

ダイワ・インドネシア・ ルピア債オープン (年1回決算型)

運用報告書(全体版) 第8期

(決算日 2021年10月18日)

(作成対象期間 2020年10月20日～2021年10月18日)

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、インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保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/>

★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		
信託期間	約15年 1 カ月間（2013年 9 月 5 日～2028年10月17日）		
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保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・インドネシア・ルピア債マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド	インドネシア・ルピア建債券	
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。		

最近5期の運用実績

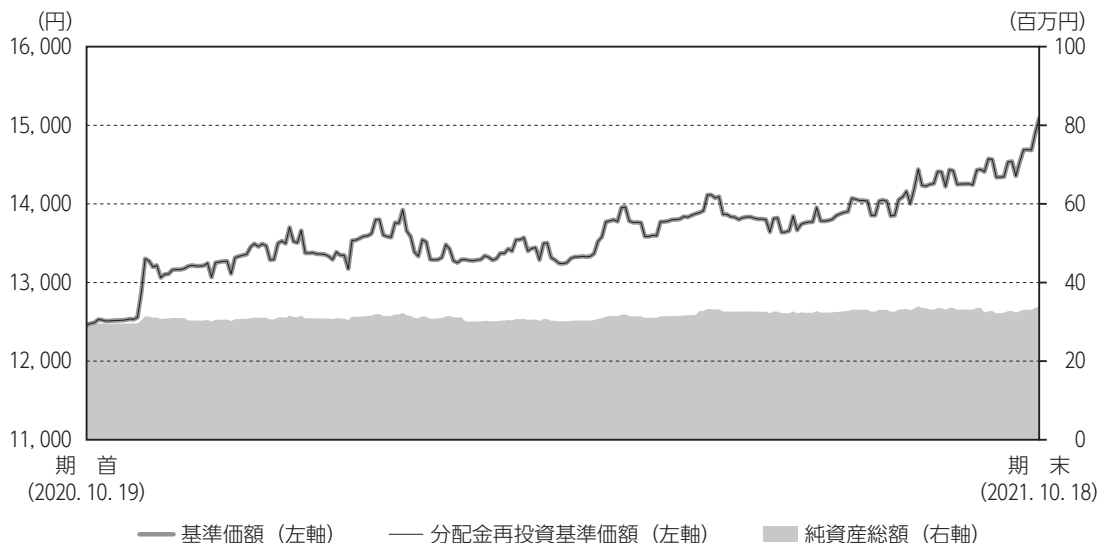
決 算 期	基 準 価 額			J Pモルガン GB IーEM インドネシア（円換算）		公 社 債 組入比率	純資産 総 額
	（分配落）	税込み 分配金	期 中 騰落率	（参考指数）	期 中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
4 期末 (2017年10月17日)	12, 921	0	12. 0	14, 657	15. 2	96. 2	43
5 期末 (2018年10月17日)	10, 600	0	△ 18. 0	12, 281	△ 16. 2	95. 8	26
6 期末 (2019年10月17日)	12, 570	0	18. 6	15, 178	23. 6	96. 1	35
7 期末 (2020年10月19日)	12, 457	0	△ 0. 9	15, 747	3. 7	95. 1	29
8 期末 (2021年10月18日)	15, 091	0	21. 1	19, 699	25. 1	94. 8	33

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) J Pモルガン GB IーEM インドネシア（円換算）は、J Pモルガン GB IーEM インドネシア（インドネシア・ルピアベース）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 GB IーEM インドネシア（インドネシア・ルピアベース）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



* 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。

基準価額・騰落率

期 首：12,457円

期 末：15,091円（分配金 0 円）

騰落率：21.1%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

インドネシア・ルピア建ての債券に投資した結果、金利が低下（債券価格は上昇）したことやインドネシア・ルピアが対円で上昇（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。

ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年１回決算型）

年 月 日	基 準 価 額		ＪＰモルガン　ＧＢＩ－ＥＭ インドネシア（円換算）		公 社 債 組入比率
		騰 落 率	（参考指数）	騰 落 率	
	円	%		%	%
（期首）2020年10月19日	12, 457	—	15, 747	—	95. 1
10月末	12, 520	0. 5	15, 864	0. 7	95. 2
11月末	13, 210	6. 0	16, 763	6. 5	96. 8
12月末	13, 527	8. 6	17, 115	8. 7	95. 0
2021年 1 月末	13, 539	8. 7	17, 133	8. 8	94. 7
2 月末	13, 515	8. 5	17, 098	8. 6	94. 2
3 月末	13, 542	8. 7	17, 276	9. 7	94. 5
4 月末	13, 522	8. 5	17, 393	10. 5	92. 6
5 月末	13, 782	10. 6	17, 791	13. 0	93. 4
6 月末	13, 818	10. 9	17, 840	13. 3	91. 7
7 月末	13, 804	10. 8	17, 934	13. 9	93. 5
8 月末	14, 195	14. 0	18, 421	17. 0	93. 7
9 月末	14, 564	16. 9	18, 867	19. 8	94. 3
（期末）2021年10月18日	15, 091	21. 1	19, 699	25. 1	94. 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

（2020.10.20～2021.10.18）

■インドネシア債券市況

インドネシア債券市場の金利は低下しました。

新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことや米国での追加経済対策への期待などから、市場のリスク選好度が強まったことで金利は低下しました。また、インフレ率が市場予想を下振れしたことや貿易収支などの経済指標が市場予想を上振れしたことなども、金利の低下要因となりました。

■為替相場

インドネシア・ルピアは対円で上昇しました。

新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことなどから、市場のリスク選好度が強まり、インドネシア・ルピアは対円で上昇しました。また、原油価格が上昇したことや貿易収支などの経済指標が市場予想を上振れしたことなども、インドネシア・ルピアの上昇要因となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド」の受益証券を通じて、インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

インドネシアの政府および政府関係機関ならびに国際機関等が発行する債券に投資します。金利水準や物価の動向、経済情勢や市場環境等を勘案し、ポートフォリオを構築します。金利リスク、種別構成を柔軟に調整しつつ、投資妙味の高いインドネシア・ルピア建債券をポートフォリオに組み入れます。

ポートフォリオについて

(2020. 10. 20 ～ 2021. 10. 18)

■当ファンド

「ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド」の受益証券を通じて、インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。

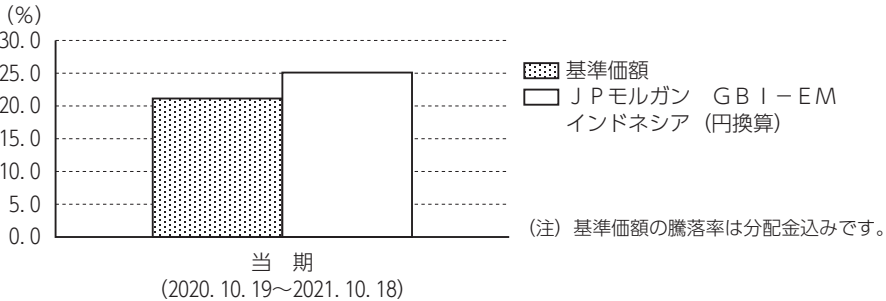
■ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。債券ポートフォリオは、インドネシア国債および国際機関債で運用しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。参考指数はインドネシア債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



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、収益分配を行いませんでした。
 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	
	2020年10月20日 ～2021年10月18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）	5,091

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

当ファンド

「ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド」の受益証券を通じて、インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

インドネシアの政府および政府関係機関ならびに国際機関等が発行する債券に投資します。金利水準や物価の動向、経済情勢や市場環境等を勘案し、ポートフォリオを構築します。金利リスク、種別構成を柔軟に調整しつつ、投資妙味の高いインドネシア・ルピア建債券をポートフォリオに組み入れます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 10. 20～2021. 10. 18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	201円	1. 472%	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13, 628円です。
(投 信 会 社)	(90)	(0. 660)	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)	(105)	(0. 768)	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)	(6)	(0. 044)	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	54	0. 396	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)	(8)	(0. 055)	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)	(45)	(0. 333)	インドネシア国債の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	255	1. 868	

(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。

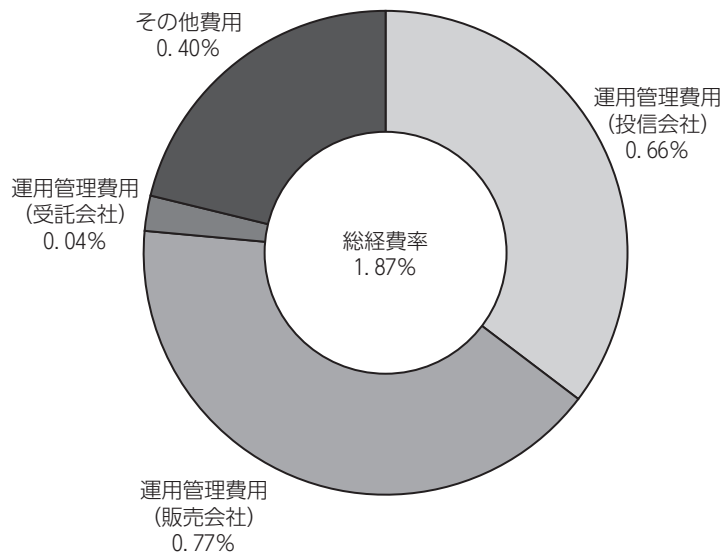
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.87%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年１回決算型）

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年10月20日から2021年10月18日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・インドネシア・ルピア債 マザーファンド	1, 216	2, 110	2, 433	4, 221

(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
	千口	千口	千円
ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド	18, 776	17, 559	33, 717

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年10月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・インドネシア・ルピア債 マザーファンド	33, 717	98. 5
コール・ローン等、その他	506	1. 5
投資信託財産総額	34, 224	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、10月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝114. 27円、100インドネシア・ルピア＝0. 82円です。
(注 3) ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（763, 581千円）の投資信託財産総額（766, 588千円）に対する比率は、99. 6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年10月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	34, 224, 111円
コール・ローン等	485, 525
ダイワ・インドネシア・ルピア債 マザーファンド（評価額）	33, 717, 160
未収入金	21, 426
(B) 負債	249, 221
未払解約金	10, 343
未払信託報酬	237, 622
その他未払費用	1, 256
(C) 純資産総額（A－B）	33, 974, 890
元本	22, 512, 982
次期繰越損益金	11, 461, 908
(D) 受益権総口数	22, 512, 982口
1万口当り基準価額（C／D）	15, 091円

* 期首における元本額は23, 619, 815円、当作成期間中における追加設定元本額は1, 690, 833円、同解約元本額は2, 797, 666円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15, 091円です。

■損益の状況

当期 自 2020年10月20日 至 2021年10月18日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	6, 193, 147円
売買益	6, 538, 428
売買損	△ 345, 281
(B) 信託報酬等	△ 465, 769
(C) 当期損益金（A＋B）	5, 727, 378
(D) 前期繰越損益金	1, 474, 677
(E) 追加信託差損益金	4, 259, 853
（配当等相当額）	(2, 415, 530)
（売買損益相当額）	(1, 844, 323)
(F) 合計（C＋D＋E）	11, 461, 908
次期繰越損益金（F）	11, 461, 908
追加信託差損益金	4, 259, 853
（配当等相当額）	(2, 415, 530)
（売買損益相当額）	(1, 844, 323)
分配準備積立金	7, 202, 055

- (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	5,319,309
(c) 収益調整金	4,259,853
(d) 分配準備積立金	1,882,746
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	11,461,908
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	11,461,908
(h) 受益権総口数	22,512,982□

ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

運用報告書 第11期（決算日 2021年10月18日）

（作成対象期間 2020年10月20日～2021年10月18日）

ダイワ・インドネシア・ルピア債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。

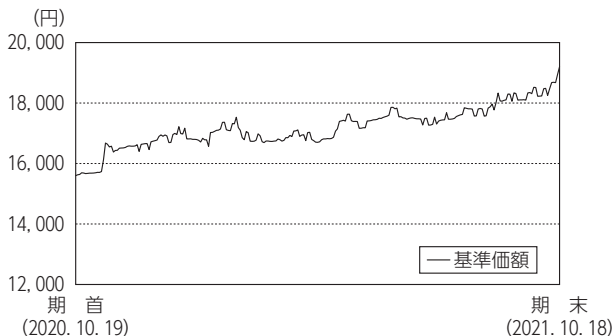
運 用 方 針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	インドネシア・ルピア建債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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



年 月 日	基 準 価 額		JPMorgan GBI-EM インドネシア (円換算)		公 社 債 組入比率
	騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	
	円	%		%	
(期首) 2020年10月19日	15,599	—	17,167	—	95.5
10月末	15,686	0.6	17,294	0.7	95.6
11月末	16,575	6.3	18,274	6.5	97.3
12月末	16,995	8.9	18,658	8.7	95.4
2021年 1月末	17,030	9.2	18,678	8.8	95.1
2月末	17,018	9.1	18,639	8.6	94.9
3月末	17,075	9.5	18,834	9.7	95.2
4月末	17,070	9.4	18,962	10.5	93.3
5月末	17,423	11.7	19,395	13.0	94.1
6月末	17,491	12.1	19,448	13.3	92.4
7月末	17,494	12.1	19,552	13.9	94.2
8月末	18,017	15.5	20,082	17.0	94.5
9月末	18,513	18.7	20,569	19.8	94.9
(期末) 2021年10月18日	19,202	23.1	21,475	25.1	95.5

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) J P Morgan GBI-EM インドネシア (円換算) は、J P Morgan GBI-EM インドネシア (インドネシア・ルピアベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。J P Morgan GBI-EM インドネシア (インドネシア・ルピアベース) 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。上記の指数は最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

【基準価額・騰落率】

期首：15,599円 期末：19,202円 騰落率：23.1%

【基準価額の主な変動要因】

インドネシア・ルピア建ての債券に投資した結果、金利が低下 (債券価格は上昇) したことやインドネシア・ルピアが対円で上昇 (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

○インドネシア債券市場

インドネシア債券市場の金利は低下しました。

新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことや米国での追加経済対策への期待などから、市場のリスク選好度が強まったことで金利は低下しました。また、インフレ率が市場予想を下振れしたことや貿易収支などの経済指標が市場予想を上振れしたことなども、金利の低下要因となりました。

○為替相場

インドネシア・ルピアは対円で上昇しました。

新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことなどから、市場のリスク選好度が強まり、インドネシア・ルピアは対円で上昇しました。また、原油価格が上昇したことや貿易収支などの経済指標が市場予想を上振れしたことなども、インドネシア・ルピアの上昇要因となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

インドネシアの政府および政府関係機関ならびに国際機関等が発行する債券に投資します。金利水準や物価の動向、経済情勢や市場環境等を勘案し、ポートフォリオを構築します。金利リスク、種別構成を柔軟に調整しつつ、投資妙味の高いインドネシア・ルピア建債券をポートフォリオに組み入れます。

◆ポートフォリオについて

インドネシア・ルピア建債券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。債券ポートフォリオは、インドネシア国債および国際機関債で運用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。参考指数はインドネシア債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

インドネシアの政府および政府関係機関ならびに国際機関等が発行する債券に投資します。金利水準や物価の動向、経済情勢や市場環境等を勘案し、ポートフォリオを構築します。金利リスク、種別構成を柔軟に調整しつつ、投資妙味の高いインドネシア・ルピア建債券をポートフォリオに組み入れます。

ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	73 (10)
(その他)	(64)
合 計	73

(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おります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債				(2020年10月20日から2021年10月18日まで)	
外 国	インドネシア	国債証券	買 付 額	売 付 額	
			千インドネシア・ルピア 3, 099, 900	千インドネシア・ルピア 17, 745, 930	(—)
		特殊債券	22, 844, 805	3, 027, 400	(25, 450, 000)

(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				(2020年10月20日から2021年10月18日まで)	
買 付		当 期	売 付		
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額	
	千円			千円	
EUROPEAN INVESTMENT BANK (国際機関) 5.2% 2022/3/1	77,616		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.75% 2044/2/15	72,729	
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 7.5% 2022/5/15	75,038		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.625% 2033/5/15	35,767	
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7% 2022/5/15	23,559		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2034/3/15	25,926	
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 6.25% 2021/12/22	23,250		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK (国際機関) 6.25% 2021/6/15	15,060	
			EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 6.25% 2021/12/22	7,946	

(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				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
インドネシア	千インドネシア・ルピア 81, 189, 100	千インドネシア・ルピア 89, 210, 062	千円 731, 522	% 95. 5	% —	% 69. 0	% —	% 26. 5

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注 4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(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	
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	千インドネシア・ルピア 7,800,000	千インドネシア・ルピア 9,744,306	千円 79,903	2041/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	3,000,000	3,065,760	25,139	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.3750	3,500,000	3,322,935	27,248	2042/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	1,700,000	1,707,973	14,005	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	37,700,000	42,606,655	349,374	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	7,036,200	57,696	2044/02/15
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	5.2000	10,000,000	10,051,000	82,418	2022/03/01
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	6.2500	2,000,000	2,010,300	16,484	2021/12/22
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	7.5000	9,489,100	9,664,933	79,252	2022/05/15
合 計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				81,189,100	89,210,062	731,522	

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

(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年10月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	731,522	95.4
コール・ローン等、その他	35,066	4.6
投資信託財産総額	766,588	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、10月18日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝114.27円、100インドネシア・ルピア＝0.82円です。

(注 3) 当期末における外貨建純資産（763,581千円）の投資信託財産総額（766,588千円）に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年10月18日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	766,588,820円
コール・ローン等	22,876,608
公社債（評価額）	731,522,509
未収利息	9,778,628
前払費用	2,411,075
(B)負債	834,077
未払解約金	834,077
(C)純資産総額（A－B）	765,754,743
元本	398,786,275
次期繰越損益金	366,968,468
(D)受益権総口数	398,786,275口
1万口当り基準価額（C／D）	19,202円

* 期首における元本額は515,930,872円、当作成期間中における追加設定元本額は10,035,632円、同解約元本額は127,180,229円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（毎月分配型）381,227,083円、ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年1回決算型）17,559,192円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,202円です。

■損益の状況

期 自 2020年10月20日 至 2021年10月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	49,247,950円
受取利息	49,249,486
支払利息	△ 1,536
(B) 有価証券売買損益	115,808,255
売買益	120,517,417
売買損	△ 4,709,162
(C) その他費用	△ 3,328,148
(D) 当期損益金 (A + B + C)	161,728,057
(E) 前期繰越損益金	288,886,207
(F) 解約差損益金	△ 90,931,343
(G) 追加信託差損益金	7,285,547
(H) 合計 (D + E + F + G)	366,968,468
次期繰越損益金 (H)	366,968,468

- (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。