

ダイワ・グローバル金融機関 (G-SIBs) 債券ファンド (為替ヘッジあり) 2017-01

運用報告書(全体版) 第15期

(決算日 2024年9月10日)

(作成対象期間 2024年3月12日~2024年9月10日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／海外／債券	
信託期間	2017年1月24日~2026年9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・グローバル金融機関(G-SIBs)債券マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバル金融機関(G-SIBs)債券マザーファンド	米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債および国債
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、元本超過額または経費控除後の配当等収益のうちいずれか多い額とし、原則として、経費控除後の配当等収益の中から分配することをめざします。ただし、基準価額の水準等を勘案し、元本超過額も含めて分配を行なうことがあります。なお、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

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、世界の銀行が発行する外貨建ての社債に投資することにより、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/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			受益者 利益回り	公社債 組入比率	債券 先物比率	元本 残存率
	(分配落) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落額 円				
設定(2017年1月24日)	10,000	—	—	—	—	—	100.0
1期末(2017年9月11日)	10,392	110	502	5.0	7.9	95.5	100.0
2期末(2018年3月12日)	9,844	80	△ 468	△ 4.5	0.3	94.9	100.0
3期末(2018年9月10日)	9,721	50	△ 73	△ 0.7	△ 0.2	98.4	100.0
4期末(2019年3月11日)	9,936	25	240	2.5	0.9	96.2	100.0
5期末(2019年9月10日)	10,513	25	602	6.1	3.1	99.0	91.3
6期末(2020年3月10日)	10,702	50	239	2.3	3.3	91.4	47.8
7期末(2020年9月10日)	11,107	110	515	4.8	4.3	96.1	39.1
8期末(2021年3月10日)	10,799	125	△ 183	△ 1.6	3.3	99.8	39.1
9期末(2021年9月10日)	10,838	135	174	1.6	3.3	97.8	39.1
10期末(2022年3月10日)	10,030	135	△ 673	△ 6.2	1.7	99.9	39.1
11期末(2022年9月12日)	9,458	70	△ 502	△ 5.0	0.7	101.3	39.1
12期末(2023年3月10日)	9,213	0	△ 245	△ 2.6	0.2	97.3	39.1
13期末(2023年9月11日)	9,108	0	△ 105	△ 1.1	0.0	97.7	39.1
14期末(2024年3月11日)	9,196	0	88	1.0	0.2	97.0	39.1
15期末(2024年9月10日)	9,231	0	35	0.4	0.2	92.7	26.0

(注1) 基準価額の騰落額および騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 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。

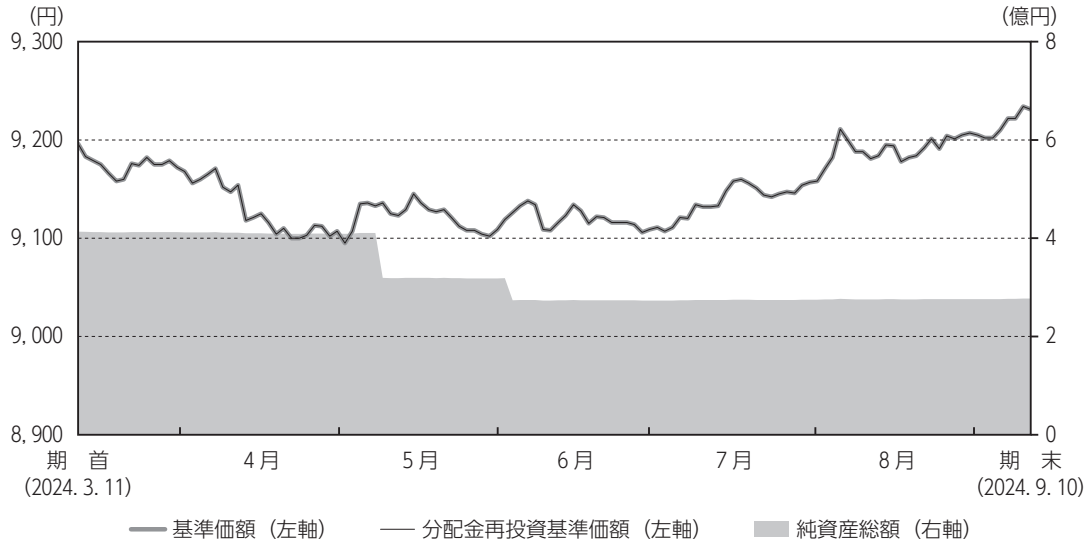
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



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：9,196円

期末：9,231円（分配金0円）

騰落率：0.4%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド」の受益証券を通じて、主としてG-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての社債に投資し、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行った結果、為替ヘッジコストはマイナス要因となりましたが、社債金利が低下（債券価格は上昇）したことや保有債券から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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券ファンド（為替ヘッジあり）2017-01

年 月 日	基 準	価 額		公 社 債 率 組 入 比	債 先 物 比 券 率
		騰 落 率			
(期首) 2024年 3月11日	円	9,196	—	97.0	—
3月末		9,172	△ 0.3	100.0	—
4月末		9,107	△ 1.0	103.3	—
5月末		9,109	△ 0.9	100.0	—
6月末		9,109	△ 0.9	97.6	—
7月末		9,158	△ 0.4	92.7	—
8月末		9,205	0.1	93.5	—
(期末) 2024年 9月10日		9,231	0.4	92.7	—

(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

(2024. 3. 12 ~ 2024. 9. 10)

■米国債券市況

米国国債金利・社債金利ともに低下（債券価格は上昇）しました。

米国債券市場では、当作成期首より、底堅い米国経済を背景に経済指標が市場予想を上回ったことなどから利下げ織り込みがはく落し、金利は上昇（債券価格は下落）基調となりました。しかし2024年5月に入ると、経済指標の下振れなどから金利は低下に転じました。6月には、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見通しにおいて2024年の利下げ回数を引き下げましたが、金利への影響は限定的でした。7月以降は、雇用統計などの各種経済指標が予想を下振れたことで年内の利下げ織り込みが加速し、金利は低下基調が強まりました。

米ドル建て社債については、2024年4月にかけて利下げ織り込みがはく落し、国債金利が上昇する中で、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小基調で推移しました。その後も、利回りを求める投資家からの旺盛な需要に支えられ、スプレッドはタイトに推移しました。8月に景気後退懸念が急浮上すると、スプレッドは一時的に拡大しましたが、その後は過度な懸念が和らぐに連れてスプレッドは縮小しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド

主として、G-SIBs（※）に指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを維持することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

※G-SIBs（Global Systemically Important Banks）とは

主要各国の中央銀行、金融監督当局等で構成される金融安定理事会（FSB）が指定した、金融システム上、世界経済に与える影響が極めて大きい重要な銀行をいいます。一般の銀行と比較し、自己資本の強化が要請される等、厳しい監督を受けることから、安全性の高い健全な経営が求められます。

ポートフォリオについて

(2024. 3. 12 ~ 2024. 9. 10)

■当ファンド

「ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド

主として、G-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを構築しました。

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および参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期は、ヘッジコストの上昇で収益性が低迷しているため、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。

■収益分配金の計算過程

計算期間末における経費控除後の配当等収益が4,041,144円であり、純資産額の元本超過額がないため、経費控除後の配当等収益4,041,144円（1万口当たり134.70円）が分配対象額となりますが、上記の理由により、分配を行っておりません。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れるとともに、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド

主として、G-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを維持することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2024. 3. 12~2024. 9. 10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0. 276%	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9, 148円です。
（投 信 会 社）	(15)	(0. 165)	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）	(9)	(0. 096)	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）	(1)	(0. 014)	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	1	0. 016	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）	(1)	(0. 012)	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）	(0)	(0. 004)	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
合 計	27	0. 292	

(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。

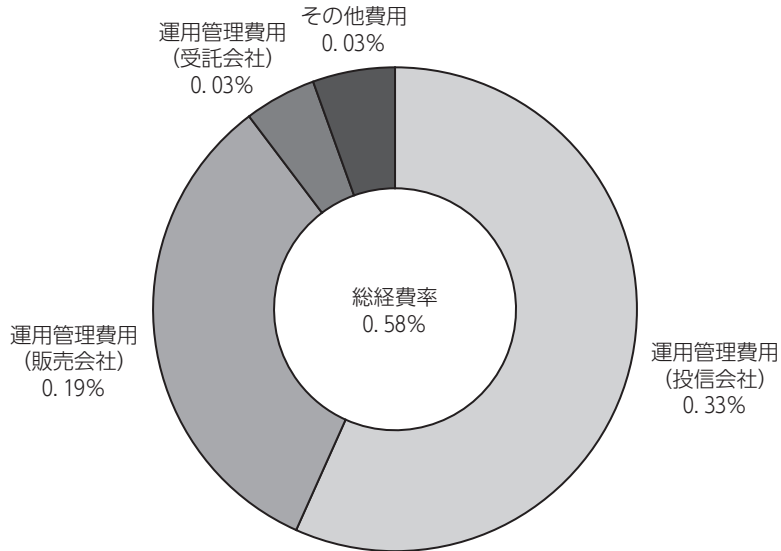
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.58%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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券ファンド（為替ヘッジあり）2017-01

■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

(2024年3月12日から2024年9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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド	8,342	14,000	102,017	177,170

(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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド	253,907	160,232	264,399	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年9月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド	264,399	95.2
コール・ローン等、その他	13,316	4.8
投資信託財産総額	277,715	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、9月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝143.53円です。

(注3) ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,368,198千円）の投資信託財産総額（1,388,822千円）に対する比率は、98.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年9月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	535,099,197円
コール・ローン等	12,102,654
ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド（評価額）	264,399,049
未収入金	258,597,494
(B) 負債	258,166,968
未払金	257,395,061
未払信託報酬	758,532
その他未払費用	13,375
(C) 純資産総額（A-B）	276,932,229
元本	300,000,000
次期繰越損益金	△ 23,067,771
(D) 受益権総口数	300,000,000口
1万口当り基準価額（C/D）	9,231円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,231円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は23,067,771円です。

■損益の状況

当期自 2024年3月12日 至 2024年9月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,861円
受取利息	3,901
支払利息	△ 40
(B) 有価証券売買損益	56,383,716
売買益	103,845,631
売買損	△ 47,461,915
(C) 有価証券評価差損益	△ 55,408,903
(D) 信託報酬等	△ 928,980
(E) 当期損益金（A+B+C+D）	49,694
(F) 前期繰越損益金	△ 36,145,400
(G) 解約差損益金	13,027,935
(H) 合計（E+F+G）	△ 23,067,771
次期繰越損益金（H）	△ 23,067,771

(注1) 有価証券評価差損益は、有価証券の期末の評価損益と期首との差額です。

(注2) 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せん。

(注3) 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4) 収益分配金の計算過程は5ページをご参照ください。

ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2024年9月10日）

（作成対象期間 2024年3月12日～2024年9月10日）

ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券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と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	米ドル、ユーロおよび豪ドル建ての社債および国債
株式組入制限	純資産総額の10%以下

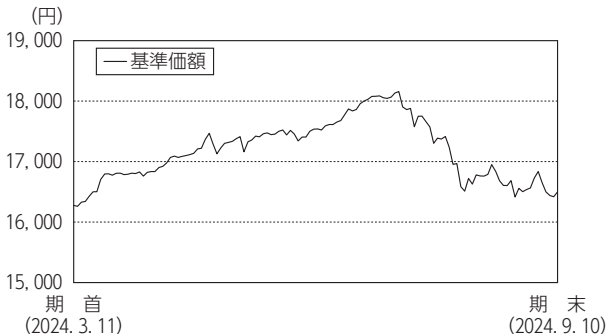
大和アセットマネジメント

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		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率 %		
(期首) 2024年3月11日	16,277	—	97.0	—
3月末	16,784	3.1	98.4	—
4月末	17,367	6.7	97.5	—
5月末	17,442	7.2	96.6	—
6月末	18,000	10.6	97.6	—
7月末	17,239	5.9	97.2	—
8月末	16,565	1.8	97.2	—
(期末) 2024年9月10日	16,501	1.4	97.1	—

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) 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3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。
- (注4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《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：16,277円 期末：16,501円 騰落率：1.4%

【基準価額の主な変動要因】

主としてG-SIBs（※）に指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての社債に投資した結果、円高米ドル安はマイナス要因となりましたが、社債金利が低下（債券価格は上昇）したことや保有債券からの利息収入などがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

※G-SIBs（Global Systemically Important Banks）とは、主要各国の中央銀行、金融監督当局等で構成される金融安定理事会（FSB）が指定した、金融システム上、世界経済に与える影響が極めて大きい重要な銀行をいいます。一般の銀行と比較し、自己資本の強化が要請される等、厳しい監督を受けることから、安全性の高い健全な経営が求められます。

◆ 投資環境について

○ 米国債券市況

米国国債金利・社債金利ともに低下（債券価格は上昇）しました。米国債券市場では、当作成期首より、底堅い米国経済を背景に経済指標が市場予想を上回ったことなどから利下げ織り込みがはく落し、金利は上昇（債券価格は下落）基調となりました。しかし2024年5月に入ると、経済指標の不振などから金利は低下に転じました。6月には、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見直しにおいて2024年の利下げ回数を引き下げましたが、金利への影響は限定的でした。7月以降は、雇用統計などの各種経済指標が予想を下振れたことで年内の利下げ織り込みが加速し、金利は低下基調が強まりました。

米ドル建て社債については、2024年4月にかけて利下げ織り込みがはく落し、国債金利が上昇する中で、スプレッド（国債に対する上乗せ金利）は縮小基調で推移しました。その後も、利回りを求める投資家からの旺盛な需要に支えられ、スプレッドはタイトに推移しました。8月に景気後退懸念が急浮上すると、スプレッドは一時的に拡大しましたが、その後は過度な懸念が和らぐに連れてスプレッドは縮小しました。

○ 為替相場

米ドル為替相場は対円で下落（円高）しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、円安基調となりました。その後、過度な円安米ドル高進行に対し政府・日銀が為替介入を行ったものの、円安基調は継続しました。しかし2024年7月以降は、日銀が7月の金融政策決定会合において、緩和的な金融政策を修正する観測が高まったことなどから大幅な円高米ドル安に転じ、日銀が実際に利上げを決定した後も追加利上げへの警戒感がくすぶったことから、円高基調は継続しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

主として、G-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを維持することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

◆ ポートフォリオについて

主として、G-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを維持しました。

◆ 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および参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

主として、G-SIBsに指定された世界の銀行が発行する米ドル建ての債券に投資し、当ファンドの信託期間内に償還が見込まれる銘柄によるポートフォリオを維持することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざす方針です。

■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 (保管費用)	1 (1)
合 計	1

(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

(2024年3月12日から2024年9月10日まで)

外国	アメリカ	社債券	買付額	売付額
			千アメリカ・ドル 822	千アメリカ・ドル 3,378 (500)

(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

(2024年3月12日から2024年9月10日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
Barclays PLC (イギリス) 4.375% 2026/1/12	59,441	Barclays PLC (イギリス) 4.375% 2026/1/12	93,030
BPCE SA (フランス) 1% 2026/1/20	36,396	Bank of New York Mellon Corp/The (アメリカ) 2.8% 2026/5/4	61,793
Mizuho Financial Group Inc (日本) 3.477% 2026/4/12	28,380	HSBC Holdings PLC (イギリス) 3.9% 2026/5/25	60,899
		CITIGROUP INC (アメリカ) 3.4% 2026/5/1	60,460
		JPMorgan Chase & Co (アメリカ) 3.3% 2026/4/1	46,297
		UBS Group Funding Switzerland AG (スイス) 4.125% 2026/4/15	31,396
		GOLDMAN SACHS GROUP INC. (アメリカ) 3.75% 2026/2/25	31,393
		Mizuho Financial Group Inc (日本) 3.477% 2026/4/12	31,129
		MORGAN STANLEY (アメリカ) 3.125% 2026/7/27	30,823
		Mitsubishi UFJ Financial Group Inc (日本) 3.85% 2026/3/1	30,547

(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					
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	9,550	9,398	1,348,930	97.1	—	—	—	97.1

(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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券マザーファンド

(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	
					千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	JPMorgan Chase & Co	社 債 券	3.3000	800	789	113,318	2026/04/01
	Mizuho Financial Group Inc	社 債 券	3.4770	800	788	113,164	2026/04/12
	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	社 債 券	3.8500	800	793	113,931	2026/03/01
	State Street Corp	社 債 券	2.6500	200	195	28,025	2026/05/19
	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	社 債 券	2.6320	800	776	111,457	2026/07/14
	HSBC Holdings PLC	社 債 券	3.9000	400	396	56,959	2026/05/25
	Bank of New York Mellon Corp/The	社 債 券	2.8000	200	195	28,102	2026/05/04
	Barclays PLC	社 債 券	4.3750	600	598	85,851	2026/01/12
	UBS Group Funding Switzerland AG	社 債 券	4.1250	600	596	85,559	2026/04/15
	CITIGROUP INC	社 債 券	3.4000	600	591	84,886	2026/05/01
	BANK OF AMERICA CORP.	社 債 券	3.5000	800	791	113,552	2026/04/19
	Wells Fargo & Co	社 債 券	3.0000	800	784	112,611	2026/04/22
	MORGAN STANLEY	社 債 券	3.1250	800	783	112,441	2026/07/27
	GOLDMAN SACHS GROUP INC.	社 債 券	3.7500	800	794	113,988	2026/02/25
	ROYAL BANK OF CANADA	社 債 券	1.1500	300	284	40,789	2026/07/14
	BPCE SA	社 債 券	1.0000	250	238	34,288	2026/01/20
合 計	銘柄数	16銘柄					
	金 額			9,550	9,398	1,348,930	

(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

2024年9月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	1,348,930	97.1
コール・ローン等、その他	39,891	2.9
投資信託財産総額	1,388,822	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、9月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝143.53円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産（1,368,198千円）の投資信託財産総額（1,388,822千円）に対する比率は、98.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年9月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,388,822,027円
コール・ローン等	27,991,127
公社債（評価額）	1,348,930,464
未収利息	11,400,465
前払費用	499,971
(B) 負債	—
(C) 純資産総額（A－B）	1,388,822,027
元本	841,681,979
次期繰越損益金	547,140,048
(D) 受益権総口数	841,681,979口
1万口当り基準価額（C/D）	16,501円

* 期首における元本額は1,142,458,300円、当作成期間中における追加設定元本額は32,775,163円、同解約元本額は333,551,484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・グローバル金融機関（G-SIBs）債券ファンド（為替ヘッジあり）2017-01 160,232,137円
 ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券ファンド（為替ヘッジあり）2016-11 260,880,327円
 ダイワ・グローバル金融機関（G-SIBs）債券ファンド（部分為替ヘッジあり）2016-11 420,569,515円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は16,501円です。

■損益の状況

当期 自 2024年3月12日 至 2024年9月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	26,357,506円
受取利息	26,356,940
その他収益金	620
支払利息	△ 54
(B) 有価証券売買損益	27,373,052
売買益	58,474,653
売買損	△ 31,101,601
(C) その他費用	△ 105,670
(D) 当期損益金 (A + B + C)	53,624,888
(E) 前期繰越損益金	717,095,515
(F) 解約差損益金	△ 245,805,192
(G) 追加信託差損益金	22,224,837
(H) 合計 (D + E + F + G)	547,140,048
次期繰越損益金 (H)	547,140,048

(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。