

ダイワ新興国株式インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用)

運用報告書(全体版)

第3期

(決算日 2024年11月20日)

(作成対象期間 2023年11月21日～2024年11月20日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／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FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） 2. 新興国の企業のDR（預託証券） 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	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、新興国の株式に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE RAFI エマーシング インデックス (税引後配当込み、円換算)		株式組入 比率	株式先物 比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2022年11月21日)	9,477	0	△ 5.2	9,466	△ 5.3	80.5	8.3	9.1	10
2 期末 (2023年11月20日)	11,245	0	18.7	11,405	20.5	80.2	8.7	8.4	18
3 期末 (2024年11月20日)	13,805	0	22.8	14,257	25.0	86.9	3.5	8.8	25

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) FTSE RAFI エマーシング インデックス（税引後配当込み、円換算）は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマーシング インデックス（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

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

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

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

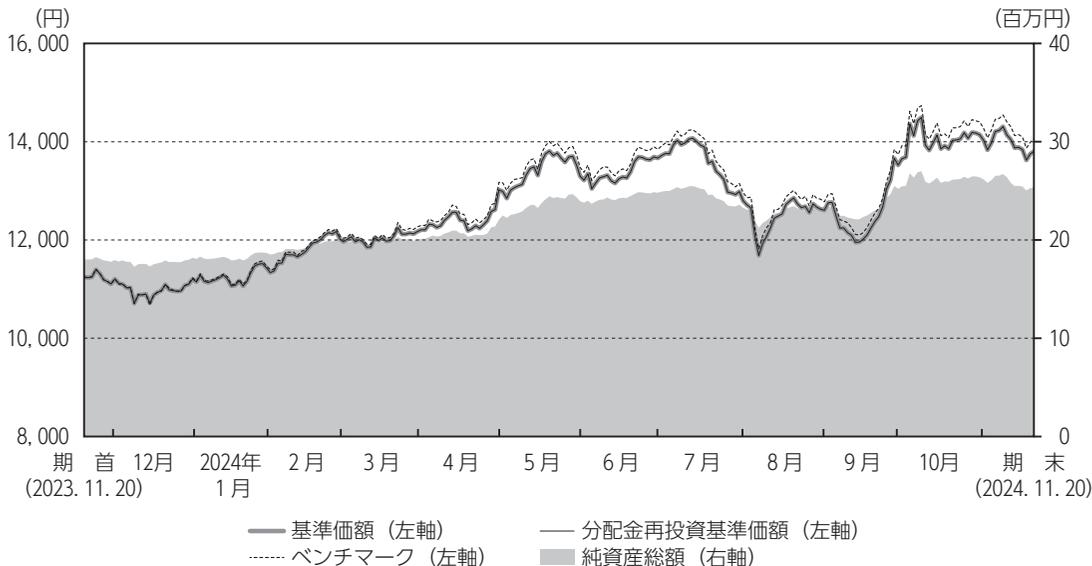
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 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 FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,245円

期末：13,805円（分配金0円）

騰落率：22.8%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。世界的な株高を背景に新興国株式市況は上昇しました。新興国為替相場についても対円で上昇（円安）し、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。

ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）

年 月 日	基 準 価 額		FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資証券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
		%		%	%	%	%
(期首) 2023年11月20日	11,245	—	11,405	—	80.2	8.7	8.4
11月末	11,102	△ 1.3	11,273	△ 1.2	90.8	4.8	3.9
12月末	11,204	△ 0.4	11,389	△ 0.1	89.4	4.8	4.7
2024年1月末	11,434	1.7	11,632	2.0	88.5	5.4	5.6
2月末	12,009	6.8	12,251	7.4	87.5	6.9	5.5
3月末	12,174	8.3	12,443	9.1	85.7	7.0	7.2
4月末	13,020	15.8	13,361	17.1	84.4	6.7	8.6
5月末	13,298	18.3	13,667	19.8	85.3	5.3	8.5
6月末	13,666	21.5	14,041	23.1	83.2	5.3	10.4
7月末	12,796	13.8	13,142	15.2	83.8	4.8	11.1
8月末	12,606	12.1	12,957	13.6	84.8	4.1	10.8
9月末	13,521	20.2	13,934	22.2	85.1	3.9	10.4
10月末	14,030	24.8	14,476	26.9	87.5	3.6	8.8
(期末) 2024年11月20日	13,805	22.8	14,257	25.0	86.9	3.5	8.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 11. 21 ~ 2024. 11. 20）

■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見送りによる追加利上げへの警戒感の後退や、約1年ぶりに実施された米中首脳会談による地政学リスクの後退などを背景に上昇しました。2024年1月以降も、中国の経済指標の悪化や、イランとイスラエルの紛争などの中東情勢の悪化から一時的に下落する局面も見られたものの、A I（人工知能）関連の半導体関連企業のけん引、中国の全国人民代表大会で強気な経済成長目標が打ち出されて景気刺激策への期待が強まったこと、米国の雇用者数の伸びが鈍化したことを受けて年内の利下げ期待が回復したことなどを背景に、堅調に推移しました。その後は、中国における大規模な景気刺激策の見送りや米国の景気減速懸念の高まりなどから大きく調整したものの、パウエルF R B議長が9月の利下げを示唆したことなどから反発しました。当作成期末にかけては、中国の政策の不透明感や米国大統領選挙の結果、通商政策を巡る懸念が高まったことなどを背景に、軟調に推移しました。

■為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

当作成期首より、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受けて円高米ドル安に推移しましたが、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことや米国金利の上昇を背景に円安米ドル高に転じたことから、新興国通貨も対円で上昇して推移しました。その後は、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和を終了したものの、日本の金融市場が他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しであることや各国の相対感から円安が進行しました。2024年4月以降は、日本の円買い為替介入の観測で一時的に円高に振れる場面もありましたが、日銀が緩和的な金融政策を継続したことから円安基調が継続しました。7月中旬以降は、日銀が7月の金融政策決定会合において、緩和的な金融政策を修正する観測が高まったことなどから大幅な円高米ドル安が進行し、新興国通貨についても対円で下落基調で推移しました。しかし10月に入ると、米国金利が大きく上昇したことで日米金利差の拡大が意識され、円安米ドル高が大きく進行し、新興国通貨も対円で上昇して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

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

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

■当ファンド

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算)

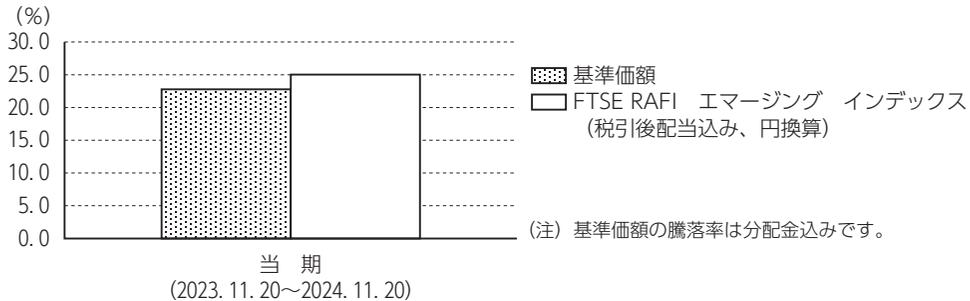
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は25.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.8%となりました。

売買手数料・保管費用等のコスト負担がマイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）です。

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2023年11月21日 ～2024年11月20日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,805

- （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ございません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023. 11. 21～2024. 11. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	38円	0.302%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,603円です。
（投 信 会 社）	(34)	(0.269)	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、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(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	8	0.061	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(6)	(0.046)	
（先物・オプション）	(1)	(0.007)	
（投 資 証 券）	(1)	(0.008)	
有 価 証 券 取 引 税	5	0.037	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(5)	(0.036)	
（投 資 証 券）	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	43	0.345	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）	(13)	(0.107)	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)	(0.004)	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）	(29)	(0.233)	インドキャピタルゲイン課税、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	94	0.744	

(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。

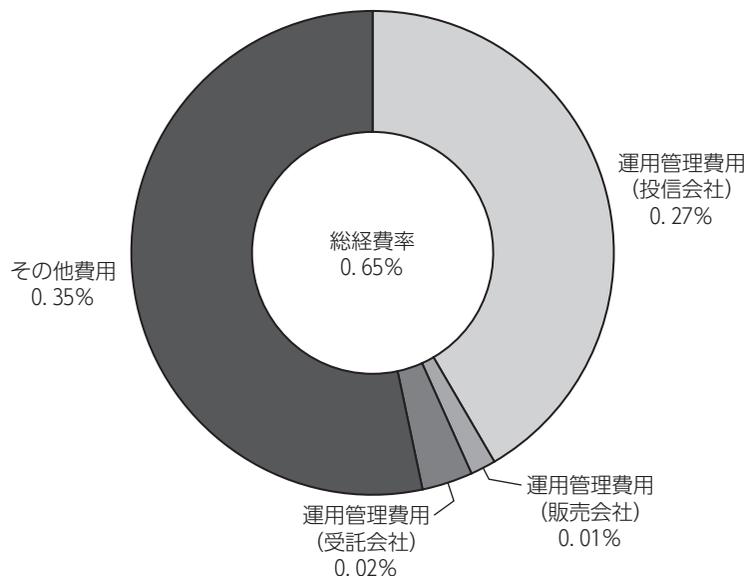
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.65%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2023年11月21日から2024年11月20日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1,655	4,283	537	1,429

（注）単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2023年11月21日から2024年11月20日まで）

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	14,591,658千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,469,183千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.49

（注1）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

（注2）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■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	
10	—	—	10	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	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	7,856	8,974	25,369			

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年11月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	25,369	99.8
コール・ローン等、その他	44	0.2
投資信託財産総額	25,413	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月20日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=154.91円、1香港・ドル=19.90円、1台湾・ドル=4.78円、1トルコ・リラ=4.494円、1メキシコ・ペソ=7.701円、100チリ・ペソ=15.934円、1サウジアラビア・リアル=41.33円、1インド・ルピー=1.84円、100インドネシア・ルピア=0.98円、1ブラジル・レアル=26.823円、1オフショア・人民元=21.415円、1マレーシア・リンギット=34.667円、1南アフリカ・ランド=8.58円、1タイ・バーツ=4.49円です。

（注3）ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（40,770,884千円）の投資信託財産総額（41,158,627千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年11月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	25,413,890円
コール・ローン等	44,491
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（評価額）	25,369,199
未収入金	200
(B) 負債	37,603
未払信託報酬	37,045
その他未払費用	558
(C) 純資産総額 (A - B)	25,376,287
元本	18,381,419
次期繰越損益金	6,994,868
(D) 受益権総口数	18,381,419口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,805円

* 期首における元本額は16,037,134円、当作成期間中における追加設定元本額は3,774,160円、同解約元本額は1,429,875円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,805円です。

■損益の状況

当期 自 2023年11月21日 至 2024年11月20日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	4,266,876円
売買益	4,486,876
売買損	△ 220,000
(B) 信託報酬等	△ 67,242
(C) 当期損益金 (A + B)	4,199,634
(D) 前期繰越損益金	1,622,827
(E) 追加信託差損益金	1,172,407
(配当等相当額)	(396,160)
(売買損益相当額)	(776,247)
(F) 合計 (C + D + E)	6,994,868
次期繰越損益金 (F)	6,994,868
追加信託差損益金	1,172,407
(配当等相当額)	(396,160)
(売買損益相当額)	(776,247)
分配準備積立金	5,822,461

- (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	4,199,634
(c) 収益調整金	1,172,407
(d) 分配準備積立金	1,622,827
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,994,868
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,994,868
(h) 受益権総口数	18,381,419口

「ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）」は、いかなる形式においても FTSE International Limited（以下「FTSE」）、ロンドン証券取引所グループ会社（以下「LSEG」）、または Research Affiliates LLC（以下「RA」）（以下、総称して「ライセンス各社」）によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンス各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまた RA と共同し FTSE によってルールに基づき計算されます。いずれのライセンス各社も、指数における瑕疵については（過失の有無に関わらず）何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。FTSE® は LSEG の商標です。Fundamental Index® および RAFI® は Research Affiliates, LLC の登録商標です。

DAIWA EMERGING EQUITY INDEX FUND (NON HEDGED) (DISCRETIONARY INVESTMENT ONLY) is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

<補足情報>

当ファンド（ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2024年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年11月20日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・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。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株式

(2023年11月21日から2024年11月20日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	445.3	654,526	1,469	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	81	287,191	3,545
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	55.5	353,675	6,372	TATA MOTORS LTD (インド)	102.176	176,001	1,722
VALE SA (ブラジル)	188.6	330,217	1,750	PETROCHINA CO LTD-H (中国)	1,202	149,471	124
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	70	310,623	4,437	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	25.345	131,915	5,204
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	372.5	273,207	733	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	124.8	129,792	1,040
HDFC BANK LIMITED (インド)	98.836	265,484	2,686	REC LTD (インド)	123.584	99,015	801
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	3,143	259,791	82	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	148	91,987	621
JD. COM INC - CL A (ケイマン諸島)	113.25	244,145	2,155	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H (中国)	1,177	73,181	62
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	3,542	232,885	65	POWER FINANCE CORPORATION (インド)	104.312	72,168	691
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,902	198,616	104	BRF SA (ブラジル)	136.4	67,601	495

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2023年11月21日から2024年11月20日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	900	2,757,974	3,064	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	776.1	2,229,706	2,872
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	329.01	31,314	95				
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	113.1	28,818	254				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

■組入資産明細表

下記は、2024年11月20日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド (14,542,634千口) の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
SURGUTNEFGAZ-SP ADR-PREF	290	—	—	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	245	324	50,325	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	89	98	15,248	情報技術
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	150	167	25,908	コミュニケーション・サービス
PINDUODUO INC-ADR	29	341	52,866	一般消費財・サービス
KE HOLDINGS INC-ADR	194	400	61,998	不動産
LUFAX HOLDING LTD-ADR	732.75	175	27,242	金融
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	105	192	29,798	情報技術
SBERBANK ROSSII	6,987.08	—	—	金融
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	88	183	28,381	情報技術
BANK VTB	764.86	—	—	金融
NK LUKOIL	230.88	—	—	エネルギー
MOBILNYE TELESISTEMY	707	—	—	コミュニケーション・サービス
NK ROSNEFT	974.99	—	—	エネルギー
MAGNIT	46.78	—	—	生活必需品
SURGUTNEFGAZ	3,607.5	—	—	エネルギー
TATNEFT	576.48	—	—	エネルギー
GAZPROM	8,534.78	—	—	エネルギー
GMK NORILSKIY NIKEL	1,829	—	—	素材
NOVATEK	269.8	—	—	エネルギー
360 DIGITECH ADR INC	121	391	60,665	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	—	—	素材
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.03	—	—	素材
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	—	—	素材
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	—	—	エネルギー
SISTEMA PJSC	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC	27,261	—	—	公益事業
ALROSA PJSC	1,803.1	—	—	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	—	—	金融
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	807	177	27,502	エネルギー
AEROFLOT PJSC	1,649.1	—	—	資本財・サービス
アメリカ・ドル	62,268.91	2,452	379,938	
通貨計	銘柄数<比率>	31銘柄	<0.9%>	
	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)				
TRIP.COM GROUP LTD	130	6,578	130,902	一般消費財・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC	135.5	5,016	99,822	一般消費財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	9,140	3,582	71,299	資本財・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,870	6,623	131,801	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	4,310	1,542	30,705	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	450	1,219	24,268	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	2,240	2,885	57,413	素材

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	44,038	18,407	366,316	エネルギー
TENCENT HOLDINGS LTD	1,465	59,508	1,184,215	コミュニケーション・サービス
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,840	3,359	66,860	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	21,120	11,911	237,042	エネルギー
HUANENG POWER INTL INC-H	4,260	1,772	35,265	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,915	4,107	81,742	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	76,000	45,752	910,464	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	14,300	7,250	144,276	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,042	1,417	28,200	金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CH-H	12,000	5,496	109,370	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,230	7,381	146,887	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	3,791.2	1,963	39,080	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	960	1,987	39,545	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,690	4,039	80,378	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	2,435	2,322	46,227	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,555	1,816	36,148	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	710	1,991	39,631	公益事業
BYD CO LTD-H	195	5,237	104,230	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	38,140	14,912	296,763	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE CH	939	2,328	46,341	金融
PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	9,000	3,447	68,595	金融
CITIC LTD	2,110	1,896	37,748	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	3,605	4,268	84,939	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	103,970	49,281	980,707	金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,045	1,588	31,609	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	2,450	1,386	27,595	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	21,100	2,152	42,828	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	6,966	19,713	392,304	情報技術
MEITUAN-CLASS B	1,037.9	17,841	355,045	一般消費財・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	9,189	78,336	1,558,890	一般消費財・サービス
CHINA ENERGY ENGINEERING CH	7,080	743	14,793	資本財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	2,460	1,188	23,644	公益事業
JD.COM INC - CL A	2,078.95	28,523	567,611	一般消費財・サービス
NETEASE INC	359	4,850	96,516	コミュニケーション・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	227	971	19,334	一般消費財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	7,060	1,186	23,602	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	1,146	3,111	61,911	一般消費財・サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	433	2,234	44,462	コミュニケーション・サービス
BAIDU INC-CLASS A	1,205.5	10,047	199,952	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	2,900	3,949	78,601	不動産
CRRC CORP LTD - H	3,370	1,627	32,391	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	5,860	1,640	32,651	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	9,360	43,196	859,608	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,640	1,571	31,265	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	5,230.5	6,213	123,655	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	16,070.8	5,078	101,059	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	27,840	1,350	26,869	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	278	2,247	44,727	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	6,744	4,444	88,441	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	263	1,520	30,250	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,830	3,096	61,617	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	4,800	5,846	116,343	金融
LI NING CO LTD	900	1,445	28,763	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,400	1,621	32,261	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	5,560	1,729	34,410	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	315	1,800	35,824	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,720	1,852	36,865	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,752	7,003	139,376	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	965	1,233	24,542	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	4,150	6,474	128,832	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	545	2,828	56,288	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,540	1,178	23,444	公益事業
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,900	2,960	58,907	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	11,551	6,826	135,850	金融
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	4,300	1,827	36,367	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	15,980	2,285	45,474	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,440	12,521	249,179	金融
BANK OF CHINA LTD-H	91,110	33,984	676,282	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,175	2,637	52,493	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LH	6,940	1,929	38,393	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,080	2,143	42,659	金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	2,960	3,374	67,150	不動産
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,400	1,125	22,395	情報技術
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	692,292.35 80銘柄	643,746 <31.2%>	12,810,551
(台湾)	百株	千台湾・ドル	千円	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	1,960	3,537	16,911	情報技術
WT MICROELECTRONICS LTD	340	3,961	18,934	情報技術
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	370	6,382	30,509	情報技術
GLOBALWAFERS CO LTD	140	6,013	28,743	情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUCT	310	5,022	24,006	情報技術
TAIWAN CEMENT	2,842.47	9,522	45,518	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,480	38,316	183,158	情報技術
WIVVYNN CORP	20	4,170	19,933	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,191.12	10,088	48,226	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	976	4,465	21,344	素材
NAN YA PLASTICS CORP	821.4	3,404	16,275	素材
WALSIN LIHWA CORP	1,790	5,173	24,728	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	4,326.86	9,670	46,227	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,000	5,390	25,765	一般消費財・サービス

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千台湾・ドル	千円	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,036.16	10,620	50,768	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	720	27,936	133,539	情報技術
YAGEO CORPORATION	265.78	14,219	67,970	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,132.87	3,839	18,351	情報技術
QISDA CORP	1,180	4,395	21,011	情報技術
ACER INC	1,940	7,372	35,239	情報技術
INVENTEC CORP	2,050	10,086	48,213	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	200	10,060	48,088	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	1,210	35,090	167,377	情報技術
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	330	4,983	23,819	情報技術
NANYA TECHNOLOGY CORP	750	2,778	13,282	情報技術
AUO CORP	7,606	12,131	57,991	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,274	15,733	75,211	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	620.03	79,673	380,856	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	300	6,150	29,398	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	2,278	53,760	256,987	資本財・サービス
YANG MING MARINE TRANSPORT	4,590	34,287	163,900	資本財・サービス
CHINA AIRLINES LTD	2,020	4,878	23,319	資本財・サービス
WAN HAI LINES LTD	1,460	13,621	65,114	資本財・サービス
EVA AIRWAYS CORP	1,630	6,772	32,374	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,027.35	18,529	88,577	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2,558.38	17,320	82,794	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,400	9,261	44,269	金融
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,434.29	6,596	31,534	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,673.99	9,051	43,267	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,547.18	10,175	48,643	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,468.84	5,715	27,320	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	6,850.28	25,243	120,662	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,817.81	5,080	24,287	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	50	11,925	57,003	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS CORP	260	12,623	60,340	情報技術
UNI-MICRON TECHNOLOGY CORP	420	6,699	32,022	情報技術
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	240	4,452	21,281	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	490	5,512	26,350	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	2,131.1	24,294	116,132	情報技術
INNOLUX CORP	9,300.29	14,182	67,997	情報技術
WPG HOLDINGS LTD	1,240	9,349	44,692	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	620	5,462	26,110	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	1,230	12,029	57,502	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	650	7,637	36,508	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	655.6	8,129	38,860	金融
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	150	5,475	26,171	情報技術
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	340	6,528	31,205	情報技術
POWERTECH TECHNOLOGY INC	480	6,000	28,681	情報技術
COMPAL ELECTRONICS	7,640	28,229	134,944	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,690	487,760	2,331,590	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	4,899.02	99,695	476,562	情報技術
ASUSTEK COMPUTER INC	547.6	34,060	162,817	情報技術

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年11月20日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千台湾・ドル	千円		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	7,050	31,866	152,325	情報技術	
台湾・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	124,022.42 63銘柄	1,402,394 6,703,724	<16.3%>	
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円		
AKBANK T. A. S.	3,191.64	17,091	76,819	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	7,609.3	9,648	43,367	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	987.88	9,132	41,049	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	608.58	8,733	39,252	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	2,901.15	14,372	64,599	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,812.02	14,976	67,314	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	3,644.9	9,717	43,676	金融	
KOC HOLDING AS	846.55	15,728	70,696	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	463.97	12,944	58,182	資本財・サービス	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	941.21	3,757	16,887	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	211.14	9,659	43,417	生活必需品	
トルコ・リラ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	23,218.34 11銘柄	125,762 565,264	<1.4%>	
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
AMERICA MOVIL L	14,437	21,857	168,343	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	189.15	2,986	23,001	生活必需品	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	2,816	2,269	17,480	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	9,444.19	10,322	79,501	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	662	11,870	91,427	生活必需品	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	158	2,756	21,228	生活必需品	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	398	2,439	18,787	生活必需品	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,057	10,957	84,395	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,604	8,623	66,413	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,043	14,749	113,594	金融	
メキシコ・ペソ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	31,808.34 10銘柄	88,833 684,174	<1.7%>	
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円		
BANCO SANTANDER CHILE	37,706.21	177,520	28,287	金融	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	87.71	329,798	52,552	素材	
BANCO DE CHILE	15,640.88	175,349	27,941	金融	
チリ・ペソ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	53,434.8 3銘柄	682,669 108,780	<0.3%>	
(サウジアラビア)	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI ARABIAN MINING	218.37	1,181	48,826	素材	
SABIC AGRI-NUTRIENTS	86.21	963	39,835	素材	
SAUDI AWWAL BANK	178.18	561	23,197	金融	
ARAB NATIONAL BANK	344.54	671	27,767	金融	
BANQUE SAUDI FRANSI	140.01	434	17,967	金融	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	232.58	589	24,367	素材	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	212.17	1,485	61,382	素材	
SAUDI TELECOM CO	631.86	2,505	103,545	コミュニケーション・サービス	

銘柄	2024年11月20日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
AL RAJHI BANK	376.44	3,512	145,158	金融	
RIYAD BANK	363.77	963	39,841	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	125.21	677	27,996	コミュニケーション・サービス	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	163.08	636	26,286	素材	
ALINMA BANK	243.31	665	27,503	金融	
THE SAUDI NATIONAL BANK	955.71	3,168	130,940	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	1,065.67	2,978	123,103	エネルギー	
サウジアラビア・リアル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,337.11 15銘柄	20,994 867,719	<2.1%>	
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円		
BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	52.6	5,848	10,761	コミュニケーション・サービス	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	684.51	21,859	40,222	金融	
TATA STEEL LTD	6,146.42	85,717	157,721	素材	
AXIS BANK LTD	594.59	67,423	124,059	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	24.11	26,422	48,618	一般消費財・サービス	
TATA POWER CO LTD	361.25	14,742	27,126	公益事業	
BANK OF BARODA	543.22	12,885	23,708	金融	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	131.73	31,751	58,422	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	1,087.74	39,392	72,482	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	736.87	59,170	108,874	金融	
NTPC LTD	2,067.99	75,833	139,533	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	780.73	36,803	67,718	金融	
JSW STEEL LTD	321.79	30,483	56,089	素材	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,554.11	48,962	90,990	公益事業	
INDIAN OIL CORP LTD	3,763.71	50,102	92,188	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	1,964.88	56,490	103,942	エネルギー	
PUNJAB NATIONAL BANK	1,086.72	10,960	20,167	金融	
STEEL AUTHORITY OF INDIA	1,353.61	15,085	27,758	素材	
JINDAL STEEL & POWER LTD	159.8	13,829	25,445	素材	
CANARA BANK	1,088.9	10,650	19,596	金融	
UNION BANK OF INDIA	855.77	9,928	18,268	金融	
ULTRATECH CEMENT LTD	20.01	21,549	39,651	素材	
PETRONET LNG LTD	476.78	14,968	27,542	エネルギー	
SHRIRAM FINANCE LTD	85.46	24,140	44,418	金融	
TECH MAHINDRA LTD	211.54	35,954	66,156	情報技術	
YES BANK LTD	6,012.87	11,761	21,640	金融	
REC LTD	502.16	25,941	47,732	金融	
COAL INDIA LTD	1,022.01	42,132	77,523	エネルギー	
BAJAJ FINANCE LTD	23.52	15,512	28,542	金融	
SAMMAAN CAPITAL LTD	785.58	11,833	21,773	金融	
GAIL INDIA LTD	1,409.39	26,310	48,411	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,046.96	67,005	123,290	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	146.48	36,739	67,600	素材	
WIPRO LTD	288.24	16,199	29,806	情報技術	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	205.98	83,206	153,100	情報技術	
INFOSYS LTD	722.37	131,814	242,538	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	145.98	51,179	94,169	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	669.38	52,425	96,463	一般消費財・サービス	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
DR. REDDY'S LABORATORIES	百株 101.2	千円 12,280	千円 22,595	ヘルスケア
HDFC BANK LIMITED	988.36	172,197	316,842	金融
ICICI BANK LTD	299.26	37,380	68,780	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	1,472.64	182,850	336,444	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	3,535.05	87,669	161,311	エネルギー
ITC LTD	763.64	35,688	65,667	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	246.03	72,553	133,497	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	36.43	17,398	32,012	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	377.37	57,567	105,924	コミュニケーション・サービス
UPL LTD	396.65	21,688	39,907	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	118.76	21,106	38,836	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	255.12	46,445	85,460	情報技術
VEDANTA LTD	2,019.03	89,554	164,779	素材
インド・ルビー 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	49,745.3 51銘柄	4,135,215 <10.1%>	
(インドネシア)	百株	千円	千円	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	316.666	2,343,328	22,964	一般消費財・サービス
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	8,863	4,404,911	43,168	資本財・サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	15,396	4,280,088	41,944	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	7,310	3,545,350	34,744	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	9,958	9,883,315	96,856	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	13,741	8,588,125	84,163	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	20,628	8,993,808	88,139	金融
インドネシア・ルピア 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	392,562 7銘柄	42,038,925 <1.0%>	
(ブラジル)	百株	千ブラジル・レアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	648	559	15,017	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	148	621	16,657	公益事業
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	274	935	25,084	金融
VIBRA ENERGIA SA	1,509	3,289	88,240	一般消費財・サービス
NATURA & CO HOLDING SA	632	903	24,225	生活必需品
TIM SA	474.26	775	20,812	コミュニケーション・サービス
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	919	640	17,181	生活必需品
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,816	850	22,811	ヘルスケア
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	7,610	28,765	771,610	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	516	320	8,595	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,752.59	7,950	213,252	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,048.36	10,550	283,002	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	695	809	21,718	素材
VALE SA	4,452.9	25,684	688,953	素材
GERDAU SA-PREF	1,776.92	3,488	93,564	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	5,073	20,809	558,190	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,374.74	1,642	44,066	公益事業
ITAUSA SA	1,384.09	1,439	38,611	金融
BRASKEM SA-PREF A	484	705	18,915	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	165	668	17,925	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,682	4,347	116,629	金融

銘柄	2024年11月20日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
COSAN SA	百株 600	千円 660	千円 17,703	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	744	2,650	71,106	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,046	1,001	26,851	公益事業
EMBRAER SA	339	1,845	49,503	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	1,474	1,611	43,215	素材
CCR SA	755	905	24,282	資本財・サービス
BRF SA	815	1,989	53,363	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	130	1,275	34,208	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	591.75	979	26,285	一般消費財・サービス
JBS SA	1,436	5,004	134,239	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	178	108	2,922	素材
SUZANO SA	375.45	2,267	60,829	素材
LOCALIZA RENT A CAR	200	877	23,546	資本財・サービス
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	1,235	2,106	56,515	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,808	1,811	48,594	金融
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	411	1,361	36,513	公益事業
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	156.09	232	6,238	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	434	1,100	29,523	金融
TELEFONICA BRASIL S. A.	325	1,694	45,445	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	502.9	1,035	27,775	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	734	1,347	36,148	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,000	1,221	32,759	金融
BANCO BRADESCO S. A.	1,903.21	2,316	62,129	金融
AMBEV SA	2,157	2,681	71,918	生活必需品
ブラジル・レアル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	60,194.26 45銘柄	4,126,689 <10.0%>	
(中国)	百株	千円	千円	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	2,812	674	14,453	資本財・サービス
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	2,188	4,010	85,889	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,163	1,241	26,588	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	1,103.53	6,136	131,422	金融
IND & COMV BK OF CHINA-A	7,147	4,395	94,130	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	238	497	10,657	ヘルスケア
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	14	2,158	46,229	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	533	1,385	29,666	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	1,171	1,192	25,529	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	4,553	4,457	95,458	金融
CITIC SECURITIES CO-A	350	1,095	23,460	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,413	5,329	114,142	金融
PING AN BANK CO LTD-A	1,841	2,150	46,049	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	8,141	4,966	106,350	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	299	865	18,537	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	942	1,556	33,326	一般消費財・サービス
SHAANXI COAL INDUSTRY CO-LA	356	844	18,076	エネルギー
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	439	246	5,274	金融
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	2,004	1,172	25,106	資本財・サービス
CHINA COAL ENERGY CO-A	440	568	12,174	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,611.6	2,333	49,975	資本財・サービス

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年11月20日現在			
	株数	評価額		業種等
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	2,013	698	14,959	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	972	771	16,527	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	343	754	16,160	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	266.5	414	8,886	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	466	370	7,933	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,480	4,028	86,262	金融
BANK OF CHINA LTD-A	3,134	1,560	33,424	金融
PETROCHINA CO LTD-A	2,306	1,874	40,149	エネルギー
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	4,912	3,089	66,166	エネルギー
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	468	1,280	27,431	公益事業
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	4,653	3,368	72,144	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	406	1,669	35,744	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	2,152	1,883	40,325	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	596	2,093	44,839	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	1,420	965	20,678	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	6,970	2,899	62,095	金融
PICC HOLDING CO-A	1,357	1,001	21,447	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	5,892	2,127	45,551	金融
CRRC CORP LTD-A	1,601	1,308	28,012	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	2,609	1,429	30,618	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	655	268	5,751	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	305	563	12,070	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	628	735	15,748	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	3,671	2,477	53,066	資本財・サービス
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	1,553	1,254	26,872	金融
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	1,682	1,131	24,242	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	297	1,461	31,299	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	2,150	1,616	34,624	金融
BYD CO LTD -A	32	921	19,736	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	470	651	13,960	資本財・サービス
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-A	667	1,081	23,154	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	389	276	5,923	公益事業
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA	2,198	1,164	24,948	金融
オフショア・人民元 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	105,472.63 54銘柄	94,475 <4.9%>	
(マレーシア)	百株	千円	千円	
MALAYAN BANKING BHD	1,428	1,462	50,693	金融
PUBLIC BANK BERHAD	2,548	1,131	39,220	金融
TOP GLOVE CORP BHD	7,969	908	31,494	ヘルスケア
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	3,094	2,549	88,384	金融
TENAGA NASIONAL BHD	657	947	32,844	公益事業
マレーシア・リンギット 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	15,696 5銘柄	6,998 <0.6%>	
(南アフリカ)	百株	千円	千円	
AngloGold Ashanti Plc	217.38	9,895	84,900	素材
NEPI ROCKCASTLE NV	255.51	3,546	30,426	不動産
NORTHAM PLATINUM HDGS LTD	274.87	3,268	28,043	素材
GOLD FIELDS LTD	286.47	7,751	66,511	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	21.55	7,083	60,778	金融

銘柄	2024年11月20日現在			
	株数	評価額		業種等
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	199.76	5,940	50,965	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	201.16	5,833	50,052	金融
BIDVEST GROUP LTD	161.04	4,364	37,447	資本財・サービス
BID CORP LTD	136.07	6,081	52,147	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	473.51	11,348	97,371	金融
SASOL LTD	611.88	5,690	48,824	素材
REMGRO LTD	181.93	2,700	23,169	金融
DISCOVERY LTD	217.08	4,167	35,759	金融
SANLAM LTD	694.81	6,151	52,782	金融
FIRSTRAND LTD	2,425.73	18,564	159,280	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	554.25	3,668	31,471	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	267.21	4,309	36,976	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	427.92	7,146	61,318	金融
NASPERS LTD-N SHS	52.83	21,703	186,212	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	879.02	7,327	62,870	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	929.11	10,406	89,283	金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	54.57	3,562	30,565	素材
SIBANYE STILLWATER LTD	6,130.83	11,587	99,418	素材
南アフリカ・ランド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	15,654.49 23銘柄	172,098 <3.6%>	
(タイ)	百株	千円	千円	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,848	21,159	95,006	金融
TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	8,331	9,830	44,139	コミュニケーション・サービス
SIAM CEMENT PCL-NVDR	582	11,436	51,348	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	5,755	25,843	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	2,162	32,321	145,125	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	30,961	5,542	24,883	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,997	7,717	34,650	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	531	15,080	67,710	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	7,429	15,229	68,380	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	17,590	9,850	44,228	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERV-NVDR	2,630	7,035	31,588	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	980	12,495	56,102	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,476	4,760	21,372	エネルギー
PTT PCL-NVDR	15,779	51,281	230,255	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,421	5,826	26,159	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	3,157	20,125	90,365	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	762	11,391	51,149	金融
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	4,711	11,494	51,611	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	3,133	7,989	35,871	素材
タイ・パーツ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	106,865 19銘柄	266,323 <2.9%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,738,571.95 417銘柄	— <86.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月20日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	2024年11月20日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	1,095.5	22,884	3,545,114
アメリカ・ドル	□ 数、金 額	1,095.5	22,884
通 貨 計	銘柄数<比率>	1銘柄	<8.6%>
(メキシコ)	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	113.1	2,485	19,146
メキシコ・ペソ	□ 数、金 額	113.1	2,485
通 貨 計	銘柄数<比率>	1銘柄	<0.0%>
(南アフリカ)	千口	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	329.01	4,333	37,177
南アフリカ・ランド	□ 数、金 額	329.01	4,333
通 貨 計	銘柄数<比率>	1銘柄	<0.1%>
合 計	□ 数、金 額	1,537.61	—
	銘柄数<比率>	3銘柄	<8.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年11月20日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2024年11月20日現在	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT (アメリカ)	1,444	—

(注1) 外貨建の評価額は、2024年11月20日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2024年7月5日)

(作成対象期間 2023年7月6日～2024年7月5日)

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

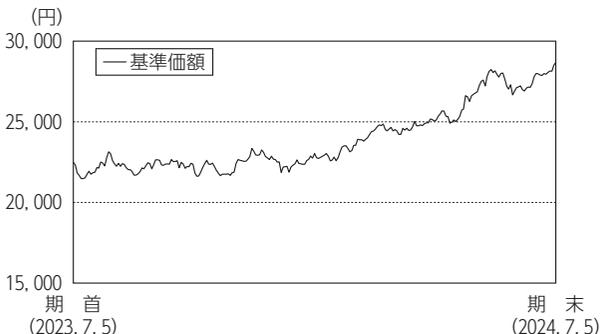
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

《運用経過》



◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,484円 期末：28,686円 騰落率：27.6%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運動をめざした運用を行いました。米国における追加利上げへの警戒感の後退を受けた世界的な株高や、中国の景気支援策への期待を背景に、新興国株式市況が上昇したこと、また新興国為替相場が対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、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。

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、中国の景気対策への期待から上昇して始まったものの、米国国債の増発やFRB（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、2023年10月末にかけて下落しました。11月以降は、FRBの利上げ見送りによる追加利上げへの警戒感の後退や、約1年ぶりに実施された米中首脳会談による地政学リスクの後退などを背景に上昇しました。2024年1月以降も、中国の経済指標の悪化や、イランとイスラエルの紛争などを背景とした中東情勢の悪化から一時的に下落する局面も見られたものの、AI（人工知能）関連の半導体関連企業のけん引、中国の全国人民代表大会で強気な経済成長目標が打ち出され景気刺激策への期待が強まったこと、米国で雇用者数の増加ペースが落ち着き年内の利下げ期待が回復したことを背景に、上昇基調で推移しました。

○為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、米ドルから大きな影響を受けて推移しました。当作成期首より、米国の雇用や物価などの経済指標が市場予想を下振れたことや、日銀の金融緩和策の修正観測などを受け、米ドルは対円で下落（円高）しました。2023年8月以降は、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、米ドルは対円で上昇しました。この期間、新興国通貨は米ドルに対して一進一退で推移したため、新興国通貨対円為替相場は米ドル対円為替相場と同じ推移となりました。その後は、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受け、米ドルは対円で下落しました。しかし2024年に入ってから、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことや、米国金利の上昇を背景に円安米ドル高に転じました。その後は、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しや、各国の相対感から新興国の為替相場についても円安が進行しました。当作成期末にかけても、日本の円買い為替介入の観測で一時的に円高に振れる場面もありましたが、日銀が緩和的な金融政策を継続していることから円安基調が継続しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマーゼンディング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点から

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマーゼンディング インデックス (税引後配当込み、円換算)		株組比	式入率	株先比	式物率	投証組比	資券入率
	円	騰落率	円	騰落率						
		(ベンチマーク)		(%)						
(期首) 2023年7月5日	22,484	—	24,752	—	82.9	7.5	8.9			
7月末	22,779	1.3	25,041	1.2	81.2	9.2	8.9			
8月末	22,410	△ 0.3	24,719	△ 0.1	80.2	9.0	8.8			
9月末	22,213	△ 1.2	24,523	△ 0.9	81.9	8.9	8.5			
10月末	21,674	△ 3.6	23,969	△ 3.2	81.0	8.7	8.4			
11月末	22,657	△ 0.8	25,081	1.3	90.8	4.8	3.9			
12月末	22,871	1.7	25,338	2.4	89.5	4.8	4.7			
2024年1月末	23,347	3.8	25,879	4.6	88.6	5.5	5.6			
2月末	24,528	9.1	27,255	10.1	87.5	6.9	5.5			
3月末	24,872	10.6	27,683	11.8	85.7	7.0	7.2			
4月末	26,617	18.4	29,724	20.1	84.4	6.7	8.6			
5月末	27,196	21.0	30,405	22.8	85.3	5.3	8.5			
6月末	27,948	24.3	31,238	26.2	83.2	5.3	10.4			
(期末) 2024年7月5日	28,686	27.6	32,085	29.6	82.3	5.8	11.2			

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマーゼンディング インデックス (税引後配当込み、円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマーゼンディング インデックス (税引後配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(2) 投資証券

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

銘柄		買付		売付	
		□ 数	金額	□ 数	金額
外国	アメリカ INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 900	千アメリカ・ドル 17,906	千口 576.1	千アメリカ・ドル 10,651
	メキシコ FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 113.1	千メキシコ・ペソ 3,157	千口 —	千メキシコ・ペソ —
	南アフリカ GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 301.81	千南アフリカ・ランド 3,499	千口 —	千南アフリカ・ランド —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 11,677	百万円 11,969	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株式

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

当期				前期			
銘柄	買付			売付			平均単価
	株数	金額	平均単価	株数	金額	平均単価	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	千株 344.3	千円 484,753	円 1,407	千株 81	千円 287,191	円 3,545	
VALE SA (ブラジル)	139.5	254,630	1,825	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE (インド)	39.674	187,483	4,725
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	39.9	230,869	5,786	TATA MOTORS LTD (インド)	102.176	176,001	1,722
HDFC BANK LIMITED (インド)	86.136	226,944	2,634	PETROCHINA CO LTD-H (中国)	1,202	149,471	124
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	268	192,562	718	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	25.345	131,915	5,204
JD. COM INC - CL A (ケイマン諸島)	90.15	186,751	2,071	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	124.8	129,792	1,040
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	2,558	160,528	62	REC LTD (インド)	123.584	99,015	801
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,053	159,815	77	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	148	91,987	621
MEITUAN-CLASS B (ケイマン諸島)	59.3	112,271	1,893	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H (中国)	1,177	73,181	62
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,097	105,254	95	POWER FINANCE CORPORATION (インド)	104.312	72,168	691

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)						
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	290	290	—	—	エネルギー	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	259	213	292	47,099	一般消費財・サービス	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	172	—	—	—	一般消費財・サービス	
CANADIAN SOLAR INC	43	74	116	18,748	情報技術	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	156	129	192	31,061	コミュニケーション・サービス	
NIO INC - ADR	153	—	—	—	一般消費財・サービス	
PINDUODUO INC-ADR	15	25	343	55,337	一般消費財・サービス	
KE HOLDINGS INC-ADR	118	166	262	42,298	不動産	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	1,215	638.75	188	30,369	金融	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	—	91	144	23,217	情報技術	
SBERBANK ROSSII	6,987.08	6,987.08	—	—	金融	
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	35	76	168	27,192	情報技術	
BANK VTB	3,824,340	3,824,340	—	—	金融	
NK LUKOIL	230.88	230.88	—	—	エネルギー	
MOBILNYE TELESISTEMY	707	707	—	—	コミュニケーション・サービス	
NK ROSNEFT	974.99	974.99	—	—	エネルギー	
MAGNIT	46.78	46.78	—	—	生活必需品	
SURGUTNEFTEGAZ	3,607.5	3,607.5	—	—	エネルギー	
TATNEFT	576.48	576.48	—	—	エネルギー	
GAZPROM	8,534.78	8,534.78	—	—	エネルギー	
GMK NORILSKIY NIKEL	18.29	1,829	—	—	素材	
NOVATEK	269.8	269.8	—	—	エネルギー	
360 DIGITECH ADR INC	79	102	207	33,503	金融	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	72.9	—	—	素材	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.03	0.03	—	—	素材	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0.04	—	—	—	生活必需品	
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	134.6	—	—	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	210.09	—	—	エネルギー	
SISTEMA PJSC	3,192	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス	
INTER RAO UES PJSC	27,261	27,261	—	—	公益事業	
ALROSA PJSC	1,803.1	1,803.1	—	—	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	566.19	—	—	金融	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	687	123	19,897	エネルギー	
AEROFLOT PJSC	1,649.1	1,649.1	—	—	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	3,883,717.63	3,885,485.05	2,039	328,725	
	銘柄数 < 比率 >	32銘柄	31銘柄		< 0.8% >	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
TRIP.COM GROUP LTD	137.5	116	4,588	94,716	一般消費財・サービス	
YUM CHINA HOLDINGS INC	79.5	121.5	2,976	61,440	一般消費財・サービス	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,650	8,380	3,737	77,141	資本財・サービス	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,980	4,280	3,723	76,855	一般消費財・サービス	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	—	3,810	1,524	31,455	資本財・サービス	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	180	405	1,069	22,068	生活必需品	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,160	—	—	—	生活必需品	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,470	2,020	3,232	66,708	素材	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,500	—	—	—	公益事業	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	35,218	38,438	20,756	428,414	エネルギー	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	655	—	—	—	資本財・サービス	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
TENCENT HOLDINGS LTD	877	1,276	48,794	1,007,113	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	5,440	—	—	—	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,580	1,660	4,150	85,656	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	28,740	18,460	15,764	325,386	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	375	—	—	—	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	15,931.2	—	—	—	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	3,560	3,860	2,258	46,607	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,200	1,775	3,454	71,293	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	900	—	—	—	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	55,000	65,970	36,547	754,337	金融
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,140	—	—	—	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	8,160	12,510	6,054	124,971	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	1,075	—	—	—	不動産
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	996	834	673	13,908	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	375	—	—	—	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	9,220	10,530	4,580	94,542	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,400	1,905	7,181	148,233	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	2,111.2	3,431.2	2,110	43,554	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	696	776	1,606	33,154	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,900	1,525	4,262	87,975	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	1,180	2,275	2,634	54,375	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	2,955	5,045	1,377	28,427	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	403	604	1,727	35,654	公益事業
BYD CO LTD-H	70	175	4,105	84,737	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	42,240	33,120	11,525	237,891	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	936	828	1,303	26,899	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	7,330	8,320	2,279	47,052	金融
CITIC LTD	1,840	1,680	1,226	25,312	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,415	3,225	3,799	78,412	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	69,560	90,090	43,513	898,118	金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	240	915	1,022	21,114	ヘルスケア
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,705	—	—	—	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	620	2,450	1,212	25,031	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	20,480	18,060	1,878	38,766	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	5,904	6,078	10,235	211,257	情報技術
MEITUAN-CLASS B	311.9	904.9	10,831	223,565	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD	5,460	—	—	—	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	4,562	8,005	58,556	1,208,607	一般消費財・サービス
CHINA FEIHE LTD	1,870	—	—	—	生活必需品
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	5,180	7,080	615	12,713	資本財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,340	2,020	900	18,594	公益事業
JD.COM INC - CL A	912.45	1,813.95	18,756	387,128	一般消費財・サービス
NETEASE INC	384	321	4,737	97,791	コミュニケーション・サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	69.5	—	—	—	資本財・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	351	195	1,253	25,879	一般消費財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	4,200	6,160	1,016	20,978	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	732	1,006	2,525	52,117	一般消費財・サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	188	392	1,756	36,247	コミュニケーション・サービス
BAIDU INC-CLASS A	761.5	1,053.5	9,197	189,827	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,370	2,590	3,553	73,343	不動産
CRRC CORP LTD - H	2,990	3,050	1,570	32,420	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	7,100	5,400	1,895	39,121	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,415	8,095	29,668	612,351	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,630	1,440	1,293	26,689	エネルギー	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,400.5	4,655.5	6,461	133,372	資本財・サービス	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	950	—	—	—	不動産	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	9,130.8	14,310.8	4,035	83,295	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	35,840	27,840	1,350	27,868	不動産	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	156	254	1,836	37,903	一般消費財・サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	2,480	6,062	2,927	60,432	不動産	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	185	235	1,740	35,917	一般消費財・サービス	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	790	1,690	2,474	51,066	生活必需品	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	5,000	4,320	4,246	87,648	金融	
LI NING CO LTD	165	815	1,279	26,409	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,590	1,270	1,635	33,762	資本財・サービス	
CHINA POWER INTERNATIONAL	4,180	5,060	2,145	44,281	公益事業	
SUNNY OPTICAL TECH	134	290	1,328	27,414	情報技術	
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-H	2,700	3,360	1,841	38,004	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,116	2,440	4,870	100,521	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	696	965	1,127	23,263	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,270	3,620	3,924	80,993	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	252	483	3,067	63,303	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2,050	—	—	—	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	—	1,340	1,191	24,587	公益事業	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,360	1,600	2,771	57,197	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,100	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,180	—	—	—	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	11,091	10,111	5,904	121,875	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	—	—	—	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	5,180	—	—	—	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,570	3,850	1,536	31,706	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	9,170	14,570	1,617	33,380	情報技術	
SINOTRUK HONG KONG LTD	700	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,210	3,015	10,296	212,514	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	53,100	78,680	30,527	630,094	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	765	1,035	1,155	23,840	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	4,990	5,760	1,393	28,770	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,312	2,680	967	19,968	金融	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,810	2,595	2,947	60,845	不動産	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	1,240	2,800	1,027	21,209	情報技術	
香港・ドル通貨計	株数、金額	574,695.05	610,180.35	522,646	10,787,414	
	銘柄数 <比率>	99銘柄	80銘柄		<27.6%>	
(台湾)		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	—	1,960	5,282	26,193	情報技術	
WT MICROELECTRONICS LTD	—	270	3,240	16,066	情報技術	
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	102.88	16	83	情報技術	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	470	330	6,055	30,028	情報技術	
GLOBALWAFERS CO LTD	90	100	5,810	28,810	情報技術	
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	270	270	5,994	29,723	情報技術	
TAIWAN CEMENT	3,812.47	2,662.47	9,092	45,087	素材	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,390	2,180	36,188	179,449	情報技術	
WIWYNN CORP	—	20	5,460	27,075	情報技術	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	740	—	—	—	金融	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,171.12	1,021.12	8,597	42,634	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	1,176	976	5,621	27,877	素材	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
NAN YA PLASTICS CORP	1,311.4	821.4	4,061	20,141	素材
WALSIN LIHWA CORP	1,330	1,590	5,692	28,226	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	4,526.86	3,706.86	8,711	43,196	素材
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	—	870	4,158	20,621	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,176.16	886.16	9,880	48,996	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	550	640	24,448	121,232	情報技術
YAGEO CORPORATION	167.34	187.34	14,106	69,952	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	1,730	1,679.99	4,418	21,909	情報技術
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	740	—	—	—	情報技術
QISDA CORP	—	980	3,841	19,049	情報技術
ACER INC	—	1,790	8,430	41,807	情報技術
INVENTEC CORP	—	1,750	9,817	48,683	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	170	160	8,800	43,637	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	1,100	1,060	32,754	162,420	情報技術
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	—	280	4,718	23,395	情報技術
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	750	5,557	27,558	情報技術
AUO CORP	6,516	7,196	12,952	64,230	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,624	1,174	13,911	68,986	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	410.03	550.03	75,629	375,029	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	400	300	6,810	33,769	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,078	1,998	37,662	186,759	資本財・サービス
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,880	4,030	29,741	147,481	資本財・サービス
CHINA AIRLINES LTD	1,710	2,020	4,989	24,741	資本財・サービス
WAN HAI LINES LTD	580	1,260	10,886	53,983	資本財・サービス
EVA AIRWAYS CORP	1,200	1,430	5,426	26,910	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,261.55	1,774.62	14,853	73,655	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,198.38	2,328.38	14,133	70,084	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,190	4,550	7,280	36,100	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,836.1	2,141.4	6,263	31,059	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,616.82	2,196.07	7,268	36,045	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,865.17	2,138.24	8,969	44,880	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,415.83	—	—	—	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,332.31	—	—	—	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	3,841.8	2,158.63	5,741	28,473	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	5,790.28	6,040.28	24,010	119,061	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,166.58	1,541.57	4,408	21,862	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	40	40	11,360	56,331	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	260	220	13,640	67,638	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	370	370	6,715	33,300	情報技術
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	—	200	4,460	22,116	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	490	430	4,773	23,668	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	2,021.1	1,911.1	20,830	103,296	情報技術
INNOLUX CORP	6,713.75	9,648.06	14,375	71,285	情報技術
WPG HOLDINGS LTD	—	1,140	10,681	52,968	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	770	540	4,919	24,394	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	650	1,160	12,354	61,261	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	430	530	7,367	36,531	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	340.33	537.13	8,486	42,083	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,685.6	—	—	—	金融
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	—	110	4,317	21,409	情報技術
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	—	300	5,640	27,967	情報技術
POWERTECH TECHNOLOGY INC	—	440	8,272	41,019	情報技術
POU CHEN	1,300	—	—	—	一般消費財・サービス

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	金額	期首		期末		業種等
			株数	金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
COMPAL ELECTRONICS	1,720	6,730	23,083	114,468	情報技術		
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,640	4,110	413,055	2,048,257	情報技術		
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,419.02	4,279.02	91,784	455,143	情報技術		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	200	—	—	—	生活必需品		
ASUSTEK COMPUTER INC	397.6	467.6	22,538	111,763	情報技術		
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,520	—	—	—	資本財・サービス		
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,740	6,230	33,642	166,823	情報技術		
台湾・ドル通貨計	株数、金額	111,541.6	111,264.35	1,253,993	6,218,303		
	銘柄数 < 比率 >	57 銘柄	64 銘柄		<15.9%>		
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
AKBANK T. A. S.	3,857.43	2,847.64	19,150	94,581	金融		
TURKIYE IS BANKASI-C	3,679.78	6,654.3	10,926	53,964	金融		
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,260.32	847.88	9,114	45,016	コミュニケーション・サービス		
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	579.46	522.58	9,098	44,934	エネルギー		
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,121.8	2,617.15	14,381	71,027	素材		
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,006.94	1,634.02	16,699	82,478	金融		
YAPI VE KREDI BANKASI	4,529.61	3,404.9	11,699	57,781	金融		
KOC HOLDING AS	827.1	772.55	18,154	89,665	資本財・サービス		
TURK HAVA YOLLARI AO	416.97	416.97	12,967	64,046	資本財・サービス		
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	—	760.21	3,899	19,261	資本財・サービス		
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	317.99	186.14	10,153	50,149	生活必需品		
トルコ・リラ通貨計	株数、金額	17,597.4	20,664.34	136,246	672,906		
	銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	11 銘柄		<1.7%>		
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
AMERICA MOVIL L	13,821	12,489	19,907	177,560	コミュニケーション・サービス		
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	216.15	165.15	2,537	22,634	生活必需品		
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,816	2,816	2,731	24,363	コミュニケーション・サービス		
CEMEX SAB-CPO	12,061.19	8,456.19	9,411	83,946	素材		
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	808	576	11,098	98,994	生活必需品		
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	157	134	2,378	21,215	生活必需品		
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	374	335	2,119	18,907	生活必需品		
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,274	940	9,999	89,190	素材		
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,536	1,467	9,014	80,404	生活必需品		
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,093	913	13,472	120,162	金融		
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額	34,156.34	28,291.34	82,672	737,381		
	銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	10 銘柄		<1.9%>		
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円		
BANCO SANTANDER CHILE	43,014.81	33,597.21	152,867	26,319	金融		
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	24.72	75.71	302,317	52,050	資本財・サービス		
FALABELLA SA	652.41	—	—	—	一般消費財・サービス		
BANCO DE CHILE	23,452.13	13,949.88	151,746	26,126	金融		
チリ・ペソ通貨計	株数、金額	67,144.07	47,622.8	606,931	104,497		
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	3 銘柄		<0.3%>		
(サウジアラビア)		百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI ARABIAN MINING	184.18	199.64	842	36,260	素材		
SABIC AGRI-NUTRIENTS	45.65	73.67	854	36,780	素材		

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI AWWAL BANK	—	158.5	596	25,684	金融	
ARAB NATIONAL BANK	—	301.58	607	26,167	金融	
BANQUE SAUDI FRANSI	—	120.01	418	18,000	金融	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	—	206.17	594	25,600	素材	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	305.37	186.97	1,383	59,549	素材	
SAUDI TELECOM CO	500.96	556.72	2,112	90,932	コミュニケーション・サービス	
AL RAJHI BANK	376.78	330.04	2,627	113,071	金融	
RIYAD BANK	211.55	330.95	837	36,037	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	—	110.98	571	24,599	コミュニケーション・サービス	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	—	143	541	23,295	素材	
ALINMA BANK	260.79	218.16	674	29,013	金融	
THE SAUDI NATIONAL BANK	798.03	839.05	2,961	127,477	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	812.99	932.89	2,630	113,227	エネルギー	
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額	3,496.3	4,708.33	18,255	785,699	
	銘柄数 < 比率 >	9銘柄	15銘柄		<2.0%>	
(インド)		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	86.18	38.6	3,974	7,710	コミュニケーション・サービス	
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	631.51	22,156	42,983	金融	
TATA STEEL LTD	6,648.91	5,385.42	94,939	184,182	素材	
AXIS BANK LTD	580.79	519.59	66,554	129,115	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	26.3	20.11	24,312	47,165	一般消費財・サービス	
TATA POWER CO LTD	532.41	318.25	13,883	26,934	公益事業	
BANK OF BARODA	802.31	476.22	12,865	24,958	金融	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	110.45	116.73	29,135	56,522	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	632.16	997.74	32,900	63,826	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	871.1	640.87	53,788	104,349	金融	
NTPC LTD	1,791.61	1,799.99	67,130	130,233	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	1,371.08	707.73	37,768	73,269	金融	
JSW STEEL LTD	377.61	280.79	26,516	51,441	素材	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,589.91	1,395.11	46,736	90,668	公益事業	
INDIAN OIL CORP LTD	2,051.09	3,291.71	56,015	108,669	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	490.66	1,726.88	52,324	101,509	エネルギー	
PUNJAB NATIONAL BANK	—	932.72	11,335	21,990	金融	
STEEL AUTHORITY OF INDIA	1,723.76	1,234.61	18,648	36,178	素材	
JINDAL STEEL & POWER LTD	167.22	141.8	14,966	29,034	素材	
CANARA BANK	—	929.9	10,904	21,155	金融	
UNION BANK OF INDIA	—	714.77	9,715	18,848	金融	
ULTRATECH CEMENT LTD	16.94	16.01	18,827	36,526	素材	
PETRONET LNG LTD	—	425.78	14,140	27,431	エネルギー	
SHRIRAM FINANCE LTD	87.66	72.46	20,533	39,834	金融	
TECH MAHINDRA LTD	202.08	186.54	27,218	52,804	情報技術	
YES BANK LTD	—	5,282.87	12,652	24,545	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	291.97	122.1	8,258	16,022	一般消費財・サービス	
REC LTD	1,677	441.16	25,395	49,267	金融	
COAL INDIA LTD	1,244.08	915.01	44,794	86,900	エネルギー	
BAJAJ FINANCE LTD	20.52	23.52	16,715	32,428	金融	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,016.11	680.58	11,647	22,596	金融	
GAIL INDIA LTD	2,125.51	1,331.39	29,178	56,606	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,009.66	917.96	63,509	123,207	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	89.16	137.48	37,598	72,941	素材	
WIPRO LTD	315.77	253.24	13,439	26,072	情報技術	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	169.75	180.98	72,771	141,176	情報技術	
INFOSYS LTD	672.87	631.37	104,217	202,181	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	190.69	128.98	46,088	89,411	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,506.26	502.5	50,159	97,309	一般消費財・サービス	
DR. REDDY'S LABORATORIES	—	17.24	11,170	21,670	ヘルスケア	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	396.74	—	—	—	金融	
HDFC BANK LIMITED	—	861.36	148,769	288,613	金融	
ICICI BANK LTD	291.01	253.26	31,226	60,580	金融	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	874.77	642.32	199,636	387,294	エネルギー	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,139.69	3,076.05	85,221	165,330	エネルギー	
ITC LTD	650.64	687.64	29,503	57,236	生活必需品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	278.1	216.03	62,709	121,655	一般消費財・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	63.97	32.43	18,025	34,969	一般消費財・サービス	
BHARTI AIRTEL LTD	407.59	317.37	45,163	87,616	コミュニケーション・サービス	
UPL LTD	198.76	364.65	20,801	40,354	素材	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	163.62	107.76	16,787	32,568	ヘルスケア	
HCL TECHNOLOGIES LTD	162.58	232.12	35,336	68,553	情報技術	
VEDANTA LTD	1,215.75	1,763.03	82,703	160,445	素材	
インド・ルピー通貨計	株数、金額	37,332.8	43,122.24	2,110,774	4,094,903	
	銘柄数 < 比率 >	45銘柄	52銘柄		<10.5%>	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	254,670	254,670	1,273,350	12,606	一般消費財・サービス	
UNITED TRACTORS TBK PT	833	—	—	—	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	7,610	8,218	3,739,190	37,017	資本財・サービス	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	20,746	13,304	3,937,984	38,986	コミュニケーション・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,311	6,085	2,866,035	28,373	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	8,487	8,487	8,338,477	82,550	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	13,780	12,111	7,569,375	74,936	金融	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	23,682	18,326	8,778,154	86,903	金融	
ADARO ENERGY TBK PT	9,498	—	—	—	エネルギー	
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額	342,617	321,201	36,502,565	361,375	
	銘柄数 < 比率 >	9銘柄	7銘柄		<0.9%>	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
LOCALIZA RENT A CAR RIGHTS SA	—	1.71	1	56	資本財・サービス	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	310	648	557	16,379	公益事業	
ENERGISA SA-UNITS	190	124	573	16,840	公益事業	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	353	—	—	—	金融	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	—	239	773	22,719	金融	
VIBRA ENERGIA SA	1,724	1,362	2,926	85,929	一般消費財・サービス	
GRUPO CASAS BAHIA SA	4,040	—	—	—	一般消費財・サービス	
NATURA & CO HOLDING SA	710	547	834	24,489	生活必需品	
TIM SA	567.26	409.26	650	19,091	コミュニケーション・サービス	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	358	799	881	25,873	生活必需品	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	2,532	1,005	29,510	ヘルスケア	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	6,654	6,636	24,765	727,069	エネルギー	
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	787	516	420	12,346	素材	
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,699.59	5,021.59	6,186	181,626	金融	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,683.36	2,588.36	8,518	250,080	金融	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	658	599	796	23,371	素材	
VALE SA	2,482.9	3,877.9	24,764	727,031	素材	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
GERDAU SA-PREF	873.6	1,580.92	2,883	84,656	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,725	4,409	17,455	512,452	エネルギー	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	914.73	1,269.74	1,316	38,656	公益事業	
ITAUSA SA	1,523.42	1,384.09	1,384	40,634	金融	
BRASKEM SA-PREF A	484	484	883	25,932	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	134	137	577	16,944	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	1,014	1,468	3,941	115,717	金融	
COSAN SA	660	516	729	21,420	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	710	686	2,620	76,933	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,460	905	878	25,798	公益事業	
EMBRAER SA	462	287	1,076	31,605	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	1,390	1,363	1,455	42,736	素材	
CCR SA	779	669	812	23,843	資本財・サービス	
BRF SA	2,069	705	1,614	47,397	生活必需品	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	205	117	955	28,063	公益事業	
LOJAS RENNER S. A.	435.75	525.75	695	20,420	一般消費財・サービス	
JBS SA	1,466	1,260	3,951	116,004	生活必需品	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	282	178	136	4,013	素材	
SUZANO SA	249.45	335.45	1,912	56,134	素材	
LOCALIZA RENT A CAR	—	170	741	21,760	資本財・サービス	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	1,434	1,046	1,260	37,003	生活必需品	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,972	1,598	1,690	49,635	金融	
CIELO SA	1,769.28	—	—	—	金融	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	375	369	1,199	35,207	公益事業	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	318.3	51.09	65	1,921	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	450	394	1,086	31,902	金融	
TELEFONICA BRASIL S. A.	406	280	1,292	37,936	コミュニケーション・サービス	
KLABIN SA - UNIT	396	449.9	965	28,331	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,304	673	1,471	43,210	エネルギー	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	597	333	949	27,862	金融	
COGNA EDUCACAO	3,091	—	—	—	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	1,540.21	1,476.21	1,659	48,712	金融	
AMBEV SA	2,063	1,933	2,213	64,977	生活必需品	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額	63,769.85	52,953.97	133,531	3,920,244	
	銘柄数 < 比率 >	46銘柄	46銘柄		<10.0%>	
(中国)		百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	2,281	2,812	596	13,172	資本財・サービス	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	1,676	1,952	3,439	75,998	金融	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	2,163	2,163	1,280	28,294	金融	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	718	974	4,088	90,348	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-A	4,746	6,347	3,782	83,586	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	160	238	445	9,839	ヘルスケア	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8	11	1,634	36,112	生活必需品	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	318	392	938	20,736	素材	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	681	1,171	1,036	22,899	不動産	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,429	3,983	3,385	74,808	金融	
CITIC SECURITIES CO-A	296	350	631	13,951	金融	
CHINA MERCHANTS BANK-A	895	1,191	4,133	91,345	金融	
PING AN BANK CO LTD-A	1,146	1,841	1,888	41,737	金融	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	5,832	7,173	3,894	86,064	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	222	222	593	13,121	一般消費財・サービス	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	1,082	942	1,290	28,516	一般消費財・サービス	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	—	356	935	20,672	エネルギー	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	439	439	224	4,956	金融	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	—	2,004	1,126	24,886	資本財・サービス	
CHINA COAL ENERGY CO-A	481	236	301	6,659	エネルギー	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	616.6	1,288.6	2,001	44,219	資本財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	1,557	2,013	634	14,011	資本財・サービス	
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-A	622	622	472	10,431	素材	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	178	230	541	11,958	素材	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	50	75	176	3,889	エネルギー	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	306	466	358	7,918	金融	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	9,186	7,319	3,315	73,260	金融	
BANK OF CHINA LTD-A	2,832	3,134	1,485	32,824	金融	
PETROCHINA CO LTD-A	—	1,642	1,747	38,604	エネルギー	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	3,493	3,711	2,415	53,381	エネルギー	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	581	468	1,375	30,392	公益事業	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,786	3,988	3,098	68,469	金融	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	421	311	1,411	31,198	エネルギー	
CHINA VANKE CO LTD -A	989	1,715	1,190	26,299	不動産	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	434	434	1,241	27,436	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	932	932	638	14,106	金融	
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,547	5,812	2,237	49,443	金融	
PICC HOLDING CO-A	677	677	356	7,883	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	5,132	5,455	1,789	39,535	金融	
CRRC CORP LTD-A	1,541	1,283	986	21,800	資本財・サービス	
CHINA UNITED NETWORK-A	2,303	2,609	1,231	27,210	コミュニケーション・サービス	
CGN POWER CO LTD-A	189	189	90	2,000	公益事業	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	305	305	372	8,235	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	463	628	525	11,600	金融	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	2,913	2,913	1,890	41,774	資本財・サービス	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	—	1,553	1,144	25,290	金融	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	1,880	1,682	1,175	25,979	素材	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	142	186	576	12,728	金融	
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,943	2,150	1,410	31,164	金融	
BYD CO LTD -A	20	20	489	10,810	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-A	335	335	477	10,540	資本財・サービス	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	475	547	993	21,961	素材	
HUANENG POWER INTL INC-A	625	389	378	8,363	公益事業	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	1,802	1,802	931	20,585	金融	
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	76,848.6	91,680.6	74,809	1,653,022	
	銘柄数 < 比率 >	50銘柄	54銘柄		< 4.2% >	
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	1,338	1,338	1,351	46,244	金融	
PUBLIC BANK BERHAD	3,096	2,308	934	31,986	金融	
TOP GLOVE CORP BHD	8,244	7,209	857	29,356	ヘルスケア	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,104	—	—	—	素材	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,997	2,624	1,836	62,855	金融	
TENAGA NASIONAL BHD	—	587	835	28,604	公益事業	
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	16,779	14,066	5,816	199,046	
	銘柄数 < 比率 >	5銘柄	5銘柄		< 0.5% >	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			株数	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
(南アフリカ)						
AngloGold Ashanti Plc	—	192.38	9,508	83,962	素材	
NEPI ROCKCASTLE NV	—	219.15	2,891	25,533	不動産	
NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	—	245.87	3,121	27,565	素材	
GOLD FIELDS LTD	321.82	255.47	7,298	64,443	素材	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	20.41	17.55	4,659	41,143	金融	
OLD MUTUAL LTD	1,817.77	—	—	—	金融	
VODACOM GROUP LTD	262.91	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	234.99	173.76	5,012	44,258	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	196.67	173.16	4,536	40,059	金融	
BIDVEST GROUP LTD	116.04	147.04	4,161	36,743	資本財・サービス	
BID CORP LTD	141.23	118.07	5,098	45,016	生活必需品	
STANDARD BANK GROUP LTD	528.79	421.51	8,967	79,184	金融	
SASOL LTD	375.33	547.88	8,120	71,700	素材	
REMGRO LTD	—	156.93	2,181	19,261	金融	
DISCOVERY LTD	207.81	190.08	2,651	23,417	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	137.92	—	—	—	エネルギー	
KUMBA IRON ORE LTD	62	—	—	—	素材	
SANLAM LTD	764.9	602.81	5,025	44,376	金融	
FIRSTRAND LTD	1,834.84	2,106.73	16,263	143,610	金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	439.25	497.25	3,162	27,924	一般消費財・サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	226.27	239.21	3,097	27,353	一般消費財・サービス	
ABSA GROUP LTD	420.12	377.92	6,013	53,095	金融	
NASPERS LTD-N SHS	21.51	45.83	16,198	143,031	一般消費財・サービス	
MTN GROUP LTD	784.02	784.02	6,554	57,875	コミュニケーション・サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	333.74	847.11	8,138	71,860	素材	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	171.38	—	—	—	素材	
SPAR GROUP LIMITED/THE	234.78	—	—	—	生活必需品	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	35.72	48.57	3,093	27,317	素材	
SIBANYE STILLWATER LTD	2,538.4	5,384.83	11,458	101,182	素材	
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額	12,228.62	13,793.13	147,216	1,299,918	
	銘柄数 < 比率 >	25 銘柄	23 銘柄		< 3.3% >	
		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
(タイ)						
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,569	1,620	16,929	74,487	金融	
TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	6,849	7,769	6,953	30,594	コミュニケーション・サービス	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	—	—	—	金融	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	605	535	12,091	53,200	素材	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	385	385	4,908	21,598	金融	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	979	1,522	19,405	85,384	金融	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,551	26,967	4,692	20,645	金融	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,327	2,691	5,085	22,378	素材	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	465	465	9,765	42,966	コミュニケーション・サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	5,817	6,716	11,820	52,008	金融	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	5,773	15,165	7,582	33,363	エネルギー	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,587	2,365	6,267	27,575	ヘルスケア	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	711	867	13,178	57,984	エネルギー	
IRPC PCL - NVDR	14,741	—	—	—	エネルギー	
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,200	1,263	4,830	21,256	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	15,115	13,671	44,772	196,999	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	1,127	1,281	7,045	31,000	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	2,206	2,721	14,897	65,548	生活必需品	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	711	711	9,634	42,389	金融	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額 千タイ・パーツ	邦貨換算金額 千円	
LAND & HOUSES PUB - NVDR CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	百株 4,447 4,599 2,418	百株 — 4,097 2,910	— 9,627 8,802	— 42,362 38,732	不動産 生活必需品 素材
タイ・パーツ通貨計	株 数、金 額 104,453	株 数、金 額 93,721	218,290	960,477	
	銘 柄 数 < 比 率 > < 2.5% >	19 銘柄			
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額 5,346,377.26	株 数、金 額 5,338,754.5	—	32,123,916	
	銘 柄 数 < 比 率 > < 82.3% >	423 銘柄	420 銘柄		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘 柄	株 数	株 数	期 末	
			評 価 額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 971.6	千口 1,295.5	26,823	4,323,115
アメリカ・ドル通貨計	口 数、金 額 971.6	口 数、金 額 1,295.5	26,823	4,323,115
	銘 柄 数 < 比 率 > < 11.1% >	1 銘柄		
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 —	千口 113.1	2,551	22,757
メキシコ・ペソ通貨計	口 数、金 額 —	口 数、金 額 113.1	2,551	22,757
	銘 柄 数 < 比 率 > < 0.1% >	1 銘柄		
(南アフリカ) GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 —	千口 301.81	3,727	32,912
南アフリカ・ランド通貨計	口 数、金 額 —	口 数、金 額 301.81	3,727	32,912
	銘 柄 数 < 比 率 > < 0.1% >	1 銘柄		
合 計	口 数、金 額 971.6	口 数、金 額 1,710.41	—	4,378,786
	銘 柄 数 < 比 率 > < 11.2% >	3 銘柄		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 2,267	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	32,123,916	81.5
投資証券	4,378,786	11.1
コール・ローン等、その他	2,905,759	7.4
投資信託財産総額	39,408,461	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=161.17円、1香港・ドル=20.64円、1台湾・ドル=4.958円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、100チリ・ペソ=17.217円、1サウジアラビア・リアル=43.04円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1オフショア・人民元=22.09円、1マレーシア・リングgit=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(38,774,854千円)の投資信託財産総額(39,408,461千円)に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	39,453,354,175円
コール・ローン等	1,816,394,563
株式(評価額)	32,123,916,007
投資証券(評価額)	4,378,786,139
未収入金	101,878,210
未収配当金	338,279,684
差入委託証拠金	694,099,572
(B) 負債	435,745,969
未払金	377,903,410
未払解約金	57,717,700
その他未払費用	124,859
(C) 純資産総額(A-B)	39,017,608,206
元本	13,601,496,638
次期繰越損益金	25,416,111,568
(D) 受益権総口数	13,601,496,638口
1万口当り基準価額(C/D)	28,686円

* 期首における元本額は13,257,532,975円、当作成期間中における追加設定元本額は2,620,368,540円、同解約元本額は2,276,404,877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：
 新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 108,177,566円
 ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 461,810,865円
 ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 339,209,536円
 D-1's 新興国株式インデックス 120,251,334円
 iFree 新興国株式インデックス 6,961,799,554円
 iFree 8資産バランス 3,522,125,045円
 ダイワ新興国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用) 8,840,084円
 新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド(為替ヘッジなし/適格機関投資家専用) 656,144円
 DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド 1,662,378,853円
 ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 310,223,199円
 ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド 106,024,458円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は28,686円です。

■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,521,540,127円
受取配当金	1,459,367,114
受取利息	40,243,818
その他収益金	22,060,453
支払利息	△ 131,258
(B) 有価証券売買損益	6,617,154,467
売買益	8,912,295,086
売買損	△ 2,295,140,619
(C) 先物取引等損益	90,648,495
取引益	237,245,866
取引損	△ 146,597,371
(D) その他費用	△ 120,032,240
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	8,109,310,849
(F) 前期繰越損益金	16,550,630,086
(G) 解約差損益金	△ 2,984,712,910
(H) 追加信託差損益金	3,740,883,543
(I) 合計 (E + F + G + H)	25,416,111,568
次期繰越損益金 (I)	25,416,111,568

(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。

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」は、いかなる形式においても FTSE International Limited (以下「FTSE」)、ロンドン証券取引所グループ会社 (以下「LSEG」)、または Research Affiliates LLC (以下「RA」) (以下、総称して「ライセンス各社」) によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンス各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまた RA と共同し FTSE によってルールに基づき計算されます。いずれのライセンス各社も、指数における瑕疵については (過失の有無に関わらず) 何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE® は LSEG の商標です。Fundamental Index® および RAFI® は Research Affiliates, LLC の登録商標です。

The Daiwa Emerging Equity Fundamental Index Mother Fund is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.