

★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
マザーファンドの運用方法	①主として、インドネシア・ルピア建債券に投資することにより、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。 ②投資にあたっては、以下の方針を基本として運用を行ないます。 イ、投資対象は、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とします。 ロ、金利や物価の動向、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。 ハ、流動性を確保するため、インドネシア・ルピア以外の通貨建ての債券に投資を行なう場合があります。 ニ、運用の効率化をはかるため、為替予約取引および直物為替先渡取引を行なう場合があります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。	
	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
組 入 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。	
分 配 方 針		

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン (年1回決算型)

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2017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。

さて、「ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年1回決算型）」は、このたび、第4期の決算を行ないました。

ここに、期中の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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

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

設定以来の運用実績

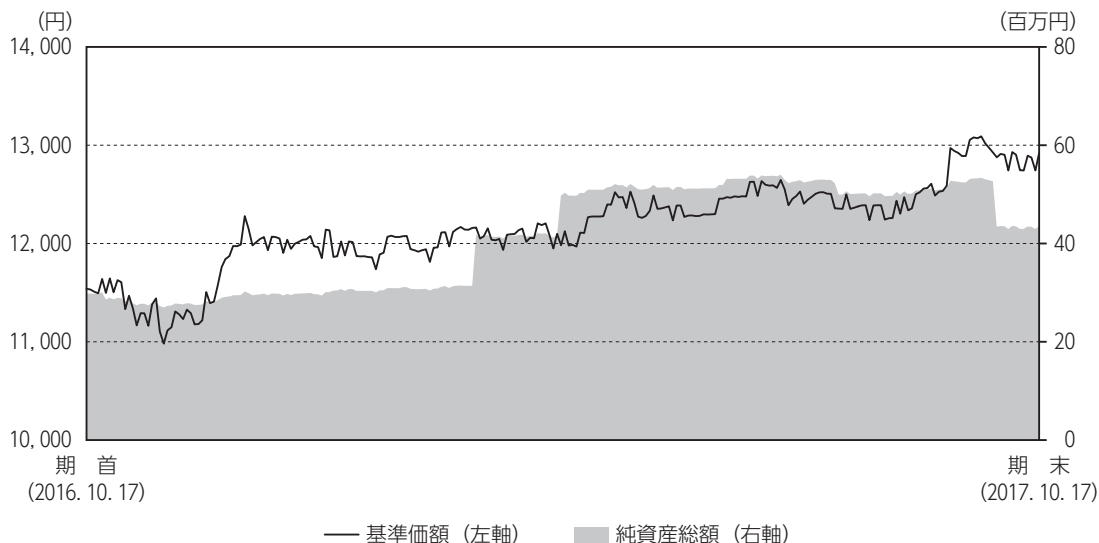
決 算 期	基 準 価 額			ＪＰモルガン　ＧＢＩ－ＥＭ インドネシア（円換算）		公 社 債 組入比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(参考指数)	期 中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
１ 期末 (2014年10月17日)	10,455	0	4.6	10,830	8.3	87.1	21
２ 期末 (2015年10月19日)	10,949	0	4.7	11,829	9.2	94.2	26
３ 期末 (2016年10月17日)	11,540	0	5.4	12,725	7.6	96.1	29
４ 期末 (2017年10月17日)	12,921	0	12.0	14,657	15.2	96.2	43

- (注１) ＪＰモルガン　ＧＢＩ－ＥＭ　インドネシア（円換算）は、ＪＰモルガン　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として大和投資信託が計算したものです。ＪＰモルガン　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２) 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３) 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４) 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：11,540円

期末：12,921円

騰落率：12.0%

■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・ルピアが対円で上昇したことや債券価格が上昇したこと、また債券の利息収入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	
（期首）2016年10月17日	円	%		%	%
	11,540	—	12,725	—	96.1
10月末	11,332	△ 1.8	12,589	△ 1.1	96.7
11月末	11,219	△ 2.8	12,446	△ 2.2	96.4
12月末	11,904	3.2	13,321	4.7	97.5
2017年 1 月末	11,871	2.9	13,258	4.2	97.1
2 月末	11,956	3.6	13,391	5.2	96.4
3 月末	12,135	5.2	13,687	7.6	96.2
4 月末	12,274	6.4	13,808	8.5	96.5
5 月末	12,235	6.0	13,794	8.4	96.0
6 月末	12,484	8.2	14,136	11.1	96.6
7 月末	12,358	7.1	13,947	9.6	96.9
8 月末	12,521	8.5	14,249	12.0	95.6
9 月末	12,877	11.6	14,614	14.8	96.9
（期末）2017年10月17日	12,921	12.0	14,657	15.2	96.2

（注）騰落率は期首比。

投資環境について

（2016. 10. 18 ～ 2017. 10. 17）

■インドネシア債券市況

インドネシア債券市況は、金利低下（債券価格は上昇）となりました。

2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、同氏の政策が米国景気の拡大やインフレの加速をもたらすとの観測から世界的に金利が上昇した影響で、インドネシアでも一時金利が上昇しました。しかし2017年に入ってから、同氏の政権運営が難航したことから米国で金利が低下傾向に転じたことに加え、世界経済が安定する中でインドネシアへの資金フローが続いたことやインフレ率が低下傾向となったことなどから、金利は低下しました。

■為替相場

インドネシア・ルピアは対米ドルでは下落、対円では上昇しました。

米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、同氏の経済政策への期待感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た一方で、対米ドルでは下落しました。2017年に入ってから、同氏の政権運営の難航を受けて米ドルが売られた一方で、インドネシアに資金流入が見られたものの中央銀行による為替安定化のための米ドル買い介入が続いたことから、対円、対米ドルともにおおむね横ばいでの推移が続きました。しかし9月は、FOMC（米国連邦公開市場委員会）の発表を受けて米国の利上げ期待が高まった局面で、対米ドルで下落しました。

前期における「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

（2016. 10. 18 ～ 2017. 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。

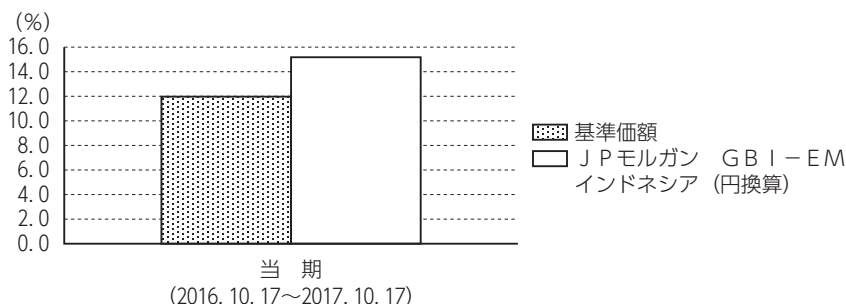
■ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

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からなるポートフォリオで運用しました。

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

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、分配を行ないませんでした。

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	
		2016年10月18日 ～2017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)	2,921	

（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 (2016. 10. 18～2017. 10. 17)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	178円	1.465%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,168円です。
(投 信 会 社)	(80)	(0.657)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(93)	(0.765)	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 銀 行)	(5)	(0.043)	受託銀行分は、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＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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＝期中の有価証券取引税／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	23	0.188	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(10)	(0.084)	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)	(12)	(0.096)	インドネシアキャピタルゲイン課税等
合 計	201	1.653	

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2016年10月18日から2017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	15,471	22,271	9,208	13,906

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

当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	□ 数	評 価 額
	千口	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	21,739	28,002	43,355	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	43,355	98.7
コール・ローン等、その他	568	1.3
投資信託財産総額	43,924	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、100インドネシア・ルピア＝0.84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（2,841,787千円）の投資信託財産総額（2,868,900千円）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

2017年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	43,924,530円
コール・ローン等	568,998
ダイワ・インドネシア・ルピア債 マザーファンド（評価額）	43,355,532
(B) 負債	370,527
未払信託報酬	368,550
その他未払費用	1,977
(C) 純資産総額（A－B）	43,554,003
元本	33,707,376
次期繰越損益金	9,846,627
(D) 受益権総口数	33,707,376口
1万口当り基準価額（C／D）	12,921円

*期首における元本額は25,847,037円、当期中における追加設定元本額は19,128,782円、同解約元本額は11,268,443円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,921円です。

■損益の状況

当期 自2016年10月18日 至2017年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4円
支払利息	△ 4
(B) 有価証券売買損益	4,340,005
売買益	5,309,708
売買損	△ 969,703
(C) 信託報酬等	△ 600,772
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	3,739,229
(E) 前期繰越損益金	1,125,261
(F) 追加信託差損益金	4,982,137
（配当等相当額）	(1,571,091)
（売買損益相当額）	(3,411,046)
(G) 合計（D＋E＋F）	9,846,627
次期繰越損益金（G）	9,846,627
追加信託差損益金	4,982,137
（配当等相当額）	(1,571,091)
（売買損益相当額）	(3,411,046)
分配準備積立金	4,864,494
繰越損益金	△ 4

(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9ページの「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年１回決算型）

■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	3,739,233
(c) 収益調整金	4,982,137
(d) 分配準備積立金	1,125,261
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	9,846,631
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	9,846,631
(h) 受益権総口数	33,707,376口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

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7期（決算日 2017年10月17日）

（計算期間 2016年10月18日～2017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第7期にかかる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
運用方法	①主として、インドネシア・ルピア建債券に投資することにより、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。 ②投資にあたっては、以下の方針を基本として運用を行ないます。 イ. 投資対象は、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とします。 ロ. 金利や物価の動向、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。 ハ. 流動性を確保するため、インドネシア・ルピア以外の通貨建ての債券に投資を行なう場合があります。 ニ. 運用の効率化をはかるため、為替予約取引および直物為替先渡取引を行なう場合があります。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

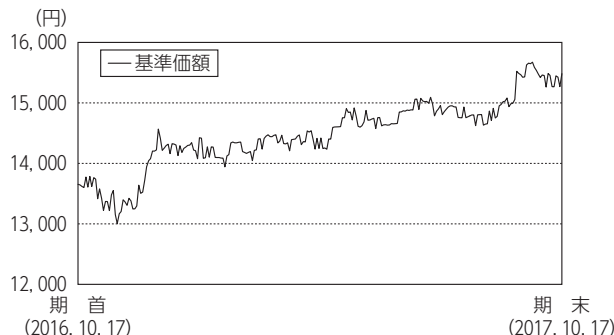
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当期中の基準価額と市況の推移



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
	円	騰落率 %	(参考指数)	騰落率 %	
(期首) 2016年10月17日	13,654	—	13,873	—	96.6
10月末	13,415	△ 1.8	13,724	△ 1.1	97.1
11月末	13,296	△ 2.6	13,569	△ 2.2	96.9
12月末	14,129	3.5	14,522	4.7	98.0
2017年 1月末	14,098	3.3	14,453	4.2	97.6
2月末	14,215	4.1	14,599	5.2	96.8
3月末	14,449	5.8	14,921	7.6	96.6
4月末	14,603	7.0	15,053	8.5	96.9
5月末	14,575	6.7	15,038	8.4	96.5
6月末	14,891	9.1	15,410	11.1	97.1
7月末	14,759	8.1	15,204	9.6	97.4
8月末	14,973	9.7	15,534	12.0	96.0
9月末	15,419	12.9	15,932	14.8	97.6
(期末) 2017年10月17日	15,483	13.4	15,978	15.2	96.6

(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として大和投資信託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) 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：13,654円 期末：15,483円 騰落率：13.4%

【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・ルピアが対円で上昇したことや債券価格が上昇したこと、また債券の利息収入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況

インドネシア債券市況は、金利低下 (債券価格は上昇) となりました。

2016年11月に米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、同氏の政策が米国景気の拡大やインフレの加速をもたらすとの観測から世界的に金利が上昇した影響で、インドネシアでも一時金利が上昇しました。しかし2017年に入ってから、同氏の政権運営が難航したことから米国で金利が低下傾向に転じたことに加え、世界経済が安定する中でインドネシアへの資金フローが続いたことやインフレ率が低下傾向となったことなどから、金利は低下しました。

○為替相場

インドネシア・ルピアは対米ドルでは下落、対円では上昇しました。

米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利すると、同氏の経済政策への期待感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た一方で、対米ドルでは下落しました。2017年に入ってから、同氏の政権運営の難航を受けて米ドルが売られた一方で、インドネシアに資金流入が見られたものの中央銀行による為替安定化のための米ドル買い介入が続いたことから、対円、対米ドルともにおおむね横ばいでの推移が続きました。しかし9月は、FOMC (米国連邦公開市場委員会) の発表を受けて米国の利上げ期待が高まった局面で、対米ドルで下落しました。

◆前期における「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からなるポートフォリオで運用しました。

◆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。

当期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当期中の基準価額と市況の推移」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。

■ 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	24
（保管費用）	(12)
（その他）	(13)
合 計	24

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各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

(2016年10月18日から2017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 17, 324, 950	千インドネシア・ルピア 53, 412, 360 (—)
外 国	インドネシア	特殊債券	45, 362, 638	58, 443, 940 (—)

(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

(2016年10月18日から2017年10月17日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）6.25% 2021/6/15	251, 739	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）7.25% 2017/7/17	252, 046
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT（国際機関）7.375% 2019/4/15	86, 093	Indonesia Treasury Bond（インドネシア）6.375% 2042/4/15	151, 756
Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8.375% 2034/3/15	66, 924	Indonesia Treasury Bond（インドネシア）6.625% 2033/5/15	135, 912
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）9.5% 2019/4/15	43, 699	Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8.75% 2031/5/15	118, 456
Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8.75% 2031/5/15	41, 701	AFRICAN DEVELOPMENT BK.（国際機関）7% 2017/3/6	85, 020
Indonesia Treasury Bond（インドネシア）6.375% 2042/4/15	33, 900	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）6.25% 2021/6/15	58, 536
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT（国際機関）4.23% 2016/12/12	57, 751
		Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8.375% 2034/3/15	43, 406
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）5.81% 2018/9/11	20, 467
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK（国際機関）4.16% 2018/5/24	16, 168

(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 323,850,000	千インドネシア・ルピア 329,942,614	千円 2,771,517	% 96.6	% —	% 59.8	% 19.6	% 17.2

(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。

ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

		当		期		末		
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
				%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,500,000	7,419,685	62,325	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.3750	63,000,000	55,724,130	468,082	2042/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	43,000,000	40,650,480	341,464	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	67,000,000	73,726,800	619,305	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	23,000,000	26,577,420	223,250	2044/02/15
		EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	7.2000	10,000,000	10,223,900	85,880	2019/07/09
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	9.2500	40,000,000	43,963,200	369,290	2020/12/02
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	7.3750	10,000,000	10,218,700	85,837	2019/04/15
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	4.1600	15,850,000	15,593,864	130,988	2018/05/24
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	5.8100	17,500,000	17,477,425	146,810	2018/09/11
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	9.5000	5,000,000	5,232,000	43,948	2019/04/15
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	6.2500	23,000,000	23,135,010	194,334	2021/06/15
合 計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				323,850,000	329,942,614	2,771,517	

(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

2017年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,771,517	96.6
コール・ローン等、その他	97,382	3.4
投資信託財産総額	2,868,900	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、100インドネシア・ルピア＝0.84円です。
(注 3) 当期末における外貨建純資産（2,841,787千円）の投資信託財産総額（2,868,900千円）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

2017年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,868,900,408円
コール・ローン等	40,607,605
公社債（評価額）	2,771,517,958
未収利息	55,391,174
前払費用	1,383,671
(B) 負債	—
(C) 純資産総額（A－B）	2,868,900,408
元本	1,852,939,160
次期繰越損益金	1,015,961,248
(D) 受益権総口数	1,852,939,160口
1万口当り基準価額（C／D）	15,483円

* 期首における元本額は2,273,176,923円、当期中における追加設定元本額は291,961,477円、同解約元本額は712,199,240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）1,824,937,137円、ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年1回決算型）28,002,023円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,483円です。

■損益の状況

当期 自2016年10月18日 至2017年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	189,999,828円
受取利息	190,017,800
支払利息	△ 17,972
(B) 有価証券売買損益	194,058,031
売買益	217,229,486
売買損	△ 23,171,455
(C) その他費用	△ 5,059,368
(D) 当期損益金 (A + B + C)	378,998,491
(E) 前期繰越損益金	830,699,271
(F) 解約差損益金	△ 322,000,517
(G) 追加信託差損益金	128,264,003
(H) 合計 (D + E + F + G)	1,015,961,248
次期繰越損益金 (H)	1,015,961,248

(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。