

# iFree 新興国債券 インデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第8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)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公社債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期騰落率	(ベンチマーク)	期騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
4 期末 (2020年 7月 6 日)	11,102	0	△ 3.8	11,446	△ 3.4	95.4	3,846
5 期末 (2021年 7月 5 日)	12,040	0	8.4	12,475	9.0	96.9	5,577
6 期末 (2022年 7月 5 日)	11,855	0	△ 1.5	12,373	△ 0.8	96.5	7,534
7 期末 (2023年 7月 5 日)	14,015	0	18.2	14,731	19.1	96.6	11,938
8 期末 (2024年 7月 5 日)	15,901	0	13.5	16,569	12.5	97.6	17,890

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

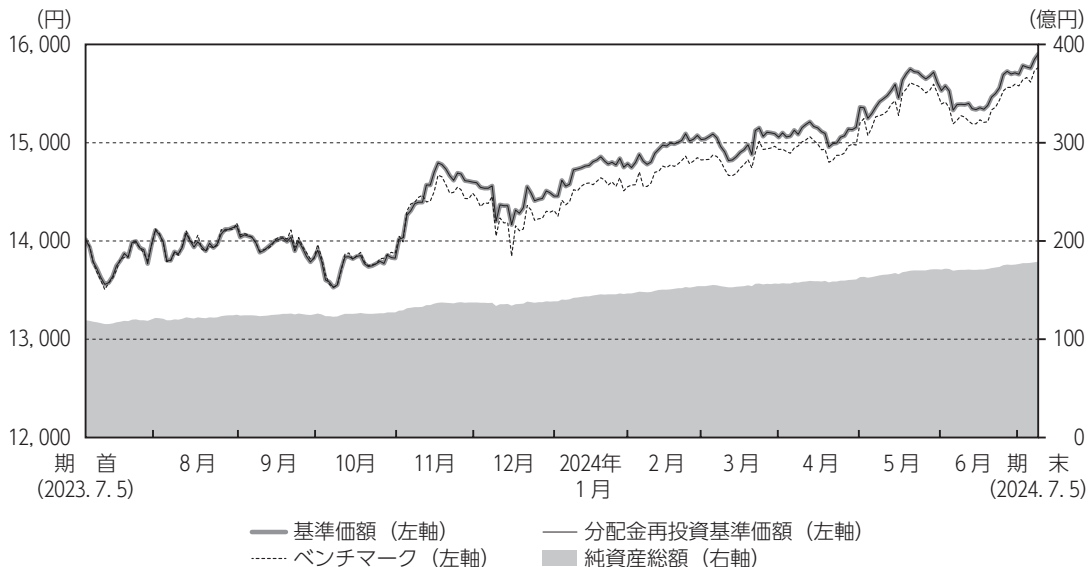
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

### 基準価額・騰落率

期首：14,015円

期末：15,901円（分配金0円）

騰落率：13.5%（分配金込み）

### 基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことから、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。

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公 社 債 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%
(期首)2023年7月5日	14,015	—	14,731	—	96.6
7月末	13,964	△ 0.4	14,672	△ 0.4	96.6
8月末	14,149	1.0	14,906	1.2	95.8
9月末	13,825	△ 1.4	14,523	△ 1.4	96.0
10月末	13,825	△ 1.4	14,579	△ 1.0	96.4
11月末	14,599	4.2	15,225	3.4	96.7
12月末	14,455	3.1	15,040	2.1	96.1
2024年1月末	14,786	5.5	15,294	3.8	96.6
2月末	15,032	7.3	15,581	5.8	95.7
3月末	15,056	7.4	15,694	6.5	96.4
4月末	15,362	9.6	15,980	8.5	95.7
5月末	15,530	10.8	16,179	9.8	94.6
6月末	15,696	12.0	16,372	11.1	94.8
(期末)2024年7月5日	15,901	13.5	16,569	12.5	97.6

(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

(2023.7.6 ~ 2024.7.5)

### 新興国債券市況

新興国債券市場では、金利は国によってまちまちの動きとなりました。

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

### 為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当作成期首より、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、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。2023年8月には、米国の金融引き締めの長期化観測から米国金利が上昇し、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。10月から年末にかけても、米国の金融引き締め観測の後退が通貨への上昇圧力となり、続伸しました。2024年に入り、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことで円安が進行し、ポーランド・ズロチや南アフリカ・ランドなどを筆頭に、対円で上昇しました。3月以降も、日銀が大規模な金融緩和を終了した後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことなどを受け、新興国通貨は対円で上昇基調が継続しました。しかし当作成期末にかけては、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨などが対円で下落（円高）しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2023. 7. 6 ~ 2024. 7. 5)

## ■当ファンド

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

## ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

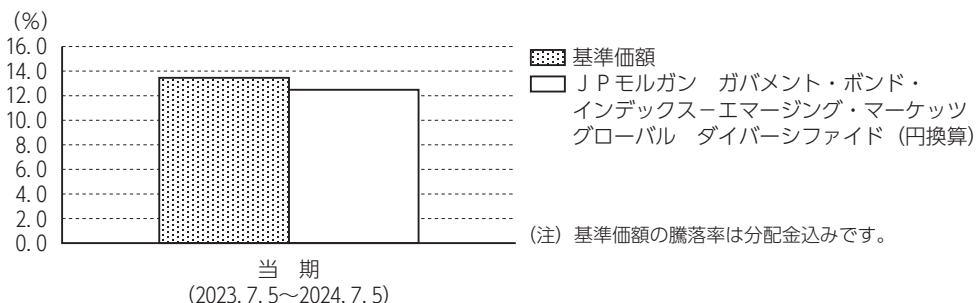
\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は12.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.5%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。マザーファンドが保有するロシア国債の評価額を0としていましたが、当作成期中に時価で売却できたことなどがプラスに寄与しました。

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少額だったため、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7月6日 ～2024年7月5日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	5,900

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



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023.7.6~2024.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	35円	0.242%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は14,636円です。
(投 信 会 社)	(16)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(16)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	14	0.095	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(11)	(0.078)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	49	0.336	

(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。

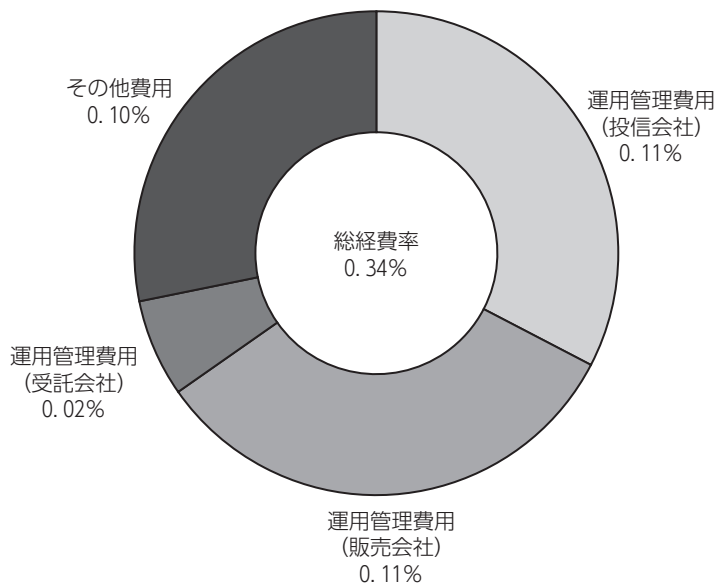
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.34%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7月6日から2024年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	2,372,086	4,280,515	164,466	291,139

(注) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

## ■組入資産明細表

## 親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	6,956,174	9,163,794	17,854,737			

(注) 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
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	17,854,737	99.3
コール・ローン等、その他	125,166	0.7
投資信託財産総額	17,979,903	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価をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=161.17円、1エジプト・ポンド=3.352円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100チリ・ペソ=17.217円、100コロンビア・ペソ=3.937円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1チェコ・コルナ=6.934円、1ルーマニア・レイ=35.024円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リングギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円、1ペルー・ソル=42.457円、1ポーランド・ズロチ=40.693円、100ハンガリー・フォリント=44.35円、1ウルグアイ・ペソ=4.016円、1ドミニカ・ペソ=2.726円です。

(注3) 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(49,724,916千円)の投資信託財産総額(50,994,603千円)に対する比率は、97.5%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,979,903,953円
コール・ローン等	91,698,028
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	17,854,737,386
未収入金	33,468,539
(B) 負債	89,545,999
未払解約金	69,800,856
未払信託報酬	19,094,291
その他未払費用	650,852
(C) 純資産総額(A-B)	17,890,357,954
元本	11,251,329,697
次期繰越損益金	6,639,028,257
(D) 受益権総口数	11,251,329,697口
1万口当り基準価額(C/D)	15,901円

\* 期首における元本額は8,518,605,547円、当作成期間中における追加設定元本額は5,530,190,379円、同解約元本額は2,797,466,229円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,901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	10,348円
受取利息	20,211
支払利息	△ 9,863
(B) 有価証券売買損益	1,788,652,247
売買益	1,964,931,523
売買損	△ 176,279,276
(C) 信託報酬等	△ 35,760,604
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,752,901,991
(E) 前期繰越損益金	1,306,598,885
(F) 追加信託差損益金	3,579,527,381
(配当等相当額)	( 2,373,791,273)
(売買損益相当額)	( 1,205,736,108)
(G) 合計(D+E+F)	6,639,028,257
次期繰越損益金(G)	6,639,028,257
追加信託差損益金	3,579,527,381
(配当等相当額)	( 2,373,791,273)
(売買損益相当額)	( 1,205,736,108)
分配準備積立金	3,059,500,876

(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	10,348円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,752,881,258
(c) 収益調整金	3,579,527,381
(d) 分配準備積立金	1,306,609,270
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,639,028,257
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,639,028,257
(h) 受益権総口数	11,251,329,697口

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第14期（決算日 2024年7月5日）

（作成対象期間 2023年7月6日～2024年7月5日）

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

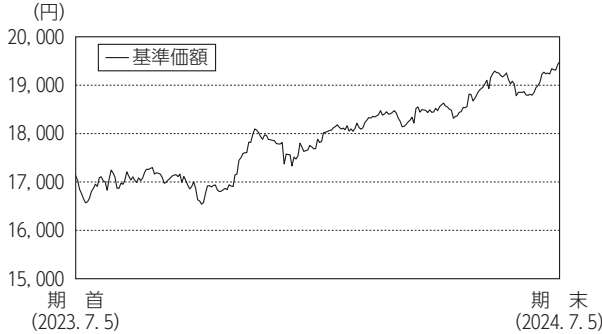
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：17,126円 期末：19,484円 騰落率：13.8%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市場では、金利は国によってまちまちの動きとなりました。

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

○為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当作成期首より、F R B（米連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。2023年8月には、米国の金融引き締め長期化観測から米国金利が上昇し、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。10月から年末にかけても、米国の金融引き締め観測の後退が通貨への上昇圧力となり、続伸しました。2024年に入り、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことでも円安が進行し、ポーランド・ズロチや南アフリカ・ランドなどを筆頭に、対円で上昇しました。3月以降も、日銀が大規模な金融緩和を終了した後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことを受け、新興国通貨は対円で上昇基調が継続しました。しかし当作成期末にかけては、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨などが対円で下落（円高）しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は12.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.8%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。当ファンドが保有するロシア国債の評価額を0としていましたが、当作成期中に時価で売却できたことなどがプラスに寄与しました。

\*ベンチマークはJ P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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 モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
(期首) 2023年 7月 5日	円 17,126	% —	円 18,554	% —	% 96.8
7月 末	17,067	△ 0.3	18,480	△ 0.4	96.8
8月 末	17,297	1.0	18,775	1.2	96.0
9月 末	16,904	△ 1.3	18,293	△ 1.4	96.2
10月 末	16,907	△ 1.3	18,364	△ 1.0	96.6
11月 末	17,859	4.3	19,177	3.4	96.9
12月 末	17,686	3.3	18,944	2.1	96.3
2024年 1月 末	18,096	5.7	19,263	3.8	96.8
2月 末	18,401	7.4	19,625	5.8	95.9
3月 末	18,435	7.6	19,768	6.5	96.6
4月 末	18,814	9.9	20,128	8.5	95.8
5月 末	19,024	11.1	20,378	9.8	94.8
6月 末	19,232	12.3	20,622	11.1	94.9
(期末) 2024年 7月 5日	19,484	13.8	20,870	12.5	97.8

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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・エマーゼィング・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 モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・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。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 《今後の運用方針》

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

## ■ 1万口当りの費用の明細

項目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	15 ( 14)
(その他)	( 1)
合 計	15

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### 公 社 債

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期	当 期				期 末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 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	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 180,230	千トルコ・リラ 154,349		762,318	1.5	1.5	0.6	0.8	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 623,950	千メキシコ・ペソ 553,665		4,938,307	9.9	—	4.9	3.7	1.3
チリ	千チリ・ペソ 5,555,000	千チリ・ペソ 5,387,353		927,556	1.9	—	1.3	0.1	0.5
コロンビア	千コロンビア・ペソ 62,640,000	千コロンビア・ペソ 53,549,290		2,108,289	4.2	—	2.9	1.2	0.2
インド	千インド・ルピー 250,000	千インド・ルピー 250,436		485,846	1.0	—	0.8	0.1	—
インドネシア	千インドネシア・ルピア 488,969,000	千インドネシア・ルピア 495,964,825		4,910,051	9.8	—	6.3	2.6	0.9
ブラジル	千ブラジル・リアル 179,650	千ブラジル・リアル 152,187		4,467,944	8.9	—	1.5	3.5	4.0
チェコ	千チェコ・コルナ 467,100	千チェコ・コルナ 435,080		3,016,847	6.0	—	3.6	1.3	1.2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 58,300	千ルーマニア・レイ 56,761		1,988,036	4.0	—	2.0	1.1	0.8
中国	千オフショア・人民元 212,300	千オフショア・人民元 221,406		4,892,292	9.8	—	4.5	3.7	1.6
マレーシア	千マレーシア・リンギット 141,570	千マレーシア・リンギット 143,898		4,924,200	9.8	—	5.8	2.9	1.2
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 575,710	千南アフリカ・ランド 487,914		4,308,281	8.6	—	7.4	1.2	—
タイ	千タイ・バーツ 1,035,660	千タイ・バーツ 1,038,378		4,568,866	9.1	—	5.0	3.1	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 26,330	千ペルー・ソル 25,739		1,092,820	2.2	—	1.6	0.6	—

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			未 期			
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 104,180	千ポーランド・ズロチ 96,204	千円 3,914,876	% 7.8	% —	% 3.1	% 3.5	% 1.3
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,718,500	千ハンガリー・フォリント 3,200,150	1,419,273	2.8	—	1.1	1.1	0.7
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 25,800	千ウルグアイ・ペソ 24,884	99,942	0.2	—	0.2	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 23,900	千ドミニカ・ペソ 26,733	72,895	0.1	0.1	0.1	—	—
合計	—	—	48,898,647	97.8	1.7	52.7	30.3	14.8

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

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



ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			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		
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	22,000,000	22,700,040	224,730	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	20,500,000	21,258,910	210,463	2040/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	18,100,000	17,746,145	175,686	2026/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	26,300,000	25,592,004	253,360	2031/02/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	6,849,371	67,808	2036/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	36,300,000	34,932,579	345,832	2032/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	15,700,000	15,071,843	149,211	2027/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	15,000,000	15,002,100	148,520	2042/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,545,182	25,197	2037/07/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	19,800,000	19,783,566	195,857	2033/02/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	16,100,000	15,878,947	157,201	2028/08/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,300,000	11,308,588	111,955	2043/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,000,000	11,050,930	109,404	2038/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.6250	14,500,000	14,057,025	139,164	2034/02/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.8750	16,500,000	16,456,935	162,923	2029/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	6,400,000	6,715,392	66,482	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,079,116	40,383	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,380,483	33,466	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	20,024,000	20,722,437	205,152	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,085,112	50,342	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	16,030,000	16,154,873	159,933	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	16,450,000	16,080,533	159,197	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	14,075,000	13,684,559	135,477	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	26,920,000	29,361,644	290,680	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	13,020,000	14,057,824	139,172	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金 額			488,969,000	495,964,825	4,910,051		
				千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル			
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	21,650	20,950	615,053	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	22,400	21,025	617,256	2029/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	11,100	10,124	297,250	2031/01/01	
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	10,400	9,338	274,147	2033/01/01	
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	3,100	2,755	80,895	2035/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	17,300	15,588	457,649	2025/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	29,700	25,215	740,290	2026/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	33,500	26,863	788,675	2026/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	15,900	11,335	332,795	2027/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	5,600	2,956	86,797	2030/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	9,000	6,033	177,132	2028/01/01	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			179,650	152,187	4,467,944		
				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ			
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	26,600	25,119	174,178	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	24,100	23,631	163,857	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	27,400	25,851	179,251	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	27,500	23,187	160,871	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	31,500	28,649	198,653	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	29,500	27,883	193,345	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	29,500	24,766	171,728	2033/10/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	28,700	24,010	166,488	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	15,500	12,605	87,408	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	15,300	15,318	106,215	2036/12/04	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	29,500	24,898	172,644	2032/06/23	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	17,196	119,238	2025/02/14	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	16,500	11,318	78,481	2040/04/24
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	15,700	14,769	102,412	2035/05/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	19,500	20,132	139,600	2026/02/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	26,000	27,414	190,095	2030/09/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	20,500	21,778	151,011	2028/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	14,000	10,829	75,093	2037/07/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	16,000	16,927	117,374	2034/04/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	14,000	15,071	104,509	2029/03/29
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2000	8,000	9,036	62,658	2031/06/16
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	14,300	14,683	101,818	2032/11/11
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		467,100	435,080	3,016,847	
ルーマニア				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	2,431	85,156	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,771	97,076	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,451	85,861	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,451	85,855	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,407	84,317	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,248	78,747	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	2,600	2,439	85,440	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,750	2,611	91,478	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,192	76,783	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,300	80,577	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	2,053	71,905	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,148	75,259	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	3,000	2,988	104,678	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,300	1,833	64,226	2036/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,937	67,857	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	3,100	3,375	118,207	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	2,700	2,928	102,585	2028/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	2,700	2,877	100,795	2030/04/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	2,600	2,847	99,734	2038/02/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,400	1,429	50,083	2026/10/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	2,300	2,370	83,013	2033/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3500	2,500	2,602	91,138	2031/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,800	1,844	64,613	2027/05/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	1,000	1,018	35,666	2034/07/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.3000	200	199	6,975	2029/04/25
通貨小計	銘柄数 金 額	25銘柄		58,300	56,761	1,988,036	
中国				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	3,785	83,655	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,078	112,223	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,275	138,662	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,952	109,432	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,342	95,955	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	6,021	133,060	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,941	109,187	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	4,000	4,123	91,106	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,521	144,110	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,129	157,536	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,250	116,024	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,761	149,400	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,992	88,224	2026/03/11

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	
			%	千円	千円	千円	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	7,171	158,461	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,206	115,036	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,447	54,073	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,391	163,335	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,591	101,456	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,867	41,265	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	2,000	2,379	52,569	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,668	81,057	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,838	62,728	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,114	68,809	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,623	80,071	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,239	49,479	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	2,000	2,302	50,877	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,593	57,303	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,723	82,265	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,770	83,313	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,095	68,401	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,923	86,699	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,640	36,245	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,396	75,041	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,254	71,921	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,334	29,484	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,855	85,183	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	3,026	66,876	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,112	68,773	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,200	3,278	72,450	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,631	58,146	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,620	57,894	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,836	84,776	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,378	74,652	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	2,200	2,509	55,441	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,309	73,123	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	3,082	68,122	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	3,000	3,046	67,326	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	1,000	1,017	22,483	2033/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	4,500	4,543	100,389	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	4,700	4,824	106,594	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,000	2,222	49,102	2053/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	4,000	4,088	90,351	2028/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	3,000	3,043	67,247	2026/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	2,400	2,472	54,641	2033/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	4,300	4,403	97,311	2030/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	4,000	4,025	88,945	2027/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	5,500	5,519	121,962	2034/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,502	33,206	2027/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	1,300	1,303	28,808	2034/05/25
通貨小計	銘柄数	59銘柄					
	金 額			212,300	221,406	4,892,292	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	4,650	4,712	161,253	2026/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,837	62,886	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	4,400	4,527	154,918	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,916	65,598	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	3,700	3,778	129,285	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,221	144,463	2026/03/31

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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	
			%	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ	千円		
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	39,200	41,807	183,955	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	34,600	36,508	160,636	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	48,400	48,129	211,769	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	48,500	52,386	230,499	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	32,123	141,344	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	44,500	45,324	199,428	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	56,500	58,875	259,051	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	38,500	36,768	161,780	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	20,500	18,254	80,318	2035/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	43,000	42,440	186,738	2025/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	40,900	36,214	159,341	2035/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	66,500	63,812	280,776	2031/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	29,000	24,458	107,615	2042/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	61,000	58,617	257,918	2027/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	56,000	56,510	248,647	2028/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	48,500	51,153	225,077	2037/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	43,500	43,491	191,363	2026/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	39,000	40,194	176,857	2043/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	49,000	51,612	227,093	2033/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	50,000	49,835	219,274	2027/03/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	37,000	36,880	162,272	2029/03/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	21,000	21,202	93,289	2034/06/17	
通貨小計	銘柄数	24銘柄						
	金 額			1,035,660	1,038,378	4,568,866		
				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,270	2,334	99,108	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	3,350	3,231	137,222	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	3,400	3,420	145,208	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,850	2,516	106,826	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,500	1,211	51,436	2040/08/12	
	PERU GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	3,900	4,001	169,874	2033/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	725	767	32,589	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	4,465	4,284	181,920	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,870	3,971	168,633	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			26,330	25,739	1,092,820		
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	9,190	8,712	354,522	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	6,540	6,016	244,825	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	10,850	9,468	385,321	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	5,550	5,380	218,944	2025/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	9,400	7,271	295,900	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	6,300	5,627	229,003	2026/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	8,150	6,166	250,917	2032/04/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,150	5,885	239,510	2027/05/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	9,400	10,054	409,141	2028/07/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,350	4,083	166,174	2025/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	9,900	10,081	410,265	2033/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,800	3,661	148,992	2029/07/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,100	1,037	42,212	2034/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,318	257,110	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,550	6,439	262,034	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			104,180	96,204	3,914,876		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ハンガリー・フォリント	千円	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	270,000	240,985	106,877	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	118,800	52,688	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	443,000	443,208	196,563	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	183,640	81,444	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	218,105	96,730	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000	250,857	111,255	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	132,697	58,851	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	224,000	205,266	91,036	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	109,119	48,394	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	315,000	222,226	98,557	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	90,149	39,981	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	240,000	149,834	66,451	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	50,716	22,492	2034/06/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	92,834	41,172	2028/03/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	235,000	204,482	90,688	2032/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	9.5000	110,000	116,367	51,609	2026/10/21
HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0000	90,000	90,852	40,293	2035/10/24	
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500	280,005	124,183	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			3,718,500	3,200,150	1,419,273	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,744	11,021	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	12,000	11,124	44,676	2031/05/21
	URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	国債証券	9.7500	11,000	11,016	44,244	2033/07/20
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金 額			25,800	24,884	99,942	
ドミニカ共和国	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,400	13,503	36,820	2033/02/03
	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	11.2500	12,500	13,230	36,074	2035/09/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			23,900	26,733	72,895	
合 計	銘柄数	336銘柄					
	金 額					48,898,647	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	48,898,647千円	95.9%
コール・ローン等、その他	2,095,956	4.1
投資信託財産総額	50,994,603	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=161.17円、1エジプト・ポンド=3.352円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100チリ・ペソ=17.217円、100コロンビア・ペソ=3.937円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1チェコ・コルナ=6.934円、1ルーマニア・レイ=35.024円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円、1ペルー・ソル=42.457円、1ポーランド・ズロチ=40.693円、100ハンガリー・フォリント=44.35円、1ウルグアイ・ペソ=4.016円、1ドミニカ・ペソ=2.726円です。

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

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

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

\* 期首における元本額は21,584,689,967円、当作成期間中における追加設定元本額は4,952,885,960円、同解約元本額は863,683,203円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

新興国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	566,573,779円
ダイワファンドラップ外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし)	471,719,952円
ダイワファンドラップオンライン外国債券インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし)	554,580,579円
D-I's 新興国債券インデックス	68,244,463円
iFree 新興国債券インデックス	9,163,794,594円
iFree 8資産バランス	4,957,148,762円
ダイワ新興国債券インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	5,424,061円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	9,723,288,730円
スタイル9(8資産分散・保守型)	34,302円
スタイル9(8資産分散・バランス型)	757,476円
スタイル9(8資産分散・積極型)	905,888円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	122,575,478円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	38,844,660円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,484円です。



■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

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

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

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