

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10期

(決算日 2023年10月17日)

(作成対象期間 2022年10月18日～2023年10月17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	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			JPMorgan GBI-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
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
9期末(2022年10月17日)	17,850	0	18.3	23,366	18.6	92.3	63
10期末(2023年10月17日)	19,029	0	6.6	25,125	7.5	94.8	71

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) JPMorgan GBI-EM インドネシア（円換算）は、JPMorgan 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。JPMorgan 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。

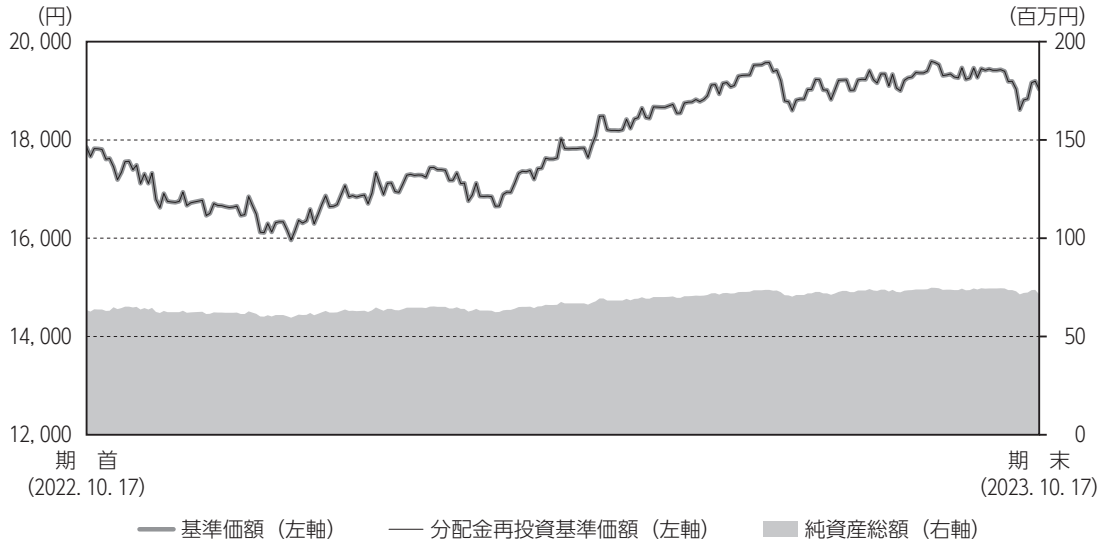
(注5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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。

■ 基準価額・騰落率

期首：17,850円

期末：19,029円（分配金0円）

騰落率：6.6%（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、インドネシア・ルピアが対円で下落（円高）したことはマイナス要因となりましたが、債券の利息収入や金利が低下（債券価格は上昇）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		J P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	
(期首)2022年10月17日	円	%			%
	17,850	—	23,366	—	92.3
10月末	17,559	△ 1.6	22,962	△ 1.7	93.1
11月末	16,771	△ 6.0	22,062	△ 5.6	94.8
12月末	16,164	△ 9.4	21,349	△ 8.6	92.8
2023年1月末	16,864	△ 5.5	22,208	△ 5.0	93.4
2月末	17,441	△ 2.3	22,943	△ 1.8	92.9
3月末	17,320	△ 3.0	22,911	△ 1.9	94.8
4月末	18,087	1.3	23,968	2.6	94.4
5月末	18,724	4.9	24,923	6.7	94.5
6月末	19,524	9.4	25,997	11.3	93.9
7月末	19,005	6.5	25,248	8.1	93.9
8月末	19,361	8.5	25,801	10.4	93.4
9月末	19,418	8.8	25,685	9.9	94.2
(期末)2023年10月17日	19,029	6.6	25,125	7.5	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

（2022. 10. 18～2023. 10. 17）

■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。

当作成期首より、インドネシアのインフレ率がピークアウトし、2023年2月には利上げが打ち止めとなったことなどから、インドネシア金利は低下しました。また、高金利国を中心に新興国債券への選好が強まったことも、金利の低下要因となりました。2023年8月以降当作成期末にかけては、米国金利が上昇したことなどをを受けて、インドネシア金利も上昇しました。

■為替相場

インドネシア・ルピアは対円で下落しました。

当作成期首より、米国の長期インフレ率が低下したことや2022年12月に日銀が長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の長期金利の上限引き上げを実施したことなどが要因となり、インドネシア・ルピアは対円で下落しました。その後は、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、ルピアは対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「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

（2022. 10. 18～2023. 10. 17）

■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。

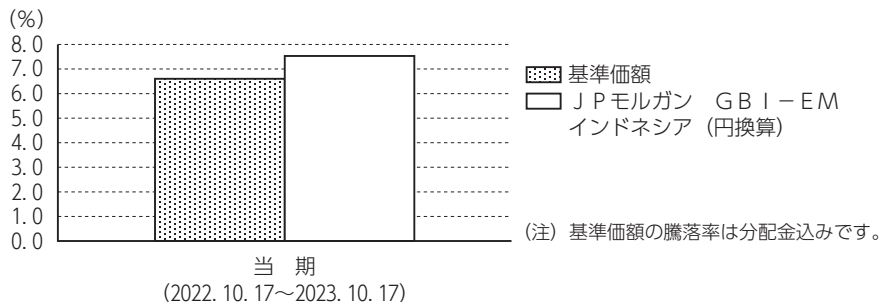
■ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

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	
	2022年10月18日 ～2023年10月17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）	9,028

- （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

「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 (2022. 10. 18~2023. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	265円	1. 473%	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17, 961円です。
（投 信 会 社）	(119)	(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）	(138)	(0. 769)	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）	(8)	(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	19	0. 107	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(10)	(0. 056)	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）	(8)	(0. 043)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	284	1. 579	

(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。

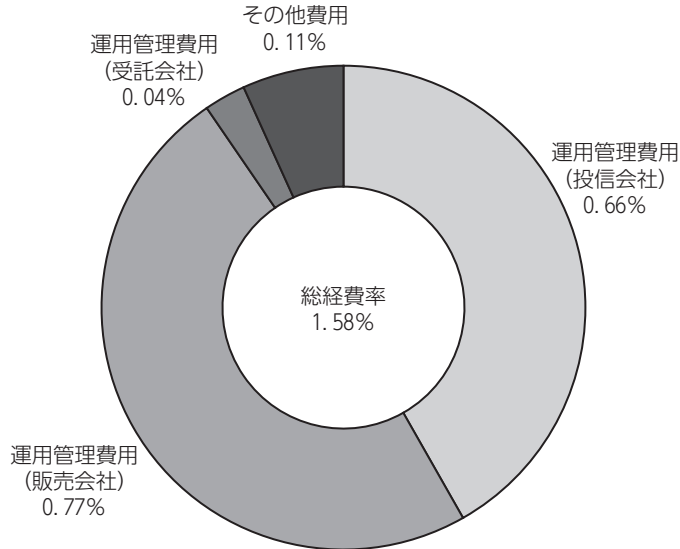
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.58%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

（2022年10月18日から2023年10月17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	2,083	4,851	942	2,339

（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	27,340	28,481	70,881

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年10月17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	70,881	96.2
コール・ローン等、その他	2,771	3.8
投資信託財産総額	73,653	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝149.59円、100インドネシア・ルピア＝0.95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（727,796千円）の投資信託財産総額（733,274千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	73,653,046円
コール・ローン等	1,091,642
ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド（評価額）	70,881,560
未収入金	1,679,844
(B) 負債	2,253,264
未払解約金	1,720,023
未払信託報酬	530,370
その他未払費用	2,871
(C) 純資産総額（A－B）	71,399,782
元本	37,521,853
次期繰越損益金	33,877,929
(D) 受益権総口数	37,521,853口
1万口当り基準価額（C/D）	19,029円

* 期首における元本額は35,500,453円、当作成期間中における追加設定元本額は3,217,699円、同解約元本額は1,196,299円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,029円です。

■損益の状況

当期 自 2022年10月18日 至 2023年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 158円
受取利息	4
支払利息	△ 162
(B) 有価証券売買損益	5,341,055
売買益	5,494,953
売買損	△ 153,898
(C) 信託報酬等	△ 999,791
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	4,341,106
(E) 前期繰越損益金	15,778,821
(F) 追加信託差損益金	13,758,002
（配当等相当額）	（ 10,347,244）
（売買損益相当額）	（ 3,410,758）
(G) 合計（D＋E＋F）	33,877,929
次期繰越損益金（G）	33,877,929
追加信託差損益金	13,758,002
（配当等相当額）	（ 10,347,244）
（売買損益相当額）	（ 3,410,758）
分配準備積立金	20,120,085
繰越損益金	△ 158

（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	4,341,240
(c) 収益調整金	13,758,002
(d) 分配準備積立金	15,778,845
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	33,878,087
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	33,878,087
(h) 受益権総口数	37,521,853口

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13期 (決算日 2023年10月17日)

(作成対象期間 2022年10月18日～2023年10月17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

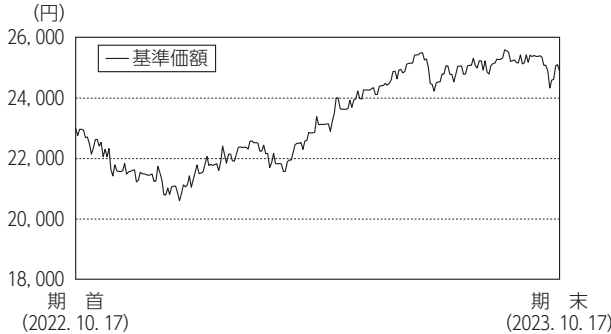
Daiwa Asset Management

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

《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：23,000円 期末：24,887円 騰落率：8.2%

【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、インドネシア・ルピアが対円で下落（円高）したことはマイナス要因となりましたが、債券の利息収入や金利が低下（債券価格は上昇）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。

当作成期首より、インドネシアのインフレ率がピークアウトし、2023年2月には利上げが打ち止めとなったことなどから、インドネシア金利は低下しました。また、高金利国を中心に新興国債券への選好が強まったことも、金利の低下要因となりました。2023年8月に降当作成期末にかけては、米国金利が上昇したことを受けて、インドネシア金利も上昇しました。

○ 為替相場

インドネシア・ルピアは対円で下落しました。

当作成期首より、米国の長期インフレ率が低下したことや2022年12月に日銀が長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の長期金利の上限引き上げを実施したことなどが要因となり、インドネシア・ルピアは対円で下落しました。その後は、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、ルピアは対円で上昇しました。

◆ 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。

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	騰落率	騰落率	騰落率	
	円	%	(参考指数)	%	%
(期首) 2022年10月17日	23,000	—	25,472	—	93.0
10月末	22,629	△ 1.6	25,032	△ 1.7	93.8
11月末	21,632	△ 5.9	24,052	△ 5.6	95.5
12月末	20,868	△ 9.3	23,274	△ 8.6	93.5
2023年1月末	21,806	△ 5.2	24,210	△ 5.0	94.1
2月末	22,584	△ 1.8	25,012	△ 1.8	93.5
3月末	22,454	△ 2.4	24,977	△ 1.9	95.6
4月末	23,482	2.1	26,129	2.6	95.1
5月末	24,349	5.9	27,170	6.7	95.2
6月末	25,429	10.6	28,341	11.3	94.6
7月末	24,777	7.7	27,525	8.1	94.7
8月末	25,277	9.9	28,127	10.4	94.1
9月末	25,381	10.4	28,001	9.9	94.9
(期末) 2023年10月17日	24,887	8.2	27,390	7.5	95.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) JPMorgan GBI-EM インドネシア (円換算) は、JPMorgan 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。JPMorgan 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。

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)	24 (13)
(その他)	(11)
合 計	24

(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

(2022年10月18日から2023年10月17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	千インドネシア・ルピア
			2,241,230	5,933,196
		特殊債券	32,539,690	28,529,057
			(—)	(—)

(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

(2022年10月18日から2023年10月17日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	銘 柄	銘 柄	金 額
	千円		千円
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK (国際機関) 7.875% 2023/3/14	106,781	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK (国際機関) 7.875% 2023/3/14	136,022
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 5.2% 2024/5/28	89,341	EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 6.45% 2022/12/13	86,377
INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT (国際機関) 7.25% 2024/3/15	71,953	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2034/3/15	32,672
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 6.17% 2025/3/10	25,415	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK (国際機関) 5.5% 2023/2/7	17,400
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.75% 2044/2/15	11,446	INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT (国際機関) 7.25% 2024/3/15	16,053
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2026/9/15	9,444	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.75% 2044/2/15	10,632
		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2026/9/15	10,161

(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)

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額					
インドネシア	千インドネシア・ルピア 67,100,000	千インドネシア・ルピア 73,478,476	千円 698,045	% 95.5	% —	% 67.1	% 3.8	% 24.6

(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	当 期		末		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額			
					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 10,019,100	千円 95,181	2041/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	34,300,000	38,132,682	362,260	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	3,000,000	3,466,380	32,930	2044/02/15	
	INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT	特殊債券	7.2500	6,200,000	6,213,764	59,030	2024/03/15	
	EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	4.6000	3,000,000	2,918,700	27,727	2025/12/09	
	EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	5.2000	10,100,000	10,028,795	95,273	2024/05/28	
	EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	6.1700	2,700,000	2,699,055	25,641	2025/03/10	
	合 計	銘柄数 7銘柄 金 額			67,100,000	73,478,476	698,045	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 698,045	% 95.2
コール・ローン等、その他	35,229	4.8
投資信託財産総額	733,274	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17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.59円、100インドネシア・ルピア=0.95円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(727.796千円)の投資信託財産総額(733,274千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	733,274,970円
コール・ローン等	23,444,065
公社債 (評価額)	698,045,522
未収利息	11,069,915
前払費用	715,468
(B) 負債	2,170,666
未払解約金	2,170,666
(C) 純資産総額 (A - B)	731,104,304
元本	293,772,834
次期繰越損益金	437,331,470
(D) 受益権総口数	293,772,834口
1万口当り基準価額 (C / D)	24,887円

* 期首における元本額は319,619,247円、当作成期間中における追加設定元本額は24,027,282円、同解約元本額は49,873,695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：
 ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン (毎月分配型) 265,291,474円
 ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン (年1回決算型) 28,481,360円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は24,887円です。

ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

■損益の状況

当期 自 2022年10月18日 至 2023年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	45,601,581円
受取利息	45,604,160
支払利息	△ 2,579
(B) 有価証券売買損益	7,698,722
売買益	35,727,508
売買損	△ 28,028,786
(C) その他費用	△ 728,921
(D) 当期損益金 (A + B + C)	52,571,382
(E) 前期繰越損益金	415,513,052
(F) 解約差損益金	△ 65,215,749
(G) 追加信託差損益金	34,462,785
(H) 合計 (D + E + F + G)	437,331,470
次期繰越損益金 (H)	437,331,470

(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。