28
	Colombian TES	国債証券	10.0000	2,750,000	2,751,127	100,746	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	5,570,000	4,766,304	174,542	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	5,084,696	186,201	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	3,154,248	115,508	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,711,165	135,902	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	3,700,000	3,462,460	126,795	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,900,000	3,809,897	139,518	2034/10/18
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,759,648	101,058	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,510,000	3,057,148	111,952	2050/10/26
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,306,744	47,852	2036/07/09
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,452,948	163,066	2031/03/26
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	5,700,000	4,872,132	178,417	2042/05/28
	COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	3,800,000	4,326,946	158,452	2033/02/09
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金額			55,180,000	47,600,872	1,743,143	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア 11,250,000	千インドネシア・ルピア 12,563,100	121,862	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,000,000	8,924,960	86,572	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,736,335	55,642	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,754,352	75,217	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,000,000	6,801,300	65,972	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	17,000,000	18,180,990	176,355	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	19,800,000	20,010,078	194,097	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	19,700,000	19,674,193	190,839	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	13,300,000	14,039,746	136,185	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	17,500,000	18,471,950	179,177	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	18,100,000	17,651,844	171,222	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	26,300,000	25,972,302	251,931	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	7,019,315	68,087	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	26,300,000	25,691,944	249,211	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	15,700,000	15,087,857	146,352	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	14,200,000	14,339,444	139,092	2042/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,601,639	25,235	2037/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	19,800,000	20,296,188	196,873	2033/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	16,100,000	15,956,066	154,773	2028/08/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	10,300,000	10,624,450	103,057	2043/06/15
INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	8,200,000	8,399,916	81,479	2038/06/15	
INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.6250	3,300,000	3,300,924	32,018	2034/02/15	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2023年11月20日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	千インドネシア・ルピア 6,400,000	千インドネシア・ルピア 6,855,296	千円 66,496	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,151,953	40,273	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,439,972	33,367	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	16,324,000	17,046,989	165,355	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,189,422	50,337	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	16,030,000	16,223,642	157,369	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	13,950,000	13,690,111	132,794	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	14,075,000	13,855,570	134,399	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	17,920,000	20,164,838	195,598	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	11,683,274	113,327	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	32銘柄					
	金額			400,169,000	411,399,964	3,990,579	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 12,890	千ブラジル・レアル 12,821	391,416	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	16,350	16,194	494,415	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	16,800	16,333	498,642	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	6,300	6,022	183,867	2031/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOIRO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	7,300	6,889	210,331	2033/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	14,600	13,707	418,465	2024/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	15,500	13,236	404,091	2025/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	24,700	20,073	612,818	2026/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	31,000	23,983	732,195	2026/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	5,000	3,479	106,237	2027/07/01
通貨小計	銘柄数	10銘柄					
	金額			150,440	132,741	4,052,481	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	千チェコ・コルナ 26,600	千チェコ・コルナ 24,616	164,141	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	20,228	134,880	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	27,400	25,108	167,418	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	27,500	22,364	149,121	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	19,784	131,915	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	24,500	22,632	150,906	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	29,500	23,982	159,913	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	22,700	18,320	122,158	2031/03/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	15,500	12,082	80,563	2029/11/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	13,500	13,205	88,051	2036/12/04
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	29,500	24,137	160,941	2032/06/23
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	16,679	111,216	2025/02/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	6,597	43,990	2040/04/24
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,746	31,649	2024/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	13,500	12,417	82,795	2035/05/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	15,500	16,090	107,286	2026/02/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	26,000	27,082	180,583	2030/09/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	20,500	21,694	144,652	2028/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	6,000	4,506	30,045	2037/07/30



2023年11月20日現在

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000%	千チェコ・コルナ 10,000	千チェコ・コルナ 10,432	千円 69,560	2034/04/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	7,000	7,477	49,857	2029/03/29
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2000	8,000	8,982	59,894	2031/06/16
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	5,000	5,057	33,722	2032/11/11
通貨小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			404,300	368,227	2,455,265	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	千ルーマニア・レイ 2,450	千ルーマニア・レイ 2,411	79,321	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,735	89,968	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,397	78,842	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,425	79,782	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,330	76,637	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	2,500	2,477	81,487	2024/06/17
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,221	73,064	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,460	48,019	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	2,200	2,155	70,892	2024/11/25
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,960	64,462	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,141	70,434	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,224	73,154	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	1,989	65,439	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,097	68,984	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	2,000	1,965	64,651	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,300	1,759	57,880	2036/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,909	62,792	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	2,100	2,265	74,492	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	1,700	1,835	60,371	2028/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	1,200	1,267	41,676	2030/04/29
ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	2,100	2,232	73,430	2038/02/24	
通貨小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			47,150	44,265	1,455,787	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 3,700	千オフショア・人民元 3,779	78,455	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,978	103,346	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,149	127,647	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,927	102,290	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,298	89,237	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,895	122,382	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,531	94,071	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,864	100,981	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	8,015	166,382	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,466	134,230	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,107	147,540	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,178	107,505	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,598	136,971	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,969	82,399	2026/03/11

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2023年11月20日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,632	137,686	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,118	106,254	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,253	46,777	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,201	149,483	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	2,500	2,521	52,336	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	3,900	3,907	81,118	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,832	38,044	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,097	22,784	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,557	73,838	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,796	58,052	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,016	62,607	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,544	73,582	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,201	45,694	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	2,000	2,112	43,855	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,518	52,282	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,628	75,326	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,705	76,922	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,005	62,379	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,890	80,765	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,589	33,002	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,301	68,530	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,196	66,344	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,218	25,284	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,741	77,661	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	2,994	62,167	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,027	62,853	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,200	3,223	66,921	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,605	54,084	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,553	52,995	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,735	77,544	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,319	68,914	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	1,200	1,255	26,053	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,199	66,423	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	2,997	62,224	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	3,000	2,988	62,031	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	2,000	1,994	41,411	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,016	21,095	2053/10/15
通貨小計	銘柄数	51銘柄					
	金 額			185,500	189,264	3,928,786	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	90,685	2026/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	2,800	2,832	58,678	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,592	115,031	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,920	61,494	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	2,900	2,935	93,991	2029/07/09

2023年11月20日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	2,700	2,704	86,597	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,212	134,865	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	4,943	158,270	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,500	3,462	110,845	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,888	92,470	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,360	107,604	2041/09/30
	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,835	122,797	2025/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,439	78,117	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,850	3,851	123,308	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,749	55,996	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,350	4,385	140,400	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,345	75,093	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,831	122,663	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,731	55,431	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,857	123,492	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,597	147,207	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	2,800	2,819	90,258	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	2,000	2,128	68,139	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	3,300	3,603	115,368	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	3,000	3,029	96,998	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,954	94,596	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,450	2,648	84,802	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,307	105,906	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,947	94,372	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,500	3,291	105,387	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,085	130,797	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,662	85,252	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	2,400	2,333	74,695	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	3,400	3,453	110,569	2032/10/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	3,500	3,710	118,799	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	2,600	2,591	82,978	2028/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	2,500	2,513	80,469	2043/08/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,492	47,784	2038/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	2,400	2,445	78,283	2030/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	1,850	1,884	60,320	2053/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,300	1,293	41,423	2028/04/20
通貨小計	銘柄数	41銘柄					
	金 額			121,780	122,510	3,922,252	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	66,150	69,080	564,387	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	17,720	11,471	93,718	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	9,789	79,984	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	29,540	24,208	197,779	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	68,520	50,519	412,746	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	50,300	38,896	317,788	2037/01/31

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2023年11月20日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	千南アフリカ・ランド 62,200	千南アフリカ・ランド 56,368	千円 460,532	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	40,200	29,812	243,566	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	56,200	48,042	392,507	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	49,200	40,804	333,368	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	40,400	31,390	256,462	2040/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	11.6250	5,500	5,241	42,820	2053/03/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金額			502,210	415,625	3,395,664	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	千タイ・パート 40,050	千タイ・パート 44,280	189,079	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	37,610	38,639	164,990	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	32,700	34,451	147,106	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	34,600	35,095	149,859	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	40,400	39,909	170,412	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	48,500	51,532	220,044	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	30,663	130,934	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,500	34,900	149,026	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	46,500	46,282	197,625	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	42,000	41,581	177,551	2024/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	34,215	146,100	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	13,187	56,309	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	43,000	41,991	179,302	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	32,900	32,596	139,189	2024/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	40,900	34,645	147,936	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	54,500	51,129	218,321	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	19,012	81,181	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	61,000	57,715	246,446	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	43,000	42,429	181,175	2024/09/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	50,000	50,113	213,982	2028/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	30,500	30,975	132,265	2037/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	41,500	41,325	176,460	2026/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	24,000	24,035	102,631	2043/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	34,000	35,033	149,593	2033/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	12,000	11,882	50,736	2027/03/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	12,000	11,861	50,648	2029/03/17
通貨小計	銘柄数	26銘柄					
	金額			946,060	929,487	3,968,911	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	千ペルー・ソル 1,230	千ペルー・ソル 1,226	48,836	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,270	2,280	90,820	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	3,350	3,191	127,098	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	3,400	3,341	133,083	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,792	71,395	2034/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,500	1,231	49,061	2040/08/12
	PERU GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	2,800	2,857	113,813	2033/08/12

2023年11月20日現在

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000%	千ペルー・ソル 725	千ペルー・ソル 760	千円 30,284	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	3,465	3,373	134,355	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,070	3,102	123,563	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	10銘柄					
	金 額			23,860	23,156	922,313	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 8,190	千ポーランド・ズロチ 7,649	285,060	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,777	178,040	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	8,250	7,234	269,581	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	6,700	6,526	243,223	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	5,550	5,214	194,326	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	6,900	5,338	198,938	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	6,300	5,475	204,035	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,950	5,253	195,754	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,150	5,871	218,816	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	8,000	8,715	324,774	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,091	77,926	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,900	4,054	151,100	2033/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,286	234,258	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,954	221,894	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			87,530	80,444	2,997,730	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 95,170	41,037	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	270,000	235,936	101,734	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	114,418	49,336	2026/12/27
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	283,000	282,419	121,778	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	183,285	79,031	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	220,000	208,758	90,015	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	218,445	94,192	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000	239,908	103,447	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	129,415	55,803	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	148,686	64,112	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	107,925	46,537	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	152,026	65,553	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	86,225	37,179	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	150,000	91,410	39,415	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	50,812	21,910	2034/06/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	91,548	39,475	2028/03/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	170,000	146,538	63,186	2032/11/24
HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	9.5000	110,000	115,780	49,923	2026/10/21	
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500	274,948	118,556	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			3,477,000	2,973,659	1,282,227	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2023年11月20日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000 %	千ウルグアイ・ペソ 2,800	千ウルグアイ・ペソ 2,672	千円 10,120	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	6,469	24,496	2031/05/21
	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	国債証券	9.7500	11,000	11,049	41,842	2033/07/20
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金 額			20,800	20,191	76,459	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,967	28,913	2026/06/05
	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,400	13,065	34,445	2033/02/03
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			22,400	24,032	63,358	
合 計	銘柄数	326銘柄					
	金 額					39,680,951	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年11月20日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第13期（決算日 2023年7月5日）

（作成対象期間 2022年7月6日～2023年7月5日）

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

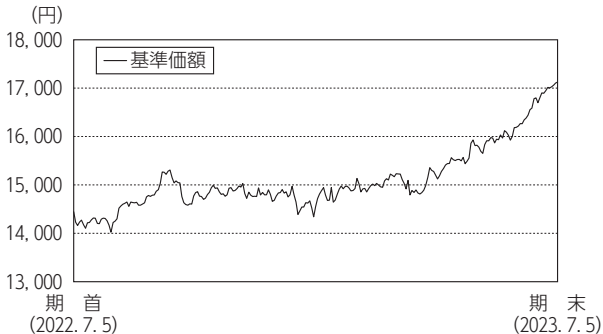
運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ない ます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：14,445円 期末：17,126円 騰落率：18.6%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が低下（債券価格は上昇）しました。

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

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

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

◆前作成期における【今後の運用方針】

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

年 月 日	基 準 価 額		J P Morgan ガバメント・ボンド・インデックス－エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算） （ベンチマーク）		公 社 債 入 率 比
	円	%	騰落率	騰落率	
(期首) 2022年 7月 5日	14,445	—	15,584	—	96.7
7月末	14,260	△ 1.3	15,346	△ 1.5	97.1
8月末	14,764	2.2	15,935	2.3	96.9
9月末	14,609	1.1	15,710	0.8	96.8
10月末	14,932	3.4	16,113	3.4	96.7
11月末	14,900	3.1	16,062	3.1	96.2
12月末	14,527	0.6	15,704	0.8	95.7
2023年 1月末	14,937	3.4	16,135	3.5	96.6
2月末	15,130	4.7	16,310	4.7	96.5
3月末	15,357	6.3	16,566	6.3	96.5
4月末	15,555	7.7	16,789	7.7	96.6
5月末	16,028	11.0	17,327	11.2	96.4
6月末	17,031	17.9	18,448	18.4	95.5
(期末) 2023年 7月 5日	17,126	18.6	18,554	19.1	96.8

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

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



《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	12 ( 12)
(その他)	( 0)
合 計	12

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期				未				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
				千円	%	%	%	%	%
エジプト	千エジプト・ポンド 66,600	千エジプト・ポンド 54,706		255,756	0.7	0.7	0.1	0.5	0.1
トルコ	千トルコ・リラ 52,860	千トルコ・リラ 50,818		282,653	0.8	0.8	0.1	0.6	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 440,900	千メキシコ・ペソ 416,395		3,530,405	9.6	—	5.0	2.4	2.1
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,659		25,274	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 4,705,000	千チリ・ペソ 4,692,466		848,914	2.3	—	1.6	0.2	0.5
コロンビア	千コロンビア・ペソ 53,780,000	千コロンビア・ペソ 47,197,658		1,649,133	4.5	—	2.6	1.5	0.4
インドネシア	千インドネシア・ルピア 340,819,000	千インドネシア・ルピア 361,127,831		3,502,939	9.5	—	6.6	1.8	1.1
ブラジル	千ブラジル・レアル 139,540	千ブラジル・レアル 120,836		3,607,004	9.8	—	1.9	4.8	3.1
チェコ	千チェコ・コルナ 321,900	千チェコ・コルナ 286,859		1,902,136	5.1	—	3.2	1.4	0.6
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 45,250	千ルーマニア・レイ 42,438		1,348,624	3.6	—	1.7	1.2	0.7
中国	千オフショア・人民元 177,700	千オフショア・人民元 181,587		3,630,636	9.8	—	4.9	3.7	1.2
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,116,020	千ロシア・ルーブル —		—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 115,930	千マレーシア・リンギット 117,037		3,640,163	9.8	—	5.4	3.4	1.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 477,710	千南アフリカ・ランド 389,080		3,015,377	8.2	—	6.7	1.4	—
タイ	千タイ・バーツ 888,560	千タイ・バーツ 895,597		3,707,774	10.0	—	5.8	2.5	1.8

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	うちBB格 以下組入 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		評 価 額		%			%	%	%	%
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
ペルー	千ペルー・ソル 23,010	千ペルー・ソル 22,637	901,825	2.4	—	2.1	0.2	0.1		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 86,030	千ポーランド・ズロチ 76,817	2,726,412	7.4	—	2.3	3.5	1.6		
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,237,000	千ハンガリー・フォリント 2,630,825	1,102,573	3.0	—	1.4	1.0	0.6		
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 9,134	35,180	0.1	—	0.1	0.0	—		
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 22,400	千ドミニカ・ペソ 25,391	66,066	0.2	0.2	0.1	0.1	—		
合計	—	—	35,778,854	96.8	1.6	51.4	30.3	15.1		

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千	千円	
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,162	5,434	2029/05/07
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	909	4,254	2024/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	2,858	13,365	2029/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,341	6,270	2025/01/14
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	3,170	14,822	2030/10/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,527	7,141	2027/10/13
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	7,670	35,860	2025/10/20
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	4,561	21,325	2028/01/05
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	18,800	15,673	73,274	2026/01/12
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	7,424	34,711	2026/04/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	816	3,818	2026/07/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	8,300	7,588	35,477	2024/09/14
	通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		66,600	54,706	255,756
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	千トルコ・リラ 1,630	千トルコ・リラ 1,549	8,615	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,461	13,688	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	5,570	5,195	28,895	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,696	14,995	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	8,234	45,800	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	5,000	4,443	24,716	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	9,100	9,142	50,851	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	7,972	44,345	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	9,123	50,745	2026/09/02
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		52,860	50,818	282,653
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 47,910	406,212	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	29,300	26,825	227,443	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	39,000	37,773	320,262	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	23,000	20,475	173,599	2027/03/04

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期				未			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		
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円			
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	25,700	23,734	201,237	2025/03/06		
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	16,000	14,546	123,330	2025/07/31		
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	15,300	14,123	119,744	2023/05/26		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	30,550	30,323	257,098	2024/12/05		
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	40,030	38,084	322,899	2027/06/03		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	9,390	10,408	88,251	2036/11/20		
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	35,230	34,874	295,686	2029/05/31		
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	25,100	24,502	207,741	2038/11/18		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	55,350	52,436	444,581	2031/05/29		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	34,120	30,628	259,683	2042/11/13		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,746	82,632	2034/11/23		
通貨小計	銘柄数	15銘柄							
	金 額			440,900	416,395	3,530,405			
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ	25,274	2036/01/14		
通貨小計	銘柄数	1銘柄							
	金 額			10,000	9,659	25,274			
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ	88,052	2026/03/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	500,000	486,720	128,797	2035/03/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	720,000	711,943	126,117	2043/01/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	630,000	697,126	126,117	2043/01/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	663,648	120,060	2030/09/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	937,740	169,646	2025/03/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	216,385	39,146	2028/10/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	197,026	35,643	2028/10/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	252,412	45,663	2034/05/01		
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	500,000	529,465	95,785	2033/04/01		
通貨小計	銘柄数	9銘柄							
	金 額			4,705,000	4,692,466	848,914			
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	3,037	2027/06/28		
	Colombian TES	国債証券	10.0000	90,000	86,933	134,711	2024/07/24		
	Colombian TES	国債証券	6.0000	3,850,000	3,855,390	167,329	2028/04/28		
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,570,000	4,788,918	177,554	2026/08/26		
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	5,081,558	112,524	2030/09/18		
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,600,000	3,220,416	112,524	2030/09/18		
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,830,484	133,840	2032/06/30		
	Colombian TES	国債証券	6.2500	3,700,000	3,424,720	119,663	2025/11/26		
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,900,000	3,951,850	138,081	2034/10/18		
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,761,600	96,493	2027/11/03		
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,510,000	3,224,334	112,661	2050/10/26		
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,388,482	48,514	2036/07/09		
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,575,096	159,858	2031/03/26		
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	4,500,000	4,051,350	141,558	2042/05/28		
	COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	2,500,000	2,956,525	103,303	2033/02/09		
通貨小計	銘柄数	14銘柄							
	金 額			53,780,000	47,197,658	1,649,133			
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	126,372	2036/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	11,250,000	13,028,062	89,403	2031/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	8,000,000	9,216,880	57,794	2032/08/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,300,000	5,928,205	76,854	2038/05/15		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	7,500,000	7,923,128	98,857	2024/05/15		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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



ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 35,778,854	% 92.7
コール・ローン等、その他	2,800,304	7.3
投資信託財産総額	38,579,159	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.56円、1エジプト・ポンド=4.675円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、1フィリピン・ペソ=2.616円、1アルゼンチン・ペソ=0.557円、100チリ・ペソ=18.091円、100コロンビア・ペソ=3.494円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=29.85円、1チェコ・コルナ=6.63円、1ルーマニア・レイ=31.778円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.14円、1ペルー・ソール=39.838円、1ポーランド・ズロチ=35.492円、100ハンガリー・フォリント=41.909円、1ウルグアイ・ペソ=3.851円、1ドミニカ・ペソ=2.601円、1ユーロ=157.37円です。

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

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

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

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:  
 新興国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 373,663,442円  
 ダイワファンドラップ外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし) 372,728,172円  
 ダイワファンドラップオンライン外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし) 414,298,460円  
 D-1's 新興国債券インデックス 65,003,129円  
 iFree 新興国債券インデックス 6,956,174,244円  
 iFree 8資産バランス 4,233,399,046円  
 ダイワ新興国債券インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用) 2,485,607円  
 DCダイワ新興国債券インデックスファンド 8,989,541,355円  
 ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券 139,571,080円  
 ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド 37,825,432円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,126円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

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

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

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