

ダイワ高格付カナダドル債 オープン (年1回決算型)

運用報告書 (全体版) 第11期

(決算日 2024年5月10日)

(作成対象期間 2023年5月11日~2024年5月10日)

■信託期間終了日を2028年5月10日から
2050年5月10日に変更しました。

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、カナダ・ドル建ての公社債等に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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7月29日~2050年5月10日		
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンドの受益証券	
	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	内外の公社債等および短期金融商品	
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			F T S E カナダ国債 インデックス (円換算)		公社債 組入比率	債券 先物比率	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			
7 期末(2020年5月11日)	円 9,073	円 0	% △ 1.6	10,130	% 1.9	% 97.6	% -	百万円 2,478
8 期末(2021年5月10日)	10,418	0	14.8	11,357	12.1	97.0	-	2,097
9 期末(2022年5月10日)	10,820	0	3.9	11,605	2.2	96.7	-	1,497
10 期末(2023年5月10日)	11,056	0	2.2	11,974	3.2	96.6	-	1,210
11 期末(2024年5月10日)	12,559	0	13.6	13,490	12.7	97.0	-	1,151

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) F T S E カナダ国債インデックス (円換算) は、F T S E カナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) のデータをもとに円換算し、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。F T S E カナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

(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) 公社債および債券先物の組入比率は、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。

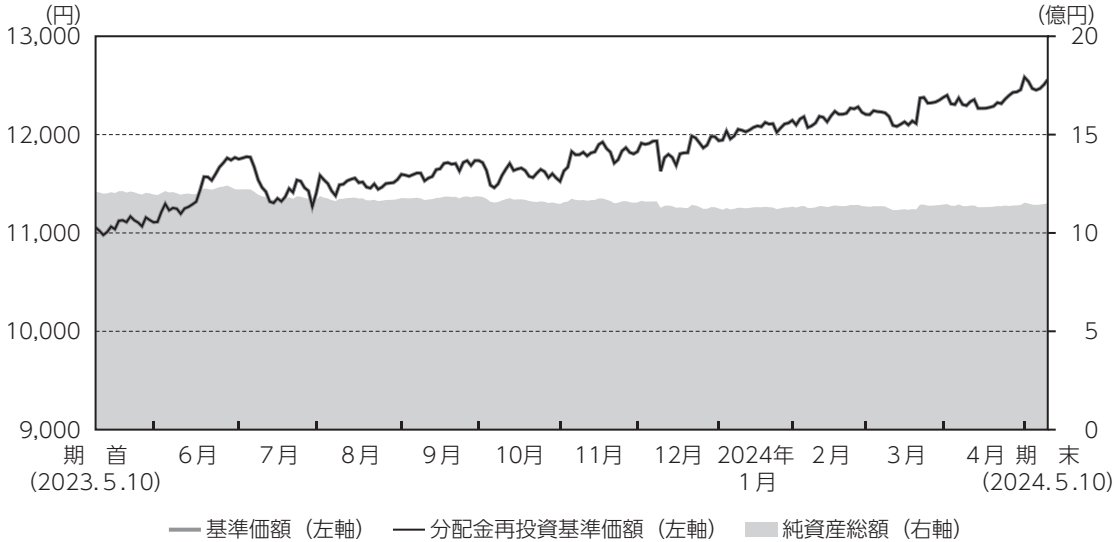
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



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はありません。

*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：11,056円

期末：12,559円（分配金0円）

騰落率：13.6%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

カナダ・ドル建ての債券に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことはマイナス要因となりましたが、債券の利息収入を得たことやカナダ・ドルが対円で上昇（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。

ダイワ高格付カナダドル債オープン（年1回決算型）

年 月 日	基 準 価 額		F T S E カ ナ ダ 国 債 インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2023年 5月10日	円 11,056	% -	11,974	% -	% 96.6	% -
5月末	11,108	0.5	11,984	0.1	96.9	-
6月末	11,751	6.3	12,704	6.1	97.7	-
7月末	11,403	3.1	12,277	2.5	97.3	-
8月末	11,596	4.9	12,457	4.0	97.3	-
9月末	11,736	6.2	12,453	4.0	97.5	-
10月末	11,525	4.2	12,248	2.3	97.4	-
11月末	11,827	7.0	12,724	6.3	97.3	-
12月末	11,938	8.0	12,961	8.2	97.5	-
2024年 1月末	12,145	9.8	13,074	9.2	97.2	-
2月末	12,205	10.4	13,123	9.6	97.5	-
3月末	12,378	12.0	13,322	11.3	97.6	-
4月末	12,583	13.8	13,477	12.6	97.5	-
(期末) 2024年 5月10日	12,559	13.6	13,490	12.7	97.0	-

(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

(2023.5.11～2024.5.10)

■カナダ債券市況

カナダ債券市場の金利は上昇しました。

当作成期首から2023年10月前半にかけては、カナダのインフレ率が市場予想を上振れたことやカナダ銀行（中央銀行）が利上げを実施したことなどから、金利は上昇基調となりました。先進各国で金融引き締めの長期化観測が高まったことなども、金利の上昇要因となりました。12月末にかけては、カナダで利下げ期待が高まったことや米国金利が低下（債券価格は上昇）したことを受けて、カナダの金利は低下しました。その後、当作成期末にかけては、米国で早期の利下げ期待がはく落したことから米国金利が上昇する中、カナダの金利も上昇しました。

■為替相場

カナダ・ドルの対円為替レートは上昇しました。

当作成期首から、インフレ率の上振れや利上げの実施などからカナダの金利が上昇したことで、カナダ・ドルは対円で上昇しました。2023年11月半ばから12月末にかけては、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの思惑が円高要因となったことに加え、原油価格が下落したことなどから、カナダ・ドルは対円で下落（円高）しました。しかしその後は、カナダ金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に、カナダ・ドルは対円で上昇しました。2024年3月には日銀が大規模な金融緩和の終了を発表しましたが、その後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことが円安要因となり、カナダ・ドルは引き続き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

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」の受益証券に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。

■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

主としてカナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。市場動向や経済環境に基づく金利見通しに従い、ポートフォリオの修正デュレーションを3（年）程度から5（年）程度の範囲内で変動させ、債券の種別構成や投資する債券の年限構成を決定します。為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

ポートフォリオについて

(2023.5.11～2024.5.10)

■当ファンド

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」を高位に組み入れました。

■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

カナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。金利変動リスクを表す修正デュレーションについては、3（年）程度から5（年）程度の範囲内で運用しました。

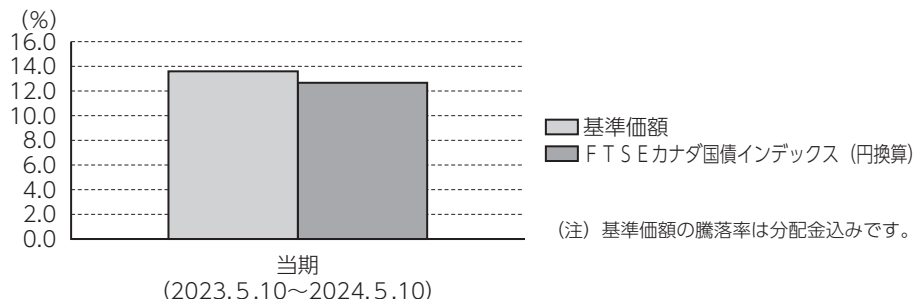
債券種別構成に関しては、カナダの州債の組入比率を高めを保ちました。

為替に関しては、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保ちました。

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。当ファンドは、運用方針により、参考指数と比較して州債や事業債など国債以外の債券にも投資しているという特徴があります。参考指数はカナダの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5月11日 ～2024年5月10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）	2,761

（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

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」の受益証券に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。

■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

主としてカナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。市場動向や経済環境に基づく金利見通しに従い、ポートフォリオの修正デュレーションを3（年）程度から5（年）程度の範囲内で変動させ、債券の種別構成や投資する債券の年限構成を決定します。為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023.5.11~2024.5.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	162円	1.377%	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11,797円です。
（投 信 会 社）	(65)	(0.551)	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）	(91)	(0.771)	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)	(0.055)	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	3	0.029	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）	(2)	(0.021)	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）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	166	1.406	

(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。

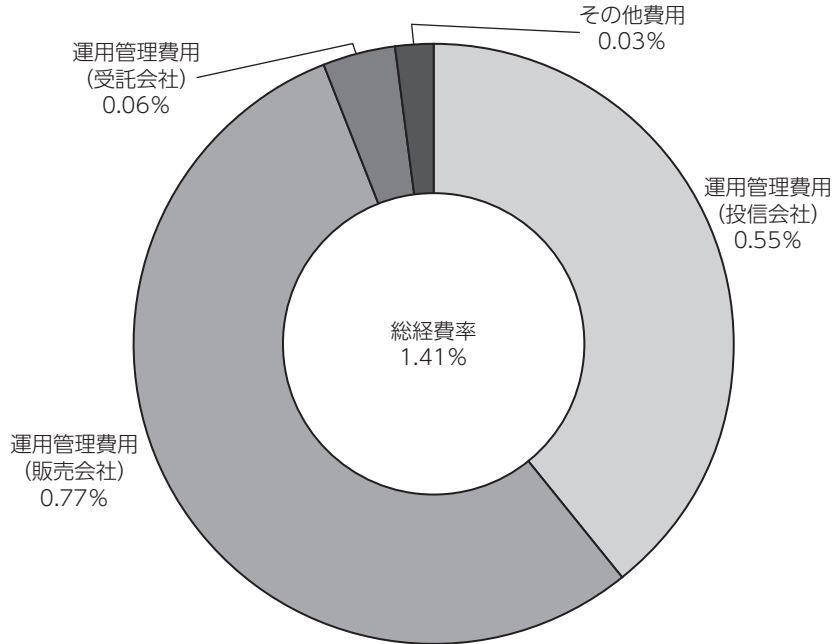
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.41%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。

ダイワ高格付カナダドル債オープン (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

(2023年5月11日から2024年5月10日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ高格付カナダドル債 マザーファンド	6,241	14,930	102,591	238,307

(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	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	550,339	453,989	1,143,190	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	1,143,190	98.5
コール・ローン等、その他	17,453	1.5
投資信託財産総額	1,160,643	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、5月10日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル=113.81円です。

(注3) ダイワ高格付カナダドル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(75,873,652千円)の投資信託財産総額(76,943,471千円)に対する比率は、98.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年5月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,160,643,247円
コール・ローン等	15,584,662
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド(評価額)	1,143,190,212
未収入金	1,868,373
(B) 負債	9,594,493
未払解約金	1,768,236
未払信託報酬	7,779,677
その他未払費用	46,580
(C) 純資産総額(A - B)	1,151,048,754
元本	916,549,093
次期繰越損益金	234,499,661
(D) 受益権総口数	916,549,093口
1万口当り基準価額(C/D)	12,559円

*期首における元本額は1,094,622,293円、当作成期間中における追加設定元本額は38,078,687円、同解約元本額は216,151,887円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,559円です。

■損益の状況

当期 自2023年5月11日 至2024年5月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 975円
受取利息	1,918
支払利息	△ 2,893
(B) 有価証券売買損益	150,824,819
売買益	164,498,894
売買損	△ 13,674,075
(C) 信託報酬等	△ 16,056,739
(D) 当期損益金(A + B + C)	134,767,105
(E) 前期繰越損益金	81,493,401
(F) 追加信託差損益金	18,239,155
(配当等相当額)	(36,855,609)
(売買損益相当額)	(△ 18,616,454)
(G) 合計(D + E + F)	234,499,661
次期繰越損益金(G)	234,499,661
追加信託差損益金	18,239,155
(配当等相当額)	(36,855,609)
(売買損益相当額)	(△ 18,616,454)
分配準備積立金	216,261,481
繰越損益金	△ 975

(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	134,764,830
(c) 収益調整金	36,855,609
(d) 分配準備積立金	81,496,651
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	253,117,090
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	253,117,090
(h) 受益権総口数	916,549,093口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

信託期間終了日を2028年5月10日から2050年5月10日に変更しました。

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

運用報告書 第42期 (決算日 2024年5月10日)

(作成対象期間 2023年11月11日～2024年5月10日)

ダイワ高格付カナダドル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。

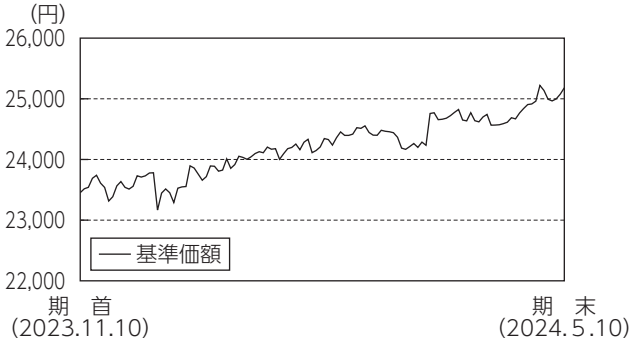
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等および短期金融商品
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		FTSE Eカナダ国債インデックス (円換算)		公社債比率	債券先物比率
	円	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %		
(期首)2023年11月10日	23,453	-	22,977	-	98.0	-
11月末	23,558	0.4	23,238	1.1	97.9	-
12月末	23,807	1.5	23,672	3.0	98.2	-
2024年1月末	24,254	3.4	23,878	3.9	97.8	-
2月末	24,401	4.0	23,967	4.3	98.2	-
3月末	24,776	5.6	24,330	5.9	98.3	-
4月末	25,220	7.5	24,614	7.1	98.1	-
(期末)2024年5月10日	25,181	7.4	24,638	7.2	97.7	-

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) FTSE Eカナダ国債インデックス (円換算) は、FTSE Eカナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) のデータをもとに円換算し、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。FTSE Eカナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- (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) を除きます。
- (注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《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：23,453円 期末：25,181円 騰落率：7.4%

【基準価額の主な変動要因】

カナダ・ドル建ての債券に投資した結果、金利が低下 (債券価格が上昇) したことやカナダ・ドルが対円で上昇 (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。<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

○カナダ債券市況

カナダ債券市場の金利は低下しました。

当作成期首から2023年12月末にかけて、カナダで利下げ期待が高まったことや米国金利が低下したことを受けて、カナダの金利は低下しました。しかしその後は、米国で早期の利下げ期待がはく落したことから米国金利が上昇 (債券価格は下落) する中、カナダの金利も上昇しました。

○為替相場

カナダ・ドルの対円為替レートは上昇しました。

当作成期首から2023年12月末にかけて、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの思惑が円高要因となったことに加え、原油価格が下落したことなどから、カナダ・ドルは対円で下落 (円高) しました。しかしその後は、カナダ金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に、カナダ・ドルは対円で上昇しました。2024年3月には日銀が大規模な金融緩和の終了を発表しましたが、その後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことが円安要因となり、カナダ・ドルは引き続き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」

カナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。市場動向や経済環境に基づく金利見通しに従い、ポートフォリオの修正デュレーションを3 (年) 程度から5 (年) 程度の範囲内で変動させ、債券の種別構成や投資する債券の年限構成を決定します。為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

◆ポートフォリオについて

カナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。金利変動リスクを表す修正デュレーションについては、3 (年) 程度から5 (年) 程度の範囲内で運用しました。

債券種別構成に関しては、カナダの州債の組入比率を高めに保ちました。

為替に関しては、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保ちました。

◆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。

当ファンドは、運用方針により、参考指数と比較して州債や事業債など国債以外の債券にも投資しているという特徴があります。参考指数はカナダの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》

カナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。市場動向や経済環境に基づく金利見通しに従い、ポートフォリオの修正デュレーションを3 (年) 程度から5 (年) 程度の範囲内で変動させ、債券の種別構成や投資する債券の年限構成を決定します。為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

■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	3
(保管費用)	(3)
(その他)	(0)
合計	3

(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11月11日から2024年5月10日まで)

外	カナダ	国債証券	買付額	売付額
			千カナダ・ドル	千カナダ・ドル
国	カナダ	国債証券	14,560	18,763 (-)
		地方債証券	23,111	82,888 (-)
		特殊債券	-	23,974 (-)
		社債券	73,038	64,138 (-)

(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) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公社債

(2023年11月11日から2024年5月10日まで)

当			期		
買	付	売	付	買	付
銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円
TORONTO-DOMINION BANK/THE (カナダ)	4.516% 2027/1/29	4,444,692	Apple Inc (アメリカ)	2.513% 2024/8/19	4,909,940
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I (アメリカ)	3.394% 2030/4/9	2,594,932	ONTARIO PROVINCE (カナダ)	2.4% 2026/6/2	3,651,974
ONTARIO PROVINCE (カナダ)	3.65% 2033/6/2	2,040,992	Province of Quebec Canada (カナダ)	2.5% 2026/9/1	2,884,448
CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	3.25% 2033/12/1	1,584,729	Bank of Montreal (カナダ)	2.7% 2024/9/11	2,196,280
BANK OF MONTREAL (カナダ)	2.7% 2026/12/9	1,049,961	Province of Alberta Canada (カナダ)	2.2% 2026/6/1	1,711,807
PROVINCE OF ALBERTA CANADA (カナダ)	1.65% 2031/6/1	483,664	CPPIB Capital Inc (カナダ)	3% 2028/6/15	1,597,481
			CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	1.5% 2026/6/1	1,043,163
			CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	2% 2028/6/1	1,003,907
			PSP Capital Inc (カナダ)	3% 2025/11/5	853,860
			ONTARIO PROVINCE (カナダ)	9.5% 2025/6/2	331,482

(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		
	額面金額	評価額		組入比率	うちB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	
カナダ	千カナダ・ドル 691,000	千カナダ・ドル 650,786	千円 74,065,959	% 97.7	% -	% 43.8	% 38.0	% 15.9	

(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	期		末		償 還 年 月 日
			年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,000	4,743	539,863	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	10,000	9,376	1,067,139	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	10,000	9,398	1,069,609	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,000	4,304	489,861	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	46,000	40,824	4,646,188	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	20,000	18,668	2,124,696	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	25,000	24,255	2,760,461	2033/12/01
	Province of Quebec Canada	地 方 債 証 券	2.5000	31,000	29,818	3,393,618	2026/09/01
	Province of Quebec Canada	地 方 債 証 券	1.9000	35,000	30,779	3,502,997	2030/09/01
	PROVINCE OF QUEBEC CANADA	地 方 債 証 券	3.6000	7,000	6,628	754,390	2033/09/01
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.4000	25,000	24,073	2,739,833	2026/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.9000	40,000	38,290	4,357,875	2028/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	8,772	998,432	2031/12/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	3.7500	45,000	43,614	4,963,709	2032/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	3.6500	20,000	19,074	2,170,834	2033/06/02
	Province of Alberta Canada	地 方 債 証 券	2.2000	24,000	23,010	2,618,795	2026/06/01
	Province of Alberta Canada	地 方 債 証 券	2.0500	10,000	8,926	1,015,902	2030/06/01
	PROVINCE OF ALBERTA CANADA	地 方 債 証 券	1.6500	28,000	23,811	2,709,952	2031/06/01
	CANADA HOUSING TRUST	特 殊 債 券	1.9000	33,000	29,028	3,303,765	2031/03/15
	Toronto-Dominion Bank/The	社 債 券	3.2260	15,000	14,945	1,700,953	2024/07/24
	TORONTO-DOMINION BANK/THE	社 債 券	4.5160	40,000	39,984	4,550,624	2027/01/29
	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I	社 債 券	5.1800	10,000	10,072	1,146,351	2026/06/15
	METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I	社 債 券	3.3940	25,000	23,525	2,677,465	2030/04/09
	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING	社 債 券	2.0000	55,000	50,057	5,697,066	2028/04/17
Apple Inc	社 債 券	2.5130	2,000	1,986	226,083	2024/08/19	
Canadian Imperial Bank of Commerce/Canad	社 債 券	3.3000	50,000	49,210	5,600,647	2025/05/26	
Bank of Montreal	社 債 券	2.7000	30,000	29,766	3,387,736	2024/09/11	
BANK OF MONTREAL	社 債 券	3.1900	10,000	9,586	1,091,028	2028/03/01	
BANK OF MONTREAL	社 債 券	2.7000	15,000	14,343	1,632,376	2026/12/09	
ROYAL BANK OF CANADA	社 債 券	4.1090	10,000	9,908	1,127,697	2025/12/22	
合 計	銘 柄 数 金 額	30銘柄		691,000	650,786	74,065,959	

(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。

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

■投資信託財産の構成

2024年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	74,065,959	96.3
コール・ローン等、その他	2,877,511	3.7
投資信託財産総額	76,943,471	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、5月10日における邦貨換算レートは、1カナダ・ドル＝113.81円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(75,873,652千円)の投資信託財産総額(76,943,471千円)に対する比率は、98.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年5月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	77,102,254,214円
コール・ローン等	681,663,364
公社債(評価額)	74,065,959,212
未収入金	1,495,111,496
未収利息	720,846,692
前払費用	13,118,176
差入委託証拠金	125,555,274
(B) 負債	1,293,745,005
未払金	1,178,688,414
未払解約金	115,056,591
(C) 純資産総額(A - B)	75,808,509,209
元本	30,105,497,804
次期繰越損益金	45,703,011,405
(D) 受益権総口数	30,105,497,804口
1万口当り基準価額(C/D)	25,181円

* 期首における元本額は34,115,497,560円、当作成期間中における追加設定元本額は83,137,087円、同解約元本額は4,093,136,843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：

ダイワ世界債券ファンドM (FOFs用) (適格機関投資家専用)	132,890,016円
ダイワ高格付カナダドル債オープン (年1回決算型)	453,989,203円
ダイワ世界債券ファンドVA (適格機関投資家専用)	5,589,684円
ダイワ世界債券ファンド (毎月分配型)	1,229,101,379円
ダイワ・グローバル債券ファンド (年2回決算型)	36,483,833円
ダイワ世界債券ファンド (年2回決算型)	2,273,768円
ダイワ高格付カナダドル債オープン (毎月分配型)	23,640,443,642円
ダイワ・グローバル債券ファンド (毎月分配型)	4,604,726,279円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は25,181円です。

■損益の状況

当期 自2023年11月11日 至2024年5月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,127,055,927円
受取利息	1,124,475,517
その他収益金	2,585,862
支払利息	△ 5,452
(B) 有価証券売買損益	4,348,359,741
売買益	4,447,545,324
売買損	△ 99,185,583
(C) その他費用	△ 8,800,653
(D) 当期損益金(A + B + C)	5,466,615,015
(E) 前期繰越損益金	45,896,078,888
(F) 解約差損益金	△ 5,780,018,680
(G) 追加信託差損益金	120,336,182
(H) 合計(D + E + F + G)	45,703,011,405
次期繰越損益金(H)	45,703,011,405

(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。