

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7期

(決算日 2020年10月19日)

(作成対象期間 2019年10月18日～2020年10月19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

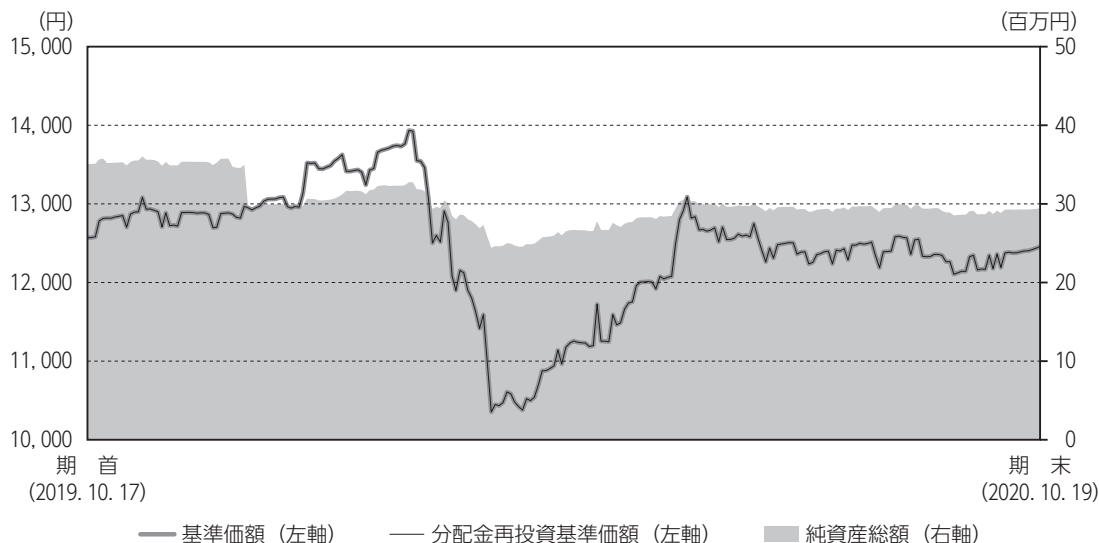
決 算 期	基 準 価 額			J Pモルガン G B IーE M インドネシア（円換算）		公 社 債 組入比率	純資産 総 額
	（分配落）	税込み 分配金	期 中 騰落率	（参考指数）	期 中 騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
3 期末 (2016年10月17日)	11, 540	0	5. 4	12, 725	7. 6	96. 1	29
4 期末 (2017年10月17日)	12, 921	0	12. 0	14, 657	15. 2	96. 2	43
5 期末 (2018年10月17日)	10, 600	0	△ 18. 0	12, 281	△ 16. 2	95. 8	26
6 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

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) J Pモルガン G B IーE M インドネシア（円換算）は、J Pモルガン G B IーE M 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 G B IーE M 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：12,570円

期 末：12,457円（分配金 0 円）

騰落率：△0.9%（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）したことはプラス要因となりましたが、インドネシア・ルピアが対円で下落（円高）したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。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 G B Iー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) 2019年10月17日	円	%		%	%
	12, 570	—	15, 178	—	96. 1
10月末	12, 852	2. 2	15, 570	2. 6	96. 3
11月末	12, 888	2. 5	15, 579	2. 6	95. 0
12月末	13, 086	4. 1	15, 837	4. 3	97. 5
2020年 1 月末	13, 435	6. 9	16, 512	8. 8	95. 6
2 月末	13, 072	4. 0	16, 092	6. 0	95. 2
3 月末	10, 584	△ 15. 8	13, 028	△ 14. 2	90. 3
4 月末	11, 197	△ 10. 9	13, 785	△ 9. 2	91. 0
5 月末	12, 046	△ 4. 2	15, 068	△ 0. 7	91. 7
6 月末	12, 582	0. 1	15, 747	3. 7	95. 9
7 月末	12, 238	△ 2. 6	15, 403	1. 5	96. 9
8 月末	12, 359	△ 1. 7	15, 506	2. 2	96. 1
9 月末	12, 346	△ 1. 8	15, 536	2. 4	95. 2
(期末) 2020年10月19日	12, 457	△ 0. 9	15, 747	3. 7	95. 1

(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

(2019. 10. 18 ~ 2020. 10. 19)

■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。

インドネシア債券市場は、当作成期首から2020年2月後半にかけて、インドネシア中央銀行が利下げを実施したことなどから、金利は低下しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から市場のリスク回避姿勢が急速に強まり、インドネシア債券市場では債券が売られ、金利は上昇しました。3月後半から当作成期末にかけては、感染拡大への懸念が和らいだことやインドネシア中央銀行による利下げを背景に、金利は低下しました。

■為替相場

インドネシア・ルピアは対円で下落しました。

当作成期首から2020年1月半ばにかけては、米中貿易摩擦への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、ルピアは対円で上昇しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、市場のリスク回避姿勢が強まったことで、ルピアは対円で下落しました。3月後半から当作成期末にかけては、感染拡大への懸念が和らいだことなどから、ルピアの下落幅を縮小させました。

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

(2019. 10. 18 ~ 2020. 10. 19)

■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。

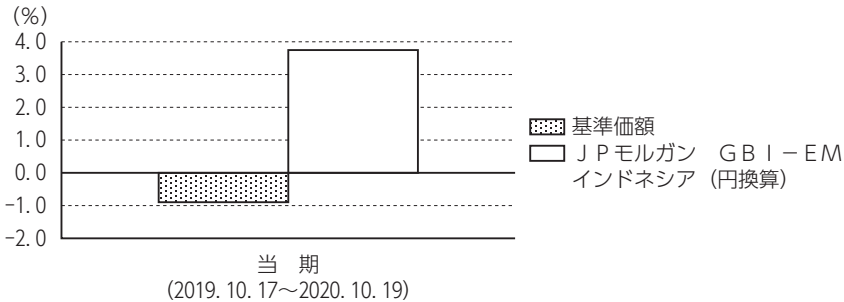
■ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド

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	
	2019年10月18日 ～2020年10月19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）	2,508

- （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 (2019. 10. 18～2020. 10. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	184円	1.482%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,427円です。
(投 信 会 社)	(83)	(0.665)	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)	(96)	(0.774)	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)	(5)	(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	93	0.746	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)	(0.090)	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)	(81)	(0.648)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	277	2.228	

(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。

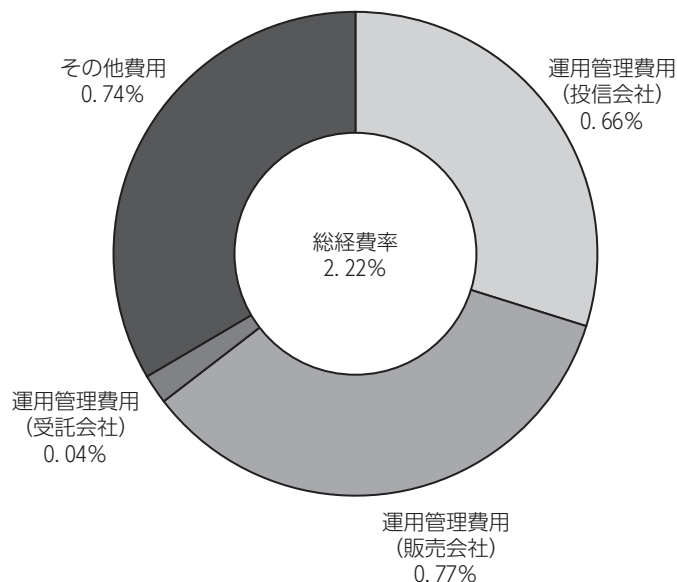
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.22%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

(2019年10月18日から2020年10月19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, 773	2, 833	5, 508	8, 787

(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	□ 数	□ 数	□ 数	□ 数
	千口	千口	千口	千口	千口	千口
ダイワ・インドネシア・ルピア債マザーファンド	22, 512	18, 776	29, 289			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年10月19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	29, 289	98. 8
コール・ローン等、その他	349	1. 2
投資信託財産総額	29, 639	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19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝105.40円、100インドネシア・ルピア＝0.72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（798,775千円）の投資信託財産総額（813,749千円）に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29, 639, 109円
コール・ローン等	349, 555
ダイワ・インドネシア・ルピア債 マザーファンド（評価額）	29, 289, 554
(B) 負債	216, 488
未払信託報酬	215, 385
その他未払費用	1, 103
(C) 純資産総額（A－B）	29, 422, 621
元本	23, 619, 815
次期繰越損益金	5, 802, 806
(D) 受益権総口数	23, 619, 815口
1万口当り基準価額（C／D）	12, 457円

* 期首における元本額は27,909,410円、当作成期間中における追加設定元本額は2,415,374円、同解約元本額は6,704,969円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,457円です。

■損益の状況

当期 自 2019年10月18日 至 2020年10月19日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	108, 956円
売買益	374, 435
売買損	△ 265, 479
(B) 信託報酬等	△ 448, 306
(C) 当期損益金（A＋B）	△ 339, 350
(D) 前期繰越損益金	2, 003, 755
(E) 追加信託差損益金	4, 138, 401
(配当等相当額)	(2, 384, 641)
(売買損益相当額)	(1, 753, 760)
(F) 合計（C＋D＋E）	5, 802, 806
次期繰越損益金（F）	5, 802, 806
追加信託差損益金	4, 138, 401
(配当等相当額)	(2, 384, 641)
(売買損益相当額)	(1, 753, 760)
分配準備積立金	2, 124, 968
繰越損益金	△ 460, 563

(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	0
(c) 収益調整金	3,799,051
(d) 分配準備積立金	2,124,968
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	5,924,019
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	5,924,019
(h) 受益権総口数	23,619,815口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

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10期（決算日 2020年10月19日）

（作成対象期間 2019年10月18日～2020年10月19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。

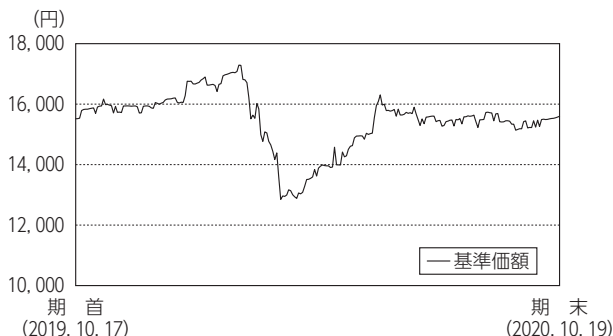
運 用 方 針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	インドネシア・ルピア建債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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
	円	騰落率 %	(参考指数)	騰落率 %	
(期首) 2019年10月17日	15,516	—	16,547	—	96.5
10月末	15,875	2.3	16,974	2.6	96.7
11月末	15,939	2.7	16,984	2.6	95.4
12月末	16,204	4.4	17,265	4.3	97.7
2020年 1月末	16,653	7.3	18,001	8.8	96.1
2月末	16,220	4.5	17,542	6.0	95.7
3月末	13,136	△ 15.3	14,202	△ 14.2	90.8
4月末	13,917	△ 10.3	15,028	△ 9.2	91.4
5月末	14,997	△ 3.3	16,426	△ 0.7	92.1
6月末	15,688	1.1	17,167	3.7	96.3
7月末	15,275	△ 1.6	16,792	1.5	97.3
8月末	15,447	△ 0.4	16,904	2.2	96.4
9月末	15,448	△ 0.4	16,937	2.4	95.6
(期末) 2020年10月19日	15,599	0.5	17,167	3.7	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：15,516円 期末：15,599円 騰落率：0.5%

【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、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。

インドネシア債券市場は、当作成期首から2020年2月後半にかけて、インドネシア中央銀行が利下げを実施したことなどから、金利は低下しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から市場のリスク回避姿勢が急速に強まり、インドネシア債券市場では債券が売られ、金利は上昇しました。3月後半から当作成期末にかけては、感染拡大への懸念が和らいだことやインドネシア中央銀行による利下げを背景に、金利は低下しました。

○為替相場

インドネシア・ルピアは対円で下落しました。

当作成期首から2020年1月半ばにかけては、米中貿易摩擦への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、ルピアは対円で上昇しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、市場のリスク回避姿勢が強まったことで、ルピアは対円で下落しました。3月後半から当作成期末にかけては、感染拡大への懸念が和らいだことなどから、ルピアの下落幅を縮小させました。

◆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)	107 (14)
(その他)	(92)
合 計	107

(注 1) 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) 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				(2019年10月18日から2020年10月19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 4, 268, 000	千インドネシア・ルピア 44, 936, 925	(—)
		特殊債券	27, 142, 900	56, 718, 070	(—)

(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

(2019年10月18日から2020年10月19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	184, 154	EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 9. 25% 2020/12/2	337, 727
EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT (国際機関) 9. 25% 2020/12/2	32, 576	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6. 375% 2042/4/15	237, 939
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8. 75% 2044/2/15	32, 436	EUROPEAN INVESTMENT BANK (国際機関) 6. 95% 2020/2/6	86, 237
		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8. 375% 2034/3/15	53, 125
		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8. 75% 2044/2/15	28, 140
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK (国際機関) 7. 875% 2023/3/14	25, 320
		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 9. 5% 2041/5/15	18, 292
		Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6. 625% 2033/5/15	10, 267

(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 100, 450, 000	千インドネシア・ルピア 106, 769, 792	千円 768, 742	% 95. 5	% —	% 70. 7	% —	% 24. 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	期 末 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 9,231,534	千円 66,467	2041/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.3750	3,500,000	3,080,000	22,176	2042/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	6,500,000	6,279,065	45,209	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	40,700,000	44,333,696	319,202	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	14,500,000	16,156,045	116,323	2044/02/15
		EUROPEAN BK RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT	特殊債券	9.2500	700,000	705,390	5,078	2020/12/02
		INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	特殊債券	6.2500	26,750,000	26,984,062	194,285	2021/06/15
合 計	銘柄数	7銘柄						
	金 額				100,450,000	106,769,792	768,742	

(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

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	768,742	94.5
コール・ローン等、その他	45,006	5.5
投資信託財産総額	813,749	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19日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝105.40円、100インドネシア・ルピア＝0.72円です。
(注 3) 当期末における外貨建純資産（798,775千円）の投資信託財産総額（813,749千円）に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	813,749,026円
コール・ローン等	34,392,714
公社債（評価額）	768,742,506
未収利息	10,595,973
前払費用	17,833
(B) 負債	8,931,947
未払解約金	8,931,947
(C) 純資産総額（A－B）	804,817,079
元本	515,930,872
次期繰越損益金	288,886,207
(D) 受益権総口数	515,930,872口
1万口当り基準価額（C／D）	15,599円

* 期首における元本額は897,607,554円、当作成期間中における追加設定元本額は21,468,698円、同解約元本額は403,145,380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）497,154,313円、ダイワ・インドネシア・ルピア債オープン（年1回決算型）18,776,559円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,599円です。

■損益の状況

当期 自 2019年10月18日 至 2020年10月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	59,855,830円
受取利息	59,859,202
支払利息	△ 3,372
(B) 有価証券売買損益	△ 22,605,290
売買益	47,088,212
売買損	△ 69,693,502
(C) その他費用	△ 6,671,304
(D) 当期損益金 (A + B + C)	30,579,236
(E) 前期繰越損益金	495,158,451
(F) 解約差損益金	△ 248,716,008
(G) 追加信託差損益金	11,864,528
(H) 合計 (D + E + F + G)	288,886,207
次期繰越損益金 (H)	288,886,207

- (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。