

★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／内外／債券	
信託期間	2015年9月8日～2025年9月5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	為替ヘッジあり	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズーダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	為替ヘッジなし	イ. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズーダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」の受益証券（円建） ロ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
組入制限	当ファンドの投資信託証券組入上限比率	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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。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。	

# ダイワ債券コア戦略ファンド （為替ヘッジあり／為替ヘッジなし）

## 運用報告書（全体版）

### 第13期

（決算日 2022年3月7日）

（作成対象期間 2021年9月8日～2022年3月7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、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、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/>

<2700>  
<2701>

為替ヘッジあり

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
9期末(2020年3月9日)	10,145	0	2.7	—	98.8	4,544
10期末(2020年9月7日)	10,365	35	2.5	—	99.0	3,222
11期末(2021年3月8日)	10,182	40	△ 1.4	—	98.9	2,823
12期末(2021年9月7日)	10,414	95	3.2	—	98.7	2,609
13期末(2022年3月7日)	9,754	70	△ 5.7	—	98.8	2,188

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

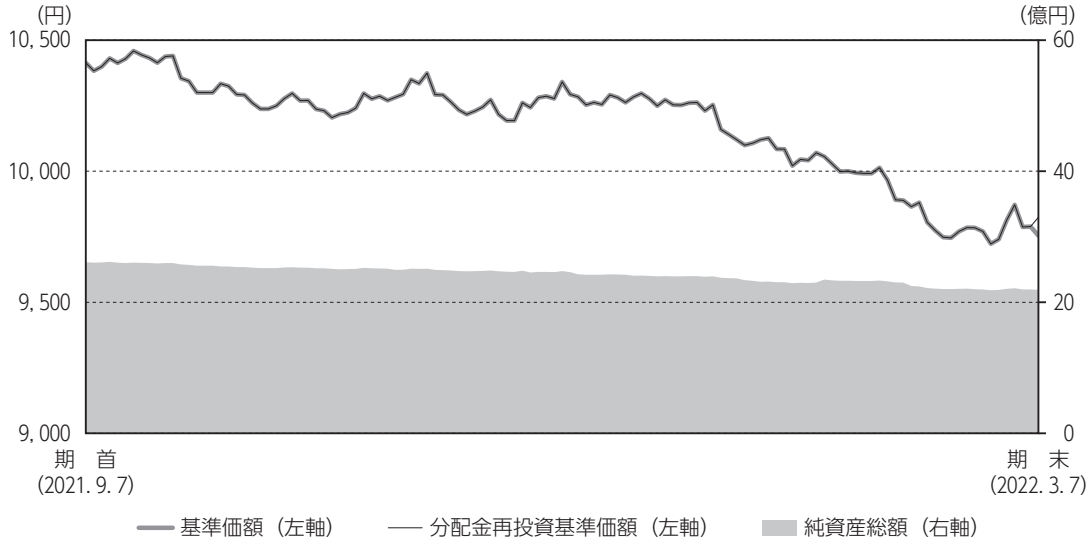
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



(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：10,414円

期末：9,754円（分配金70円）

騰落率：△5.7%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、保有債券の価格の下落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。

※コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）：ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2021年 9 月 7 日	円 10,414	% —	% —	% 98.7	
9 月末	10,300	△ 1.1	—	98.9	
10 月末	10,276	△ 1.3	—	98.7	
11 月末	10,243	△ 1.6	—	98.7	
12 月末	10,231	△ 1.8	—	98.8	
2022年 1 月末	9,994	△ 4.0	—	98.8	
2 月末	9,740	△ 6.5	—	98.9	
(期末)2022年 3 月 7 日	9,824	△ 5.7	—	98.8	

(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

（2021. 9. 8 ～ 2022. 3. 7）

## ■ 米国債券市況

米国金利は上昇（債券価格は下落）しました。

米国債券市況は、当作成期首より、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことなどから、金利は上昇しました。その後は、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。2022年に入ると、F O M C（米国連邦公開市場委員会）後の会見でF R B（米国連邦準備制度理事会）議長が毎会合での利上げの可能性を否定しなかったことから、利上げの織り込みが加速し、金利は上昇しました。2月後半には、ロシアがウクライナに侵攻したことで投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下しました。

## ■ 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■ 当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

## ■ コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの運営にあたっては、市場の不安定化を招く可能性のある外因性要因には警戒しつつ、投資機会を捉えるために銘柄選択に注力するとともに、各債券種別の魅力を見極め、機動的にポジションを調整する方針です。今後も質の高い米ドル建ての複数種別の債券等に厳選投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

また、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・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、A B S（資産担保証券）、バンクローン、M B S（不動産担保証券）、優先証券、劣後債、転換社債、債券E T F（上場投資信託証券）等

## ポートフォリオについて

（2021. 9. 8 ~ 2022. 3. 7）

### ■当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じてコア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

### ■コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

当ファンドは、米ドル建ての複数種別の債券に投資し、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせにより、トータルリターンを最大化をめざすポートフォリオを維持しました。また、為替変動リスクを低減するため、対円での為替ヘッジを行いました。

### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

## 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

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。  
 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	
	2021年9月8日 ～2022年3月7日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>70</b>
対基準価額比率	（％）	0.71
当期の収益	（円）	70
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	548

- (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。

### ■ 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	74.72円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
(c) 収益調整金		155.82
(d) 分配準備積立金		387.46
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）		618.01
(f) 分配金		70.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）		548.01

- (注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。

### ■コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの運営にあたっては、市場の不安定化を招く可能性のある外因性要因には警戒しつつ、投資機会を捉えるために銘柄選択に注力するとともに、各債券種別の魅力を見極め、機動的にポジションを調整する方針です。今後も質の高い米ドル建ての複数種別の債券等に厳選投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。

また、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・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021.9.8~2022.3.7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0.613%	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10,172円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.191)	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)	(42)	(0.409)	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	0	0.004	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
(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	63	0.617	

(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。

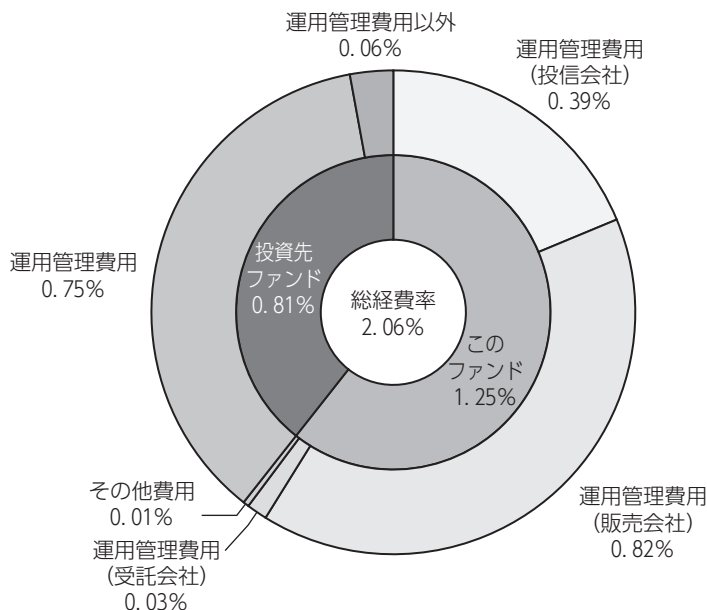
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.06%です。



総経費率（① + ② + ③）	2.06%
①このファンドの費用の比率	1.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.75%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) ①の費用は、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。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況  
投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年3月7日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	708.74081	71,854	3,176.87957	330,000

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
(注2) 金額は受渡し代金。  
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年3月7日まで)

当 期				期 末			
買 付	□ 数	金 額	平均単価	売 付	□ 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	387.75847	40,000	103	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	3,176.87957	330,000	103

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	21,689.34604	2,162,384	98.8

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 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・マネーアセット・マザーファンド	0	0	0

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,162,384	97.4
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0	0.0
コール・ローン等、その他	56,825	2.6
投資信託財産総額	2,219,211	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年3月7日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>2, 219, 211, 036円</b>
コール・ローン等	56, 825, 618
投資信託受益証券（評価額）	2, 162, 384, 421
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	997
<b>(B) 負債</b>	<b>30, 676, 482</b>
未払収益分配金	15, 705, 756
未払信託報酬	14, 871, 669
その他未払費用	99, 057
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>2, 188, 534, 554</b>
元本	2, 243, 679, 497
次期繰越損益金	△ 55, 144, 943
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2, 243, 679, 497口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	9, 754円

\* 期首における元本額は2, 505, 764, 604円、当作成期間中における追加設定元本額は54, 107, 874円、同解約元本額は316, 192, 981円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9, 754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55, 144, 943円です。

### ■損益の状況

当期 自 2021年9月8日 至 2022年3月7日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>31, 736, 926円</b>
受取配当金	31, 743, 577
受取利息	659
支払利息	△ 7, 310
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 147, 323, 520</b>
売買益	7, 235, 476
売買損	△ 154, 558, 996
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 14, 970, 726</b>
<b>(D) 当期損益金（A + B + C）</b>	<b>△ 130, 557, 320</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>86, 934, 254</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>4, 183, 879</b>
（配当等相当額）	（ 34, 961, 354）
（売買損益相当額）	（△ 30, 777, 475）
<b>(G) 合計（D + E + F）</b>	<b>△ 39, 439, 187</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 15, 705, 756</b>
次期繰越損益金（G + H）	△ 55, 144, 943
追加信託差損益金	4, 183, 879
（配当等相当額）	（ 34, 961, 354）
（売買損益相当額）	（△ 30, 777, 475）
分配準備積立金	87, 994, 698
繰越損益金	△ 147, 323, 520

（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	16, 766, 200円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	34, 961, 354
(d) 分配準備積立金	86, 934, 254
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	138, 661, 808
(f) 分配金	15, 705, 756
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	122, 956, 052
(h) 受益権総口数	2, 243, 679, 497口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	70円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

為替ヘッジなし

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
9期末(2020年3月9日)	9,386	70	2.7	—	98.3	687
10期末(2020年9月7日)	9,662	105	4.1	—	99.2	581
11期末(2021年3月8日)	9,685	50	0.8	—	98.6	541
12期末(2021年9月7日)	10,046	100	4.8	—	98.6	550
13期末(2022年3月7日)	9,879	70	△ 1.0	—	98.9	532

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

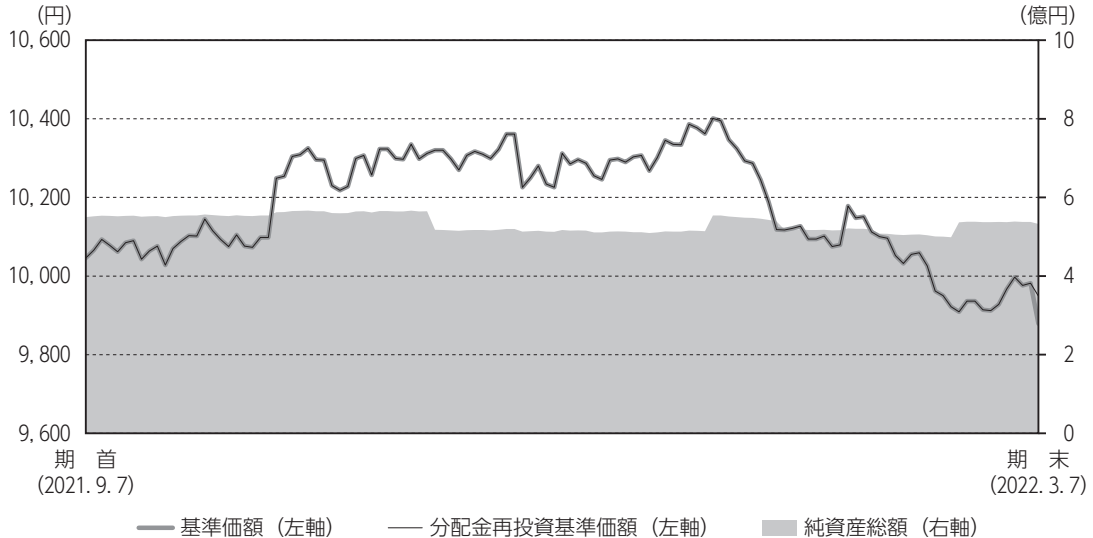
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



(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：10,046円

期末：9,879円（分配金70円）

騰落率：△1.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資を通じて、主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資した結果、米ドルが対円で上昇（円安）したことはプラス要因でしたが、保有債券の価格が下落したことなど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。

※コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）：ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ・ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2021年 9 月 7 日	円 10,046	% —	% —	% 98.6	
9 月末	10,145	1.0	—	98.6	
10 月末	10,257	2.1	—	98.8	
11 月末	10,250	2.0	—	98.4	
12 月末	10,362	3.1	—	98.6	
2022年 1 月末	10,148	1.0	—	98.3	
2 月末	9,928	△ 1.2	—	97.7	
(期末)2022年 3 月 7 日	9,949	△ 1.0	—	98.9	

(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

（2021. 9. 8 ～ 2022. 3. 7）

## ■ 米国債券市況

米国金利は上昇（債券価格は下落）しました。

米国債券市況は、当作成期首より、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことなどから、金利は上昇しました。その後は、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。2022年に入ると、FOMC（米国連邦公開市場委員会）後の会見でFRB（米国連邦準備制度理事会）議長が毎会合での利上げの可能性を否定しなかったことから、利上げの織り込みが加速し、金利は上昇しました。2月後半には、ロシアがウクライナに侵攻したことで投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下しました。

## ■ 為替相場

米ドルは対円で上昇しました。

当作成期首より、米国の利上げ観測の高まりなどを要因として、米ドルは対円で上昇しました。その後、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことによりリスク回避的な動きが円買いにつながったことから、米ドルは一時下落しましたが、米国の利上げペース加速観測などを受けて再度上昇しました。2022年に入ってから、おおむねレンジ内での推移となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■ 当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

## ■ コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等（※）に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの運営にあたっては、市場の不安定化を招く可能性のある外因性要因には警戒しつつ、投資機会を捉えるために銘柄選択に注力するとともに、各債券種別の魅力を見極め、機動的にポジションを調整する方針です。今後も質の高い米ドル建ての複数種別の債券等に厳選投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンを最大化をめざします。

### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

※国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、ABS（資産担保証券）、バンクローン、MBS（不動産担保証券）、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF（上場投資信託証券）等

## ポートフォリオについて

（2021.9.8～2022.3.7）

### ■当ファンド

当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券に投資するファンド・オブ・ファンズであり、当作成期を通じてコア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に維持しました。

### ■コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

当ファンドは、米ドル建ての複数種別の債券に投資し、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせにより、トータルリターンの最大化をめざすポートフォリオを維持しました。

### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

## 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

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

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	
	2021年9月8日 ～2022年3月7日	
当期分配金（税込み）	（円）	70
対基準価額比率	（％）	0.70
当期の収益	（円）	70
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	632

（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。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 72.70円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	154.93
(d) 分配準備積立金	474.52
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	702.16
(f) 分配金	70.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	632.16

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券への投資割合を高位に保つことによって、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。

### ■コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）

引き続き、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの運営にあたっては、市場の不安定化を招く可能性のある外因性要因には警戒しつつ、投資機会を捉えるために銘柄選択に注力するとともに、各債券種別の魅力を見極め、機動的にポジションを調整する方針です。今後も質の高い米ドル建ての複数種別の債券等に厳選投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。

### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 9. 8～2022. 3. 7)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0.613%	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10,182円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.191)	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)	(42)	(0.409)	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	0	0.004	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
(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	63	0.617	

(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。

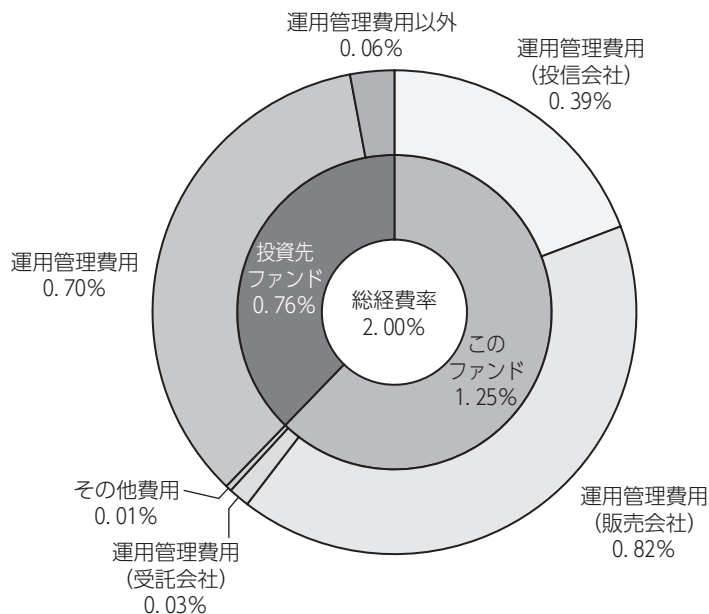
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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2.00%です。



総経費率 ( ① + ② + ③ )	2.00%
①このファンドの費用の比率	1.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.70%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) ①の費用は、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。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■売買および取引の状況  
投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年3月7日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国 (邦貨建)	807.01969	82,245	869.47748	90,000

(注1) 買付は、外国投資信託から支払われた分配金による再投資分を含みます。  
(注2) 金額は受渡し代金。  
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
投資信託受益証券

(2021年9月8日から2022年3月7日まで)

当 期				期 末			
買 付	□ 数	金 額	平均単価	売 付	□ 数	金 額	平均単価
銘 柄	千口	千円	円	銘 柄	千口	千円	円
DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	734.14145	75,000	102	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT (ケイマン諸島)	869.47748	90,000	103

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
外国投資信託受益証券 (ケイマン諸島) DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	5,287.95066	526,669	98.9

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 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・マネーアセット・マザーファンド	0	0	0

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月7日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	526,669	97.6
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0	0.0
コール・ローン等、その他	12,697	2.4
投資信託財産総額	539,367	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年3月7日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>539,367,521円</b>
コール・ローン等	12,697,215
投資信託受益証券（評価額）	526,669,309
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	997
<b>(B) 負債</b>	<b>7,072,539</b>
未払収益分配金	3,771,885
未払信託報酬	3,278,897
その他未払費用	21,757
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>532,294,982</b>
元本	538,840,718
次期繰越損益金	△ 6,545,736
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>538,840,718口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	9,879円

\* 期首における元本額は547,655,083円、当作成期間中における追加設定元本額は77,173,268円、同解約元本額は85,987,633円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,879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6,545,736円です。

### ■損益の状況

当期 自 2021年9月8日 至 2022年3月7日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>7,218,328円</b>
受取配当金	7,220,013
受取利息	175
支払利息	△ 1,860
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 9,762,832</b>
売買益	1,880,441
売買損	△ 11,643,273
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 3,300,654</b>
<b>(D) 当期損益金（A + B + C）</b>	<b>△ 5,845,158</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>25,569,244</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 22,497,937</b>
（配当等相当額）	（ 8,348,475）
（売買損益相当額）	（△ 30,846,412）
<b>(G) 合計（D + E + F）</b>	<b>△ 2,773,851</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 3,771,885</b>
<b>次期繰越損益金（G + H）</b>	<b>△ 6,545,736</b>
追加信託差損益金	△ 22,497,937
（配当等相当額）	（ 8,348,475）
（売買損益相当額）	（△ 30,846,412）
分配準備積立金	25,715,033
繰越損益金	△ 9,762,832

（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	3,917,674円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	8,348,475
(d) 分配準備積立金	25,569,244
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	37,835,393
(f) 分配金	3,771,885
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	34,063,508
(h) 受益権総口数	538,840,718口



収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	70円

- 〈分配金再投資コース〉をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド  
(円ヘッジ・クラス/ノンヘッジ・クラス)

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり/為替ヘッジなし））はケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ-ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス/ノンヘッジ・クラス）」に投資しておりますが、以下の内容は一部の項目を除きすべてのクラスを合算しております。

（注）2022年3月7日時点で入手しうる直近の状況を掲載しております。

貸借対照表  
(2021年9月30日)

<b>資産</b>	
投資資産の評価額（簿価 \$405, 239, 082）	\$ 409, 720, 918
現金	63
中央清算されるデリバティブ取引におけるブローカーへの預託金	12, 780
外国為替先渡取引による評価益	566, 188
ブローカーからの未収金 - 中央清算されるデリバティブ-スワップ取引の変動証拠金	22, 004
抛済ローン契約の評価益	1
未収：	
売却済投資資産の代金	92, 355
受渡遅延の売却済投資資産の代金	32, 920, 848
発行済受益証券の代金	22, 538
配当	16, 923
利息	1, 981, 392
<b>資産合計</b>	<b>445, 356, 010</b>
<b>負債</b>	
外国為替先渡取引による評価損	1, 774, 211
売建オプションによる評価額（受取プレミアム \$144, 135）	103, 025
信用売り評価益（売却代金 \$11, 923, 386）	11, 911, 157
店頭デリバティブ取引におけるブローカーからの預託金	595, 000
買い現先取引の評価額	19, 526, 058
未払：	
購入済投資資産の代金	9, 232, 280
受渡遅延の購入済投資資産の代金	32, 647, 299
償還済受益証券の代金	278, 807
会計および管理会社報酬	357, 626
運用会社報酬	305, 532
専門家報酬	61, 799
保管会社報酬	29, 772
販売会社報酬	20, 688
管理会社報酬	17, 089

名義書換代理人報酬		6,934
代理人報酬		3,181
為替取引執行会社報酬		2,806
印刷費用		1,244
その他負債		165,475
<b>負債合計</b>		<b>77,039,983</b>
<b>純資産</b>	<b>\$</b>	<b>368,316,027</b>
<b>純資産</b>		
豪ドル・クラス	\$	7,185,592
円ヘッジ・クラス		22,498,993
ノンヘッジ・クラス		309,217,155
NZドル・クラス		3,789,133
トルコ・リラ・クラス		11,778,122
米ドル・クラス		7,703,894
南アフリカ・ランド・クラス		6,143,138
	<b>\$</b>	<b>368,316,027</b>
<b>発行済み受益証券</b>		
豪ドル・クラス		88,076
円ヘッジ・クラス		23,780,045
ノンヘッジ・クラス		337,502,763
NZドル・クラス		48,427
トルコ・リラ・クラス		835,216
米ドル・クラス		66,483
南アフリカ・ランド・クラス		79,305
<b>受益証券1口当り純資産額</b>		
豪ドル・クラス	\$	81.58
円ヘッジ・クラス	\$	0.946
ノンヘッジ・クラス	\$	0.916
NZドル・クラス	\$	78.24
トルコ・リラ・クラス	\$	14.10
米ドル・クラス	\$	115.88
南アフリカ・ランド・クラス	\$	77.46

損益計算書

(2021年9月30日に終了した年度)

投資収益

受取利息（源泉徴収税 \$71,613控除後）	\$	10,859,903
配当収益（源泉徴収税 \$77,097控除後）		178,513
<b>投資収益合計</b>		<b>11,038,416</b>

費用

管理会社報酬		1,785,903
会計および管理会社報酬		308,698
販売会社報酬		269,328
運用会社報酬		217,418
保管会社報酬		190,377
専門家報酬		103,307
名義書換代理人報酬		46,616
代理人報酬		40,648
印刷費用		22,522
受託会社報酬		10,000
登録料		6,431
為替取引執行会社報酬		5,944
支払利息		477
その他費用		69
<b>費用合計</b>		<b>3,007,738</b>

投資利益

8,030,678

実現損益および評価損益：

実現益：

証券投資		3,458,642
スワップ取引		796,649
外国為替取引および外国為替先渡取引		1,222,841
<b>実現利益</b>		<b>5,478,132</b>

評価損益の変動：

証券投資		(3,606,915)
スワップ取引		(1,519,137)
外国為替換算および外国為替先渡取引		(1,461,112)
売建オプション		41,110
未拋出ローン契約		1
信用売りの評価益		12,229
<b>評価損益の純変動</b>		<b>(6,533,824)</b>

実現利益および評価損益の純変動

(1,055,692)

運用による純資産の純増

\$ 6,974,986

投資明細表  
2021年9月30日

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	<b>債券 (101.6%)</b>		
	<b>オーストラリア (1.1%)</b>		
	<b>社債 (1.1%)</b>		
	Macquarie Bank Ltd. (a)		
USD 1,610,000	3.62% due 06/03/30	\$	1,688,221
	Macquarie Group Ltd. (a), (b), (c)		
USD 400,000	2.69% due 06/23/32		398,932
	National Australia Bank Ltd. (a)		
USD 750,000	2.99% due 05/21/31		758,094
	Newcrest Finance Pty Ltd. (a), (b)		
USD 800,000	3.25% due 05/13/30		849,324
	Westpac Banking Corp.		
USD 250,000	2.96% due 11/16/40		247,038
	<b>社債合計</b>		<b>3,941,609</b>
	<b>オーストラリア合計 (簿価 \$3,853,226)</b>		<b>3,941,609</b>
	<b>バミューダ (0.3%)</b>		
	<b>資産担保証券 (0.2%)</b>		
	Textainer Marine Containers VII, Ltd. Class A (a), (b)		
USD 843,215	2.73% due 08/21/45		854,449
	<b>資産担保証券合計</b>		<b>854,449</b>
	<b>社債 (0.1%)</b>		
	Triton Container International Ltd. (a), (b)		
USD 450,000	3.15% due 06/15/31		453,706
	<b>社債合計</b>		<b>453,706</b>
	<b>バミューダ合計 (簿価 \$1,292,588)</b>		<b>1,308,155</b>
	<b>カナダ (1.4%)</b>		
	<b>バンクローン* (0.1%)</b>		
	Air Canada		
USD 300,000	4.25% due 08/11/28		301,624
	<b>バンクローン合計</b>		<b>301,624</b>
	<b>社債 (1.3%)</b>		
	1011778 BC ULC / New Red Finance, Inc. (a), (b)		
USD 950,000	4.00% due 10/15/30		940,500
USD 100,000	5.75% due 04/15/25		104,985
	Brookfield Finance, Inc. (b)		
USD 600,000	3.50% due 03/30/51		625,322
USD 150,000	4.70% due 09/20/47		181,231
	CGI, Inc. (a), (b)		
USD 300,000	2.30% due 09/14/31		291,109
	Fairfax Financial Holdings Ltd. (a), (b)		
USD 880,000	3.38% due 03/03/31		911,468
	Wilton RE Ltd. (a), (b), (c), (d)		
USD 1,450,000	6.00%		1,581,443

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 250,000	Yamana Gold, Inc. (a), (b) 2.63% due 08/15/31		243,944
	<b>社債合計</b>		<b>4,880,002</b>
	<b>カナダ合計 (簿価 \$5,021,409)</b>		<b>5,181,626</b>
	<b>ケイマン諸島 (12.7%)</b>		
	<b>資産担保証券 (12.7%)</b>		
U S D 1,000,000	ABPCI Direct Lending Fund CLO I LLC Class B12 (a), (c) 2.18% due 07/20/33		1,000,264
U S D 1,250,000	ABPCI Direct Lending Fund CLO II LLC Class A1R (a), (b), (c) 1.73% due 04/20/32		1,249,074
U S D 750,000	ABPCI Direct Lending Fund CLO V Ltd. Class A1R (a), (b), (c) 1.63% due 04/20/31		749,998
U S D 1,000,000	ABPCI Direct Lending Fund IX LLC Class A1 (a), (c) 2.08% due 11/18/31		1,000,892
U S D 1,000,000	ACRES Commercial Realty 2021-FL1 Ltd. Class C (a), (b), (c) 2.08% due 06/15/36		989,972
U S D 447,149	AIM Aviation Finance, Ltd., 2015-1A Class A1 (a), (b) 4.21% due 02/15/40		379,674
U S D 200,000	AMMC CLO XIV Ltd. Class A2R2 (a), (b), (c) 1.53% due 07/25/29		199,307
U S D 1,000,000	Anchorage Credit Funding 13 Ltd. Class A1 (a), (b) 2.88% due 07/27/39		990,959
U S D 750,000	Anchorage Credit Funding 3 Ltd. Class A1R (a), (b) 2.87% due 01/28/39		775,367
U S D 2,000,000	Anchorage Credit Funding 4 Ltd. Class AR (a), (b) 2.72% due 04/27/39		2,024,894
U S D 2,000,000	BXMT 2020-FL2, Ltd. Class AS (a), (b), (c) 1.31% due 02/15/38		1,996,200
U S D 2,350,000	BXMT 2020-FL2, Ltd. Class C (a), (b), (c) 1.81% due 02/15/38		2,344,125
U S D 250,000	BXMT 2020-FL3 Ltd. Class C (a), (b), (c) 2.71% due 03/15/37		251,551
U S D 1,000,000	Cerberus Loan Funding XVII, Ltd. 2021-2A Class A Class A (a), (c) 1.75% due 04/22/33		998,553
U S D 750,000	Cerberus Loan Funding XXVI LP Class AR (a), (c) 1.63% due 04/15/31		749,999
U S D 1,500,000	Cerberus Loan Funding XXX LP Class A (a), (c) 1.98% due 01/15/33		1,498,076
U S D 1,000,000	Cerberus Loan Funding XXXI LP Class A (a), (c) 1.63% due 04/15/32		1,000,198
U S D 1,000,000	Cerberus Loan Funding XXXIII LP Class B (a), (c) 1.98% due 07/23/33		996,428
U S D 2,000,000	Cerberus Loan Funding XXXV LP Class B (a), (c) 1.98% due 09/22/33		2,000,000
U S D 1,613,518	Denali Capital CLO XI, Ltd. 2015-1A Class A1RR (a), (b), (c) 1.26% due 10/20/28		1,613,697
U S D 1,500,000	Dryden 33 Senior Loan Fund Class BR3 (a), (b), (c) 1.53% due 04/15/29		1,500,020

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 1,750,000	FINS 2020-1 A1 (e) 0.00% due 05/15/38 Fortress Credit Opportunities IX CLO, Ltd. 2017-9A (e)		1,776,722
U S D 1,750,000	0.00% due 10/15/33 Fortress Credit Opportunities XI CLO, Ltd. 2018-11A Class A1T (a), (c)		1,750,000
U S D 1,000,000	1.43% due 04/15/31 Golub Capital Partners CLO 16 Ltd. Class A1R2 (a), (c)		992,530
U S D 250,000	1.70% due 07/25/33 Golub Capital Partners CLO 16 Ltd. Class A2R2 (a), (c)		250,377
U S D 2,000,000	1.89% due 07/25/33 Golub Capital Partners CLO 16 Ltd. Class BR2 (a), (c)		2,010,022
U S D 1,000,000	1.99% due 07/25/33 Golub Capital Partners CLO 33M Ltd. Class AR2 (a), (c)		998,320
U S D 1,250,000	1.98% due 08/25/33 Golub Capital Partners CLO 36M, Ltd. 2018-36A Class A (a), (b), (c)		1,244,310
U S D 1,000,000	1.42% due 02/05/31 Golub Capital Partners CLO 49M Ltd. Class CR (a), (c)		996,783
U S D 500,000	2.70% due 08/26/33 Golub Capital Partners CLO 54M L.P Class C (a), (c)		498,793
U S D 1,000,000	2.77% due 08/05/33 GPMT 2019-FL2 Ltd. Class C (a), (b), (c)		996,877
U S D 480,000	2.43% due 02/22/36 HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd. Class C (a), (b), (c)		478,799
U S D 1,000,000	1.90% due 09/19/26 KDAC Aviation Finance, Ltd. 2017-1A Class A (a)		1,000,000
U S D 1,047,948	4.21% due 12/15/42 LoanCore 2018-CRE1 Issuer, Ltd. Class AS (a), (b), (c)		1,044,017
U S D 1,000,000	1.58% due 05/15/28 LoanCore 2019-CRE2 Issuer, Ltd. Class AS (a), (b), (c)		1,000,000
U S D 1,150,000	1.58% due 05/15/36 Midocean Credit Clo VII 2017-7A Class A2R (a), (b), (c)		1,150,000
U S D 1,000,000	1.58% due 07/15/29 Monroe Capital CLO 2014-1, Ltd. Class BR (a), (c)		1,001,320
U S D 241,980	1.84% due 10/22/26 Owl Rock CLO IV Ltd. Class A2R (a), (b), (c)		241,973
U S D 1,000,000	2.04% due 08/20/33 Palmer Square Loan Funding 2018-4, Ltd. Class A1 (a), (b), (c)		996,241
U S D 997,339	1.02% due 11/15/26 Shackleton 2015-VIII CLO, Ltd. 2015-8A Class A1R (a), (b), (c)		996,691
U S D 2,118,159	1.05% due 10/20/27 THL Credit Lake Shore MM CLO I LTD Class BR (a), (b), (c)		2,118,189
U S D 1,000,000	2.13% due 04/15/33 VENTURE XIII CLO, Ltd. 2013-13A Class SUB (a), (b), (c)		998,312
U S D 500,000	0.00% due 09/10/29		131,043
	<b>資産担保証券合計</b>		<b>46,980,567</b>
	<b>ケイマン諸島合計 (簿価 \$47,159,534)</b>		<b>46,980,567</b>

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	<b>フランス (0.3%)</b>		
	<b>社債 (0.3%)</b>		
	Altice France S. A. (a), (b)		
U S D 250,000	5.13% due 07/15/29		245,508
	BNP Paribas S. A. (a), (b), (c)		
U S D 500,000	2.16% due 09/15/29		496,206
	Societe Generale S. A. (a), (b), (c)		
U S D 500,000	2.89% due 06/09/32		502,244
	<b>社債合計</b>		<b>1,243,958</b>
	<b>フランス合計 (簿価 \$1,250,000)</b>		<b>1,243,958</b>
	<b>ガーンジー (1.0%)</b>		
	<b>社債 (1.0%)</b>		
	Pershing Square Holdings, Ltd. (b)		
U S D 1,600,000	3.25% due 11/15/30		1,617,451
U S D 1,000,000	3.25% due 10/01/31		1,001,150
U S D 1,000,000	5.50% due 07/15/22		1,030,776
	<b>社債合計</b>		<b>3,649,377</b>
	<b>ガーンジー合計 (簿価 \$3,614,171)</b>		<b>3,649,377</b>
	<b>アイルランド (0.1%)</b>		
	<b>社債 (0.1%)</b>		
	LCPR Senior Secured Financing DAC (a), (b)		
U S D 200,000	6.75% due 10/15/27		212,000
	<b>社債合計</b>		<b>212,000</b>
	<b>アイルランド合計 (簿価 \$211,242)</b>		<b>212,000</b>
	<b>日本 (0.7%)</b>		
	<b>社債 (0.7%)</b>		
	Nippon Life Insurance Co. (a), (b), (c)		
U S D 1,850,000	2.90% due 09/16/51		1,821,979
	Sumitomo Life Insurance Co. (a), (b), (c)		
U S D 500,000	3.38% due 04/15/81		519,065
	Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.		
U S D 250,000	2.22% due 09/17/31		245,737
	<b>社債合計</b>		<b>2,586,781</b>
	<b>日本合計 (簿価 \$2,600,000)</b>		<b>2,586,781</b>
	<b>ジャージー、チャンネル諸島 (0.6%)</b>		
	<b>社債 (0.6%)</b>		
	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd. (a)		
U S D 800,000	2.94% due 09/30/40		798,332
U S D 1,400,000	3.25% due 09/30/40		1,411,332
	<b>社債合計</b>		<b>2,209,664</b>
	<b>ジャージー、チャンネル諸島合計 (簿価 \$2,200,000)</b>		<b>2,209,664</b>
	<b>ルクセンブルク (0.1%)</b>		
	<b>バンクローン* (0.1%)</b>		
	Aston FinCo S. A. R. L.		
U S D 246,867	4.33% due 10/09/26		246,122
	Endo Luxembourg Finance Company I S. A. R. L.		
U S D 149,250	5.75% due 03/27/28		146,296
	<b>バンクローン合計</b>		<b>392,418</b>



元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	<b>社債 (0.0%)</b>		
U S D 100,000	Endo Luxembourg Finance Co. I S. A. R. L. / Endo US, Inc. (a), (b) 6.13% due 04/01/29		100,000
	<b>社債合計</b>		<b>100,000</b>
	<b>ルクセンブルク合計 (簿価 \$486,493)</b>		<b>492,418</b>
	<b>メキシコ (0.2%)</b>		
	<b>社債 (0.2%)</b>		
U S D 600,000	Becele SAB de CV (a), (b) 2.50% due 10/14/31		593,856
	<b>社債合計</b>		<b>593,856</b>
	<b>メキシコ合計 (簿価 \$593,856)</b>		<b>593,856</b>
	<b>多国籍企業 (0.5%)</b>		
	<b>社債 (0.5%)</b>		
U S D 450,000	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance PLC (a), (b) 4.00% due 09/01/29		455,062
U S D 1,150,000	Delta Air Lines, Inc. / SkyMiles IP, Ltd. (a) 4.50% due 10/20/25		1,230,449
	<b>社債合計</b>		<b>1,685,511</b>
	<b>多国籍企業合計 (簿価 \$1,598,922)</b>		<b>1,685,511</b>
	<b>オランダ (0.7%)</b>		
	<b>バンクローン* (0.3%)</b>		
U S D 900,000	Diamond (BC) B. V. 0.00% due 09/29/28		901,809
	<b>バンクローン合計</b>		<b>901,809</b>
	<b>社債 (0.4%)</b>		
U S D 200,000	Alcoa Nederland Holding BV (a), (b) 4.13% due 03/31/29		208,500
U S D 200,000	5.50% due 12/15/27 Dufry One BV (b)		214,686
EUR 100,000	3.38% due 04/15/28 Enel Finance International NV (a), (b)		115,026
U S D 250,000	2.88% due 07/12/41 UPC Broadband Finco BV (a), (b)		243,024
U S D 500,000	4.88% due 07/15/31 Ziggo BV (a), (b)		511,930
U S D 300,000	4.88% due 01/15/30		308,340
	<b>社債合計</b>		<b>1,601,506</b>
	<b>オランダ合計 (簿価 \$2,473,864)</b>		<b>2,503,315</b>
	<b>カタール (0.3%)</b>		
	<b>社債 (0.3%)</b>		
U S D 500,000	Qatar Petroleum (a), (b) 3.13% due 07/12/41		499,760
U S D 500,000	3.30% due 07/12/51		505,000
	<b>社債合計</b>		<b>1,004,760</b>
	<b>カタール合計 (簿価 \$998,170)</b>		<b>1,004,760</b>

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	スペイン (0.2%)		
	社債 (0.2%)		
U S D 650,000	Cellnex Finance Co. S. A. (a), (b) 3.88% due 07/07/41		638,437
	<b>社債合計</b>		<b>638,437</b>
	<b>スペイン合計 (簿価 \$643,406)</b>		<b>638,437</b>
	英国 (2.6%)		
	社債 (2.6%)		
U S D 1,450,000	Anglo American Capital PLC (a), (b) 2.63% due 09/10/30		1,438,720
U S D 750,000	3.95% due 09/10/50		800,213
U S D 200,000	5.63% due 04/01/30		241,158
U S D 1,480,000	BP Capital Markets PLC (b), (c), (d) 4.88%		1,626,905
U S D 510,000	Ferguson Finance PLC (a), (b) 3.25% due 06/02/30		544,360
U S D 300,000	INEOS Quattro Finance 2 PLC (a), (b) 3.38% due 01/15/26		303,000
U S D 1,400,000	Standard Chartered PLC (a), (b), (c) 4.64% due 04/01/31		1,613,303
U S D 200,000	Virgin Media Finance PLC (a), (b) 5.00% due 07/15/30		204,272
U S D 400,000	Virgin Media Secured Finance PLC (a), (b) 4.50% due 08/15/30		406,500
GBP 650,000	Vmed O2 UK Financing I PLC (a), (b) 4.00% due 01/31/29		883,001
U S D 100,000	British Telecommunications PLC 9.63% due 12/15/30		152,906
U S D 270,000	Royalty Pharma PLC (b) 2.20% due 09/02/30		263,646
U S D 520,000	3.55% due 09/02/50		509,569
U S D 550,000	Vodafone Group PLC (b), (c) 4.13% due 06/04/81		556,897
U S D 200,000	Weir Group PLC (a), (b) 2.20% due 05/13/26		201,901
	<b>社債合計</b>		<b>9,746,351</b>
	<b>英国合計 (簿価 \$9,444,858)</b>		<b>9,746,351</b>
	米国 (78.8%)		
	資産担保証券 (18.2%)		
U S D 354,809	AASET 2017-1 Trust Class A (a) 3.97% due 05/16/42		325,340
U S D 2,343,147	AASET 2018-2 US, Ltd. Class A (a) 4.45% due 11/18/38		2,275,904
U S D 300,000	ABPCI Direct Lending Fund CLO VII LP Class A1A (a), (c) 1.94% due 10/20/31		300,007
U S D 3,105,779	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 Class GIOP 2.08% due 05/25/47		504,762

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 346, 500	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC Class A2I (a), (b) 4. 19% due 06/07/49		352, 540
U S D 1, 584, 000	Arbys Funding LLC Class A2 (a), (b) 3. 24% due 07/30/50		1, 642, 085
U S D 1, 000, 000	Asset Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust Series AEG 2006-HE1 Class M1 (b), (c) 0. 69% due 01/25/36		991, 715
U S D 422, 380	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE9 Class 2A (b), (c) 0. 23% due 11/25/36		417, 254
U S D 22, 131, 437	Benchmark 2018-B6 Mortgage Trust Class XA (b), (c) 0. 57% due 10/10/51		484, 984
U S D 3, 750, 000	BRAVO Residential Funding Trust 2021-C Class A1 (a) 1. 62% due 03/01/61		3, 748, 321
U S D 883, 669	BX Commercial Mortgage Trust 2019-XL Class F (a), (c) 2. 08% due 10/15/36		884, 733
U S D 1, 000, 000	BX Commercial Mortgage Trust 2021-VOLT Class D (a), (c) 1. 75% due 09/15/36		1, 000, 627
U S D 800, 000	BX Commercial Mortgage Trust 2021-VOLT Class E (a), (c) 2. 10% due 09/15/36		801, 002
U S D 795, 598	Capital Automotive LLC 2017-1A Class A1 (a), (b) 3. 87% due 04/15/47		797, 563
U S D 466, 471	Capmark Military Housing Trust 2007-AET2 Class A (a) 6. 06% due 10/10/52		524, 791
U S D 997, 708	CARS-DB4 LP 2020-1A Class A6 (a), (b) 3. 81% due 02/15/50		1, 070, 800
U S D 598, 625	CARS-DB4 LP Class A5 (a), (b) 3. 48% due 02/15/50		615, 840
U S D 500, 000	CARS-DB5 LP Class A4 (a), (b) 2. 76% due 08/15/51		497, 998
U S D 1, 690, 118	Cascade Funding Mortgage Trust 2018-RM2 Class A (a), (b), (c) 4. 00% due 10/25/68		1, 753, 514
U S D 1, 353, 063	Castlelake Aircraft Securitization Trust 2018-1 Class A (a) 4. 13% due 06/15/43		1, 349, 350
U S D 873, 630	CD 2016-CD1 Mortgage Trust Class XA (b), (c) 1. 52% due 08/10/49		47, 164
U S D 237, 197	CF Hippolyta LLC 2020-1 Class B1 (a), (b) 2. 28% due 07/15/60		240, 604
U S D 959, 636	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 Class XA (b), (c) 1. 89% due 08/10/49		66, 037
U S D 3, 234, 452	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 Class XA (b), (c) 1. 85% due 04/10/49		201, 414
U S D 1, 784, 051	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 Class XA (b), (c) 1. 60% due 10/10/49		97, 503
U S D 99, 648	CMFT Net Lease Master Issuer LLC Class A2 (a), (b) 2. 57% due 07/20/51		99, 290
U S D 700, 000	CMFT Net Lease Master Issuer LLC Class A6 (a), (b) 3. 44% due 07/20/51		698, 674

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 5,910,427	COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust Class XA (b), (c) 1.08% due 10/10/48		184,100
U S D 1,474,760	CSMC 2020-RPL5 Trust Class A1 (a), (b), (c) 3.02% due 08/25/60		1,494,952
U S D 948,358	CSMC 2021-RPL4 Trust Class A1 (a), (b), (c) 1.80% due 12/27/60		951,335
U S D 1,000,000	CSMC 2021-RPL7 Trust Class A1 (a) 1.93% due 07/27/61		1,000,420
U S D 241,250	Domino's Pizza Master Issuer LLC Class A23 (a), (b) 4.12% due 07/25/47		258,920
U S D 248,706	Extended Stay America Trust 2021-ESH Class D (a), (c) 2.33% due 07/15/38		251,789
U S D 146,627	Falcon Aerospace, Ltd. 2017-1 Class A (a) 4.58% due 02/15/42		146,090
U S D 1,167,077	FirstKey Revolving Trust 2020-C2 (a) 3.25% due 12/25/23		1,167,077
U S D 1,600,000	FirstKey Revolving Trust 2021-A (a) 2.21% due 11/30/58		1,600,432
U S D 3,956,979	FNMA-Aces Class X1 (c) 1.58% due 03/25/35		502,138
U S D 892,961	Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates 2015-R1 Class A3 (a), (c) 4.44% due 11/25/52		1,012,299
U S D 1,962,848	Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates 2015-R1 Class B1 (a), (c) 4.66% due 11/25/55		2,305,039
U S D 5,841,810	Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates 2015-R1 Class XA1 (a), (c) 0.70% due 11/25/55		388,135
U S D 19,451,801	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates Class X1 (b), (c) 0.48% due 03/25/25		222,359
U S D 463,349	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. 2006-NELL Class A (a) 5.36% due 05/10/51		504,143
U S D 936,512	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. 2007-HCKM Class A (a) 6.11% due 08/10/52		1,084,446
U S D 1,000,000	GS Mortgage Securities Corp. Trust 2020-DUNE Class D (a), (c) 1.98% due 12/15/36		996,729
U S D 1,000,000	GS Mortgage Securities Corp. Trust 2020-UPTN Class D (a), (c) 3.35% due 02/10/37		1,025,314
U S D 1,551,601	Home Equity Loan Trust 2007-FRE1 Class 1AV1 (b), (c) 0.28% due 04/25/37		1,482,667
U S D 350,000	J. G. Wentworth XLI LLC Class B (a), (b) 4.70% due 10/15/74		408,399
U S D 947,301	Legacy Mortgage Asset Trust 2021-GS2 Class A1 (a), (b) 1.75% due 04/25/61		948,220
U S D 573,038	Legacy Mortgage Asset Trust 2021-GS3 Class A1 (a), (b) 1.75% due 07/25/61		573,503

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 1,591,223	Lehman XS Trust Series 2006-12N Class A32A (b), (c) 0.49% due 08/25/46		1,583,615
U S D 587,722	Lehman XS Trust Series 2007-2N Class 2A (b), (c) 0.27% due 02/25/37		589,385
U S D 1,000,000	LoanCore 2021-CRE4 Issuer Ltd. Class C (a), (c) 1.86% due 07/15/35		997,800
U S D 739,838	LSTAR Securities Investment Ltd. 2020-1 Class A (a), (b), (c) 1.89% due 02/01/26		742,091
U S D 450,552	LSTAR Securities Investment Ltd. 2021-2 Class A1 (a), (c) 1.79% due 03/02/26		450,737
U S D 300,000	Madison Avenue Secured Funding Trust Series 2020-1 Class A (a), (c) 1.71% due 12/13/21		300,000
U S D 15,896,914	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 Class XA (b), (c) 0.92% due 11/15/52		615,427
U S D 2,159,831	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11 Class XA (b), (c) 1.63% due 08/15/49		119,433
U S D 366,276	Nassau 2019 CFO LLC Class A (a), (b) 3.98% due 08/15/34		370,168
U S D 958,026	OSAT 2021-RPL1 Trust Class A1 (a), (b) 2.12% due 05/25/65		957,947
U S D 500,000	Oxford Finance Funding 2020-1 LLC Class A2 (a), (b) 3.10% due 02/15/28		512,651
U S D 965,318	PRPM 2021-5 LLC Class A1 (a), (b) 1.79% due 06/25/26		966,150
U S D 1,900,000	PRPM 2021-8 LLC Class A1 (a), (b), (c) 1.74% due 09/25/26		1,897,616
U S D 107,377	RALI Series 2006-QO2 Trust Class A1 (b), (c) 0.53% due 02/25/46		31,102
U S D 565,244	Raspro Trust 2005-1A Class B (a), (c) 1.06% due 03/23/24		565,243
U S D 75,000	Ready Captial Mortgage Financing 2019-FL3 LLC Class B (a), (c) 1.74% due 03/25/34		75,000
U S D 615,000	Sabey Data Center Issuer LLC Class A2 (a), (b) 3.81% due 04/20/45		647,081
U S D 597,000	ServiceMaster Funding LLC Class A2II (a), (b) 3.34% due 01/30/51		617,802
U S D 1,000,000	Station Place Securitization Trust 2021-WL1 Class E (a), (c) 2.09% due 01/26/54		997,479
U S D 2,600,000	Station Place Securitization Trust 2021-WL2 Class E (a), (b), (c) 1.59% due 03/25/54		2,599,934
U S D 193,583	STORE Master Funding I LLC 2015-1A Class A2 (a), (b) 4.17% due 04/20/45		201,650
U S D 906,229	STORE Master Funding I-VII Class A1 (a), (b) 3.96% due 10/20/46		951,851
U S D 949,511	STORE Master Funding I-VII Class A2 (a), (b) 4.29% due 10/20/48		1,012,516

## ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 1,400,000	Strategic Partners VIII Fund (e) 0.00% due 03/10/25		1,414,000
U S D 191,500	Taco Bell Funding LLC 2016-1A Class A23 (a), (b) 4.97% due 05/25/46		205,084
U S D 500,000	Taco Bell Funding LLC Class A2II (a), (b) 2.29% due 08/25/51		497,701
U S D 165,794	TCP Waterman CLO, Ltd. 2016-1A Class A1ST (a), (c) 2.17% due 12/15/28		165,809
U S D 5,150,366	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 Class XA (b), (c) 1.20% due 08/15/50		242,727
U S D 1,000,000	Vault DI Issuer LLC Class A2 (a), (b) Vault DI Issuer LLC Class A2 (a), (b) 2.80% due 07/15/46		1,001,260
U S D 500,000	VB-S1 Issuer LLC Class C2 (a), (b) 3.03% due 06/15/50		521,105
U S D 419,419	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust Class A (a), (c) 0.22% due 07/25/37		402,577
U S D 693,740	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR9 Trust Class 1A (b), (c) 0.92% due 11/25/46		637,491
U S D 157,424	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 Class A2 (b) 2.63% due 05/15/48		157,386
U S D 8,680,326	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 Class XA (b), (c) 1.06% due 12/15/49		266,474
U S D 3,782,005	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 Class XA (b), (c) 1.59% due 01/15/59		190,225
U S D 248,750	Wingstop Funding LLC Class A2 (a), (b) 2.84% due 12/05/50		255,761
U S D 1,250,000	Woodmont 2020-7 Trust Class A1A (a), (c) 2.03% due 01/15/32		1,256,250
U S D 500,000	ZH Trust 2021-1 Class A (a) 2.25% due 02/18/27		500,551
U S D 1,000,000	ZH Trust 2021-2 Class A (a) 2.35% due 10/17/27		999,420
	<b>資産担保証券合計</b>		<b>66,814,821</b>
	<b>バンクローン* (4.0%)</b>		
U S D 494,872	Alterra Mountain Company 4.00% due 08/17/28		494,409
U S D 198,500	AmWINS Group, Inc. 3.00% due 02/19/28		197,509
U S D 150,000	Apttus Corporation 5.00% due 05/08/28		150,969
U S D 346,500	Ascend Learning, LLC 4.75% due 07/12/24		347,366
U S D 495,627	Cambrex Corp. 4.25% due 12/04/26		496,952

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 895, 500	Citadel Securities LP 2. 58% due 02/02/28 CP Atlas Buyer, Inc.		888, 466
U S D 497, 500	4. 25% due 11/23/27 Cushman & Wakefield U. S. Borrower, LLC		496, 624
U S D 147, 743	2. 83% due 08/21/25 Deerfield Dakota Holding, LLC		146, 654
U S D 148, 496	4. 75% due 04/09/27 DiversiTech Holdings, Inc.		149, 111
U S D 641, 681	4. 25% due 12/02/24 Energizer Holdings, Inc.		642, 284
U S D 248, 750	2. 75% due 12/22/27 Filtration Group Corp.		249, 009
U S D 393, 636	3. 08% due 03/31/25 Graftech International Ltd.		392, 191
U S D 342, 641	3. 50% due 02/12/25 Hamilton Holdco LLC		343, 528
U S D 574, 006	2. 14% due 01/02/27 Hamilton Projects Acquiror, LLC		572, 302
U S D 791, 980	5. 75% due 06/17/27 Help at Home, LLC		796, 067
U S D 248, 895	6. 00% due 10/29/27 Higginbotham Insurance Agency, Inc.		249, 517
U S D 62, 560	5. 28% due 11/25/26 (f)		61, 622
U S D 271, 756	6. 25% due 11/25/26 HighTower Holding, LLC		267, 679
U S D 200, 000	4. 75% due 04/21/28 ITT Holdings LLC (f)		200, 281
U S D 200, 000	3. 25% due 07/10/28 Jane Street Group, LLC		200, 125
U S D 545, 376	2. 83% due 01/26/28 Mavis Tire Express Services Topco Corp.		540, 672
U S D 399, 000	4. 75% due 05/04/28 Midwest Veterinary Partners, LLC		400, 428
U S D 250, 000	4. 75% due 04/27/28 Mileage Plus Holdings LLC		250, 313
U S D 400, 000	6. 25% due 06/21/27 National Mentor Holdings, Inc.		425, 376
U S D 239, 978	4. 50% due 03/02/28 Orion Advisor Solutions, Inc.		240, 278
U S D 199, 000	4. 50% due 09/24/27 Park River Holdings, Inc.		199, 394
U S D 29, 832	4. 00% due 12/28/27 Peraton Corp.		29, 748
U S D 447, 750	4. 50% due 02/01/28 PetIQ, LLC		448, 800
U S D 498, 750	4. 75% due 04/13/28		496, 880

## ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 397,000	Planview Parent, Inc. 4.75% due 12/17/27		398,739
U S D 267,631	ProQuest LLC 3.33% due 10/23/26		267,691
U S D 141,138	Recorded Books Inc. 4.08% due 08/29/25		141,469
U S D 347,587	Southern Veterinary Partners, LLC 5.00% due 10/05/27		349,325
U S D 347,328	SP PF Buyer LLC 4.58% due 12/22/25		342,118
U S D 888,693	TransDigm Inc. 2.33% due 12/09/25		878,927
U S D 346,091	Upland Software, Inc. 3.83% due 08/06/26		346,480
U S D 247,489	USI, Inc. 3.38% due 12/02/26		246,310
U S D 1,188,225	Waystar Technologies, Inc. 4.08% due 10/22/26		1,190,453
U S D 246,875	Xplornet Communications Inc. 4.84% due 06/10/27		247,051
	<b>バンクローン合計</b>		<b>14,783,117</b>
	<b>社債 (32.5%)</b>		
U S D 350,000	Acadia Healthcare Co., Inc. (a), (b) 5.00% due 04/15/29		364,437
U S D 360,000	AES Corp. (a), (b) 3.95% due 07/15/30		395,863
U S D 200,000	Allison Transmission, Inc. (a), (b) 3.75% due 01/30/31		194,500
U S D 490,000	Altria Group, Inc. (b) 3.40% due 05/06/30		517,991
U S D 1,100,000	3.70% due 02/04/51		1,038,969
U S D 90,000	4.45% due 05/06/50		94,367
U S D 340,000	Amazon.com, Inc. (b) 2.70% due 06/03/60		318,847
U S D 240,000	Amcor Flexibles North America, Inc. (b) 2.63% due 06/19/30		244,796
U S D 950,000	American International Group, Inc. (b) 4.38% due 06/30/50		1,166,840
U S D 410,000	Americo Life, Inc. (a) 3.45% due 04/15/31		412,483
U S D 200,000	Amsted Industries, Inc. (a), (b) 4.63% due 05/15/30		205,500
U S D 240,000	Apollo Management Holdings LP (a), (b) 2.65% due 06/05/30		242,105
U S D 20,000	Aramark Services, Inc. (a), (b) 5.00% due 02/01/28		20,550



元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 700,000	Ares Finance Co. II LLC (a), (b) 3.25% due 06/15/30		730,142
U S D 280,000	Arizona Public Service Co. (b) 3.35% due 05/15/50		291,268
U S D 500,000	Assurant, Inc. (b) 2.65% due 01/15/32		494,990
U S D 300,000	Assured Guaranty US Holdings, Inc. (b) 3.15% due 06/15/31		314,227
U S D 150,000	AT&T, Inc. (b) 3.60% due 09/15/51		152,115
U S D 690,000	Avantor Funding, Inc. (a), (b) 2.75% due 06/01/31		706,894
U S D 200,000	Baker Hughes a GE Co. LLC / Baker Hughes Co. -Obligor, Inc. (b) 4.63% due 07/15/28		210,510
U S D 90,000	Bank of America Corp. (b), (c) 4.49% due 05/01/30		105,182
U S D 1,400,000	Bank of New York Mellon Corp. (b), (c), (d) 2.68% due 06/19/41		1,348,578
U S D 230,000	BAT Capital Corp. (b) 4.70%		252,425
U S D 1,700,000	Belrose Funding Trust (a), (b) 3.98% due 09/25/50		1,644,239
U S D 550,000	Bimbo Bakeries USA, Inc. (a), (b) 2.33% due 08/15/30		541,943
U S D 200,000	Blackstone Holdings Finance Co. LLC (a), (b) 4.00% due 05/17/51		216,171
U S D 1,700,000	Boeing Co. (b) 2.80% due 09/30/50		1,626,400
U S D 1,000,000	Boxer Parent Co., Inc. (a), (b) 3.63% due 02/01/31		1,070,051
U S D 1,680,000	British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust (a) 5.15% due 05/01/30		1,967,616
U S D 840,000	Broadcom, Inc. (b) 5.71% due 05/01/40		1,069,908
U S D 840,000	Brown & Brown, Inc. (b) 5.81% due 05/01/50		1,115,714
U S D 150,000	Bunge Ltd. Finance Corp. (b) 7.13% due 10/02/25		160,125
U S D 904,325	Brookfield Finance LLC (b) 4.25% due 05/15/34		974,367
U S D 200,000	Brown & Brown, Inc. (b) 2.45% due 02/15/31		193,754
U S D 545,000	Bunge Ltd. Finance Corp. (b) 3.19% due 11/15/36 (a), (b)		542,520
U S D 845,000	Brookfield Finance LLC (b) 4.15% due 11/15/30		935,736
U S D 100,000	Brown & Brown, Inc. (b) 3.45% due 04/15/50		102,893
U S D 800,000	Bunge Ltd. Finance Corp. (b) 2.38% due 03/15/31		796,599
U S D 150,000	Bunge Ltd. Finance Corp. (b) 1.63% due 08/17/25		151,507

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 425,000	California Institute of Technology (b) 3.65% due 09/01/19		478,746
U S D 440,000	Carpenter Technology Corp. (b) 6.38% due 07/15/28		473,194
U S D 50,000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp. (a), (b) 4.25% due 02/01/31		50,750
U S D 250,000	Central Garden & Pet Co. (a), (b) 4.13% due 04/30/31		253,881
U S D 1,050,000	Charles Schwab Corp. (b), (c), (d) 4.00%		1,079,883
U S D 400,000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital (b) 2.25% due 01/15/29		399,315
U S D 1,050,000	2.80% due 04/01/31		1,051,157
U S D 300,000	3.90% due 06/01/52		297,515
U S D 100,000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC (a), (b) 2.74% due 12/31/39		98,905
U S D 1,300,000	3.52% due 12/31/39		1,312,337
U S D 350,000	Chevron USA, Inc. (b) 2.34% due 08/12/50		314,570
U S D 780,000	Choice Hotels International, Inc. (b) 3.70% due 01/15/31		841,082
U S D 1,000,000	Citigroup, Inc. (b), (c) 2.57% due 06/03/31		1,018,210
U S D 1,200,000	3.88% (d)		1,226,760
U S D 400,000	4.00% (d)		414,480
U S D 1,140,000	CoStar Group, Inc. (a), (b) 2.80% due 07/15/30		1,158,246
U S D 200,000	CSC Holdings LLC (a), (b) 3.38% due 02/15/31		186,000
U S D 400,000	4.13% due 12/01/30		392,500
U S D 293,000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC (a), (b) 6.75% due 05/15/28		317,905
U S D 850,000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp. (b) 2.15% due 11/01/30		798,728
U S D 300,000	Daddy Operating Co. LLC / GD Finance Co., Inc. (a), (b) 3.50% due 03/01/29		297,375
U S D 530,000	DaVita, Inc. (a), (b) 3.75% due 02/15/31		516,087
U S D 191,000	4.63% due 06/01/30		196,465
U S D 1,795,000	Delta Air Lines, Inc. (a) 7.00% due 05/01/25		2,093,308
U S D 50,000	EnerSys (a), (b) 4.38% due 12/15/27		52,625
U S D 950,000	Equitable Holdings, Inc. (b), (c), (d) 4.95%		1,030,750

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 620,000	Everest Reinsurance Holdings, Inc. (b) 3.50% due 10/15/50		657,878
U S D 960,000	Fidelity National Financial, Inc. (b) 2.45% due 03/15/31		953,732
U S D 680,000	3.40% due 06/15/30		729,515
U S D 610,000	First American Financial Corp. (b) 4.00% due 05/15/30		673,432
U S D 500,000	Florida Gas Transmission Co. LLC (a), (b) 2.30% due 10/01/31		490,335
U S D 200,000	2.55% due 07/01/30		202,069
U S D 100,000	Flowserve Corp. (b) 2.80% due 01/15/32		98,838
U S D 860,000	3.50% due 10/01/30		897,065
U S D 449,000	Fort Benning Family Communities LLC (a) 5.81% due 01/15/51		581,101
U S D 450,000	FS KKR Capital Corp. (b) 2.63% due 01/15/27		450,885
U S D 800,000	Gartner, Inc. (a), (b) 3.75% due 10/01/30		823,360
U S D 570,000	GATX Corp. (b) 4.00% due 06/30/30		635,317
U S D 350,000	Global Atlantic Finance Co. (a), (b) 3.13% due 06/15/31		354,490
U S D 500,000	4.70% due 10/15/51		516,916
U S D 350,000	Global Payments, Inc. (b) 2.90% due 05/15/30		360,751
U S D 580,000	GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc. (b) 4.00% due 01/15/31		625,826
U S D 450,000	5.30% due 01/15/29		526,122
U S D 350,000	Goldman Sachs Group, Inc. (b), (c), (d) 3.80%		358,312
U S D 65,000	Graphic Packaging International LLC (a), (b) 3.50% due 03/01/29		64,675
U S D 200,000	GXO Logistics, Inc. (a), (b) 2.65% due 07/15/31		198,628
U S D 100,000	Hanesbrands, Inc. (a), (b) 5.38% due 05/15/25		104,688
U S D 320,000	Health Care Service Corp. A Mutual Legal Reserve Co. (a), (b) 3.20% due 06/01/50		328,225
U S D 850,000	Healthcare Trust of America Holdings LP (b) 2.00% due 03/15/31		813,972
U S D 550,000	Hilton Domestic Operating Co., Inc. (a), (b) 3.75% due 05/01/29		555,500
U S D 850,000	Hologic, Inc. (a), (b) 3.25% due 02/15/29		853,204
U S D 100,000	Home Point Capital, Inc. (a), (b) 5.00% due 02/01/26		90,652

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 720,000	Host Hotels & Resorts LP (b) 3.50% due 09/15/30		747,160
U S D 48,000	Howmet Aerospace, Inc. 6.75% due 01/15/28		58,440
U S D 2,000	6.88% due 05/01/25		2,340
U S D 400,000	Hunt Cos, Inc. (a), (b) 5.25% due 04/15/29		392,000
U S D 350,000	Hunt MH Borrower LLC Fee II 5.25% due 12/21/48		361,725
U S D 390,000	Hyatt Hotels Corp. (b) 5.38% due 04/23/25		435,467
U S D 350,000	5.75% due 04/23/30		419,757
U S D 410,000	Intercontinental Exchange, Inc. (b) 3.00% due 06/15/50		404,206
U S D 175,000	Iron Mountain, Inc. (a), (b) 4.50% due 02/15/31		177,503
U S D 575,000	5.25% due 07/15/30		610,207
U S D 200,000	5.63% due 07/15/32		214,500
U S D 500,000	ITT Holdings LLC (a), (b) 6.50% due 08/01/29		504,375
U S D 475,000	Jaguar Holding Co. II / PPD Development LP (a), (b) 4.63% due 06/15/25		493,406
U S D 500,000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co. -Issuer Corp. (a), (b) 5.00% due 08/15/28		507,500
U S D 640,000	Jefferies Group LLC (b) 2.75% due 10/15/32		640,454
U S D 500,000	Johns Hopkins University (b) 2.81% due 01/01/60		507,249
U S D 380,000	JPMorgan Chase & Co. (b), (c) 2.96% due 05/13/31		394,681
U S D 500,000	3.65% (d)		500,625
U S D 400,000	4.49% due 03/24/31		466,286
U S D 1,700,000	Kemper Corp. (b) 2.40% due 09/30/30		1,681,409
U S D 300,000	Kennedy-Wilson, Inc. (b) 4.75% due 03/01/29		305,250
U S D 100,000	4.75% due 02/01/30		101,750
U S D 350,000	KKR Group Finance Co. III LLC (a), (b) 5.13% due 06/01/44		451,496
U S D 460,000	KKR Group Finance Co. VIII LLC (a), (b) 3.50% due 08/25/50		484,043
U S D 340,000	Kraft Heinz Foods Co. 4.38% due 06/01/46		386,817
U S D 125,000	4.88% due 10/01/49		152,120
U S D 100,000	5.00% due 06/04/42		122,601
U S D 125,000	5.50% due 06/01/50		164,560

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 200,000	Kuvare US Holdings, Inc. (a), (b), (c) 7.00% due 02/17/51		215,688
U S D 200,000	Lamar Media Corp. (b) 3.63% due 01/15/31		200,000
U S D 400,000	Lamb Weston Holdings, Inc. (a), (b) 4.88% due 11/01/26		409,808
U S D 550,000	Leidos, Inc. (b) 2.30% due 02/15/31		537,377
U S D 50,000	4.38% due 05/15/30		56,703
U S D 700,000	Level 3 Financing, Inc. (a), (b) 3.63% due 01/15/29		678,804
U S D 200,000	3.75% due 07/15/29		193,296
U S D 150,000	3.88% due 11/15/29		160,395
U S D 513,000	4.25% due 07/01/28		516,965
U S D 470,000	Liberty Mutual Group, Inc. (a), (b) 3.95% due 05/15/60		520,428
U S D 1,350,000	4.30% due 02/01/61		1,286,037
U S D 850,000	Liberty Utilities Finance GP 1 (a), (b) 2.05% due 09/15/30		821,482
U S D 260,000	Lincoln National Corp. (b) 4.38% due 06/15/50		314,225
U S D 100,000	Lowe's Cos, Inc. (b) 1.70% due 09/15/28		99,027
U S D 330,000	Magellan Midstream Partners LP (b) 3.25% due 06/01/30		352,392
U S D 1,120,000	Markel Corp. (b), (c), (d) 6.00%		1,240,960
U S D 560,000	Marriott International, Inc. (b) 2.85% due 04/15/31		566,519
U S D 570,000	3.50% due 10/15/32		604,837
U S D 560,000	4.63% due 06/15/30		639,150
U S D 440,000	5.75% due 05/01/25		503,017
U S D 500,000	Marriott International, Inc. /MDMarriott International, Inc. (b) 2.75% due 10/15/33		488,392
U S D 200,000	Match Group Holdings II LLC (a), (b) 4.63% due 06/01/28		208,500
U S D 600,000	Mav Acquisition Corp. (a), (b) 5.75% due 08/01/28		589,500
U S D 1,700,000	MetLife, Inc. (b), (c), (d) 3.85%		1,782,875
U S D 210,000	Midwest Connector Capital Co. LLC (a), (b) 4.63% due 04/01/29		225,539
U S D 500,000	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd. (a), (b) 6.50% due 06/20/27		543,574
U S D 255,000	Minerals Technologies, Inc. (a), (b) 5.00% due 07/01/28		264,562

## ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 1,000,000	Morgan Stanley (b), (c) 2.48% due 09/16/36		977,963
U S D 1,150,000	Mozart Debt Merger Sub, Inc. (a), (b) 3.88% due 04/01/29		1,150,000
U S D 242,000	MSCI, Inc. (a), (b) 3.63% due 09/01/30		250,167
U S D 24,000	3.88% due 02/15/31 Nasdaq, Inc. (b)		25,170
U S D 190,000	3.25% due 04/28/50 Nationwide Mutual Insurance Co. (a), (b)		190,967
U S D 1,670,000	4.35% due 04/30/50 NetApp, Inc. (b)		1,897,552
U S D 1,126,000	2.70% due 06/22/30 New Enterprise Stone & Lime Co., Inc. (a), (b)		1,155,927
U S D 150,000	6.25% due 03/15/26 NFP Corp. (a), (b)		155,100
U S D 400,000	6.88% due 08/15/28 Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co. (a), (b)		408,420
U S D 100,000	4.50% due 07/15/29 Norfolk Southern Corp. (b)		97,780
U S D 100,000	4.10% due 05/15/21 NRG Energy, Inc. (a), (b)		111,936
U S D 400,000	2.45% due 12/02/27 NuStar Logistics LP (b)		405,618
U S D 250,000	6.38% due 10/01/30 Occidental Petroleum Corp. (b)		275,000
U S D 140,000	3.00% due 02/15/27		139,892
U S D 400,000	4.63% due 06/15/45 OneAmerica Financial Partners, Inc. (a), (b)		409,000
U S D 870,000	4.25% due 10/15/50 Oracle Corp. (b)		923,834
U S D 500,000	3.95% due 03/25/51 Orlando Health Obligated Group		529,842
U S D 1,000,000	2.89% due 10/01/35 Oshkosh Corp. (b)		1,040,212
U S D 70,000	3.10% due 03/01/30 Owens Corning (b)		73,502
U S D 100,000	3.88% due 06/01/30 Papa John's International, Inc. (a), (b)		110,139
U S D 1,000,000	3.88% due 09/15/29 PartnerRe Finance B LLC (b), (c)		992,380
U S D 220,000	4.50% due 10/01/50 Penn Mutual Life Insurance Co. (a)		231,750
U S D 200,000	3.80% due 04/29/61 PerkinElmer, Inc. (b)		207,465
U S D 1,000,000	2.25% due 09/15/31		985,276

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 350,000	PetSmart, Inc. / PetSmart Finance Corp. (a), (b) 4.75% due 02/15/28		360,719
U S D 350,000	Post Holdings, Inc. (a), (b) 4.50% due 09/15/31		345,846
U S D 125,000	4.63% due 04/15/30		125,966
U S D 75,000	Presidio Holdings, Inc. (a), (b) 4.88% due 02/01/27		77,437
U S D 175,000	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance, Inc. (a), (b) 3.38% due 08/31/27		168,263
U S D 1,000,000	Providence St Joseph Health Obligated Group (b) 2.70% due 10/01/51		952,278
U S D 230,000	Prudential Financial, Inc. (b), (c) 3.70% due 10/01/50		239,457
U S D 150,000	Qorvo, Inc. (b) 3.38% due 04/01/31		158,160
U S D 290,000	4.38% due 10/15/29		316,100
U S D 1,004,000	Quanta Services, Inc. (b) 2.90% due 10/01/30		1,037,453
U S D 850,000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance, Inc. (a), (b) 4.50% due 09/15/26		877,625
U S D 250,000	Raymond James Financial, Inc. (b) 3.75% due 04/01/51		277,632
U S D 1,360,000	Reinsurance Group of America, Inc. (b) 3.15% due 06/15/30		1,444,302
U S D 1,380,000	Reliance Standard Life Global Funding II (a) 2.75% due 05/07/25		1,446,203
U S D 750,000	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co.-Issuer, Inc. (a), (b) 3.88% due 03/01/31		756,563
U S D 890,000	Sabine Pass Liquefaction LLC (b) 4.50% due 05/15/30		1,024,841
U S D 450,000	Safehold Operating Partnership LP (b) 2.80% due 06/15/31		450,721
U S D 500,000	SBA Communications Corp. (b) 3.13% due 02/01/29		483,125
U S D 75,000	3.88% due 02/15/27		77,719
U S D 250,000	Scotts Miracle-Gro Co. (a), (b) 4.00% due 04/01/31		249,530
U S D 1,050,000	Sealed Air Corp. (a), (b) 1.57% due 10/15/26		1,043,577
U S D 150,000	Service Corp. International (b) 3.38% due 08/15/30		149,813
U S D 300,000	Sirius XM Radio, Inc. (a), (b) 4.13% due 07/01/30		301,391
U S D 150,000	Six Flags Theme Parks, Inc. (a), (b) 7.00% due 07/01/25		159,750
U S D 850,000	Smithfield Foods, Inc. (a), (b) 2.63% due 09/13/31		825,343

## ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 490,000	3.00% due 10/15/30 Snap-on, Inc. (b)		492,682
U S D 197,000	3.10% due 05/01/50 Square, Inc. (a), (b)		206,023
U S D 150,000	2.75% due 06/01/26 Standard Industries, Inc. (a), (b)		152,048
U S D 200,000	3.38% due 01/15/31		190,340
U S D 175,000	4.38% due 07/15/30		178,500
U S D 90,000	5.00% due 02/15/27 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp. (b)		92,813
U S D 250,000	5.88% due 03/01/27 Syneos Health, Inc. (a), (b)		260,625
U S D 100,000	3.63% due 01/15/29 SYNNEX Corp. (a), (b)		99,720
U S D 300,000	2.38% due 08/09/28		296,782
U S D 500,000	2.65% due 08/09/31 Sysco Corp. (b)		488,430
U S D 746,000	5.95% due 04/01/30 Tenet Healthcare Corp. (a), (b)		948,016
U S D 100,000	4.63% due 06/15/28 Textron, Inc. (b)		103,616
U S D 1,000,000	2.45% due 03/15/31		1,000,875
U S D 60,000	3.00% due 06/01/30 T-Mobile USA, Inc. (b)		62,983
U S D 1,000,000	2.55% due 02/15/31		1,002,438
U S D 100,000	2.88% due 02/15/31 TriNet Group, Inc. (a), (b)		100,850
U S D 350,000	3.50% due 03/01/29 Twilio, Inc. (b)		350,875
U S D 57,000	3.63% due 03/15/29 United Airlines, Inc. (a), (b)		58,311
U S D 600,000	4.38% due 04/15/26 United Wholesale Mortgage LLC (a), (b)		615,750
U S D 250,000	5.50% due 11/15/25		251,875
U S D 550,000	5.50% due 04/15/29 Universal Health Services, Inc. (a), (b)		533,997
U S D 800,000	2.65% due 10/15/30 University of Chicago (b)		803,632
U S D 150,000	2.76% due 04/01/45 US Foods, Inc. (a), (b)		152,652
U S D 148,000	4.75% due 02/15/29		151,885
U S D 350,000	6.25% due 04/15/25 Valero Energy Corp. (b)		367,133
U S D 850,000	2.15% due 09/15/27 ViacomCBS, Inc. (b)		855,502
U S D 1,085,000	4.95% due 01/15/31		1,294,763
U S D 510,000	4.95% due 05/19/50		637,065



元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 700,000	Vontier Corp. (a), (b) 2.95% due 04/01/31		695,597
U S D 140,000	W R Berkley Corp. (b) 4.00% due 05/12/50		160,862
U S D 283,000	Walgreens Boots Alliance, Inc. (b) 4.10% due 04/15/50		312,359
U S D 650,000	Wells Fargo & Co. (b), (c), (d) 3.90%		670,313
U S D 150,000	Western & Southern Life Insurance Co. (a), (b) 3.75% due 04/28/61		161,381
U S D 68,000	Weyerhaeuser Co. (b) 4.00% due 04/15/30		76,737
U S D 125,000	WMG Acquisition Corp. (a), (b) 3.00% due 02/15/31		122,031
U S D 1,000,000	Yale-New Haven Health Services Corp. (b) 2.50% due 07/01/50		924,496
U S D 400,000	Zayo Group Holdings, Inc. (a), (b) 4.00% due 03/01/27		398,092
U S D 460,000	Zimmer Biomet Holdings, Inc. (b) 3.55% due 03/20/30		502,623
	<b>社債合計</b>		<b>119,806,741</b>
	<b>国債 (22.1%)</b>		
U S D 1,400,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp. 2.70% due 01/30/45		1,474,431
U S D 100,000	2.88% due 10/01/40		109,033
U S D 1,500,000	Federal Home Loan Mortgage Corp. (e) 0.00% due 09/15/36		1,086,229
U S D 250,000	0.00% due 11/15/38		169,001
U S D 11,250,000	FNMA (j) 2.50% due 11/01/51		11,570,801
U S D 981,262	FNMA Pool 2.00% due 09/01/50		928,232
U S D 3,343,521	2.07% due 10/01/50		3,192,040
U S D 1,572,775	2.16% due 10/01/50		1,521,207
U S D 353,664	2.56% due 07/01/29		376,507
U S D 892,720	3.19% due 09/01/32		961,482
U S D 1,634,902	3.24% due 11/01/32		1,790,465
U S D 500,000	3.89% due 06/01/31		553,829
U S D 716,508	3.99% due 09/01/33		814,825
U S D 200,000	4.04% due 07/01/48		233,251
U S D 2,000,000	4.17% due 02/01/49		2,383,715
U S D 958,437	4.27% due 12/01/33		1,117,900
U S D 680,585	4.27% due 09/01/48		725,698
U S D 4,500,000	FNMA Principal Strip (e) 0.00% due 07/15/37		3,161,234
U S D 1,700,000	Tennessee Valley Authority 4.25% due 09/15/65		2,365,329

## ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
U S D 250,000	5.38% due 04/01/56 Tennessee Valley Authority Principal Strip (e)		400,639
U S D 400,000	0.00% due 09/15/39		252,902
U S D 450,000	0.00% due 01/15/48		223,422
U S D 4,750,000	0.00% due 09/15/60 U. S. Treasury Bond (g)		1,634,627
U S D 13,000,000	2.00% due 08/15/51 U. S. Treasury Note		12,737,969
U S D 5,000,000	0.75% due 08/31/26		4,944,141
U S D 27,400,000	1.25% due 08/15/31 (h), (i)		26,702,156
	<b>国債合計</b>		<b>81,431,065</b>
	<b>地方債 (2.0%)</b>		
U S D 1,000,000	Cypress School District (e) 0.00% due 08/01/48		406,424
U S D 1,000,000	Dallas Fort Worth International Airport 2.92% due 11/01/50		1,002,458
U S D 700,000	Health Care Authority for Baptist Health 5.50% due 11/15/43		911,644
U S D 950,000	Illinois State Finance Authority 6.29% due 07/01/33		1,187,908
U S D 1,000,000	Medical Center Educational Building Corp. (b) 2.92% due 06/01/41		988,492
U S D 400,000	Mississippi Development Bank (b) 6.50% due 10/01/31		401,246
U S D 350,000	Oklahoma Development Finance Authority 4.65% due 08/15/30		410,264
U S D 200,000	State of New York Mortgage Agency (b) 3.85% due 10/01/44		205,581
U S D 500,000	Westchester County Local Development Corp. (b) 3.85% due 11/01/50		524,676
U S D 2,665,000	Wylie Independent School District (b), (e) 0.00% due 08/15/43		1,217,281
	<b>地方債合計</b>		<b>7,255,974</b>
	<b>米国合計 (簿価 \$287,022,789)</b>		<b>290,991,718</b>
	<b>債券合計 (簿価 \$370,464,528)</b>		<b>374,070,103</b>
	<b>株数</b>		
	<b>優先株 (2.5%)</b>		
	<b>パミューダ (0.3%)</b>		
22,000	Arch Capital Group Ltd. (b), (d) 4.55%		576,400
16,000	RenaissanceRe Holdings Ltd. (b), (d) 4.20%		398,400
	<b>パミューダ合計 (簿価 \$950,000)</b>		<b>974,800</b>
	<b>米国 (2.2%)</b>		
43,252	American Financial Group, Inc. (b) 4.50% due 09/15/60		1,180,347

株数	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
8,400	Assurant, Inc. (b) 5.25% due 01/15/61		225,876
30,000	Bank of America Corp. (b), (d) 4.13%		771,300
24,000	4.38%		632,400
10,000	CNO Financial Group, Inc. 5.13% due 11/25/60		262,310
28,000	Equitable Holdings, Inc. (b), (d) 4.30%		700,000
26,000	First Republic Bank (b), (d) 4.13%		649,740
36,000	4.25%		903,600
16,000	JPMorgan Chase & Co. (b), (d) 4.63%		422,400
4,070	Public Storage (b), (d) 4.13%		106,227
23,076	4.63%		629,513
8,000	Selective Insurance Group, Inc. (b), (d) 4.60%		208,240
20,851	W R Berkley Corp. (b) 4.13% due 03/30/61		554,637
3,537	4.25% due 09/30/60		95,923
34,000	Wells Fargo & Co. (b), (d) 4.70%		893,520
	<b>米国合計 (簿価 \$7,879,650)</b>		<b>8,236,033</b>
	<b>優先株 (簿価 \$8,829,650)</b>		<b>9,210,833</b>
<b>契約数</b>			
	<b>金利キャップオプション (0.2%)</b>		
	<b>米国 (0.2%)</b>		
700,000	CMS Swap 2 Year, Put, Strike Price 0.395 Expiration date 07/29/22		3,969
111,300,000	CMS Swap 2 Year, Put, Strike Price 0.395 Expiration date 07/29/22		631,071
37,000,000	CMS Swap 2 Year, Put, Strike Price 0.605 Expiration date 07/29/22		146,520
	<b>米国合計</b>		<b>781,560</b>
	<b>金利キャップオプション合計 (支払プレミアム \$307,357)</b>		<b>781,560</b>
	<b>インデックスオプション (0.1%)</b>		
	<b>米国 (0.1%)</b>		
25	SPX Put, Strike Price 4340 Expiration date 11/19/21		328,250
	<b>米国合計</b>		<b>328,250</b>
	<b>インデックスオプション合計 (支払プレミアム \$307,375)</b>		<b>328,250</b>
<b>元本</b>			
	<b>短期投資 (6.9%)</b>		

# ダイワ債券コア戦略ファンド

元本	有価証券の明細	純資産に 占める割合	評価額
	ケイマン諸島 (0.0%) (k)		
	定期預金 (0.0%) (k)		
	Brown Brothers Harriman & Co.		
J P Y 85	-0.41% due 10/01/21		1
	定期預金合計		1
	ケイマン諸島合計 (簿価 \$1)		1
	スウェーデン (5.1%)		
	定期預金 (5.1%)		
	Skandinaviska Enskilda Banken		
U S D 18,730,171	0.01% due 10/01/21		18,730,171
	定期預金合計		18,730,171
	スウェーデン合計 (簿価 \$18,730,171)		18,730,171
	米国 (1.8%)		
	コマーシャル・ペーパー (1.8%)		
	Amphenol Corp. (a)		
U S D 3,300,000	0.08% due 10/01/21		3,300,000
	Societe Generale S. A. (a)		
U S D 3,300,000	0.04% due 10/01/21		3,300,000
	コマーシャル・ペーパー合計		6,600,000
	米国合計 (簿価 \$6,600,000)		6,600,000
	短期投資合計 (簿価 \$25,330,172)		25,330,172
	投資総額 (簿価 \$405,239,082)	111.2	\$ 409,720,918
	現金および他の資産を超過する負債	(11.2)	(41,404,891)
	純資産	100.0%	\$368,316,027

\* バンクローンは変動利付債務です。記載されているクーポンレートの期末時点のものです。

(a) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144A の下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、適格機関投資家に対することで登録せずに転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は非流動性資産とはみなされません。

(b) 期前償還条項付き証券

(c) 2021年9月30日時点レートでの変動金利証券

(d) 永久債

(e) ゼロクーポン債

(f) 当該残高の全てもしくは一部が期末時点における未決済の貸出予約を表しています。未決済の貸出予約のクーポンレートを含む詳細について、受渡日前に入手することはできません。

(g) この証券の776,049ドルは、中央清算されたスワップ取引のために、バンクオブアメリカとの非現金担保として保有されています。

(h) この有価証券の全部または一部は、2021年9月30日時点において、買い現先取引の相手方との担保として差し入れられています。

(i) この有価証券の全部または一部は、2021年9月30日時点において、外国為替先渡取引の相手方との担保として差し入れられています。

(j) TBA 証券を指します。元本の近似値と満期日をもとに先渡ベースで取引されています。

(k) 比率は、純資産の0.05%未満です。

インデックスオプション取引の売建 2021年9月30日現在 (純資産の-0.0%)

取引相手	証券の明細	満期日	通貨	想定元本	支払(受取) プレミアム	評価額
Citibank N. A.	CBOE, Put, Strike Price 3980	11/19/2021	U S D	(25)	\$ (144, 135)	\$ (103, 025)
					\$ (144, 135)	\$ (103, 025)

ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンドの外国為替先渡取引 2021年9月30日現在 (純資産の0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
I L S	Goldman Sachs Group, Inc.	100, 250	11/30/2021	U S D	26, 733	\$ 4, 358	\$ -	\$ 4, 358
I L S	Goldman Sachs Group, Inc.	8, 120, 250	11/30/2022	U S D	2, 172, 352	362, 231	-	362, 231
J P Y	Barclays Bank PLC	101, 050, 500	12/20/2021	U S D	963, 211	-	(56, 843)	(56, 843)
J P Y	Morgan Stanley Capital Service	7, 734	12/20/2021	U S D	74	-	(5)	(5)
U S D	Bank of America N. A.	910, 861	10/18/2021	G B P	660, 000	20, 935	-	20, 935
U S D	MorganStanley Capital Service	118, 115	10/18/2021	E U R	100, 000	2, 188	-	2, 188
U S D	Goldman Sachs Group, Inc.	29, 923	11/30/2021	I L S	100, 250	-	(1, 168)	(1, 168)
U S D	Goldman Sachs Group, Inc.	998, 424	12/20/2021	J P Y	101, 050, 500	92, 056	-	92, 056
U S D	JP Morgan Chase N. A.	73	12/20/2021	J P Y	7, 734	3	-	3
U S D	Goldman Sachs Group, Inc.	2, 462, 921	11/30/2022	I L S	8, 120, 250	-	(71, 662)	(71, 662)
						\$ 481, 771	\$ (129, 678)	\$ 352, 093

豪ドル・クラスの外国為替先渡取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
A U D	Citibank N. A.	11, 918, 288	10/13/2021	U S D	8, 823, 544	\$ -	\$ (214, 054)	\$ (214, 054)
U S D	Citibank N. A.	1, 401, 745	10/13/2021	A U D	1, 897, 176	31, 270	-	31, 270
						\$ 31, 270	\$ (214, 054)	\$ (182, 784)

円ヘッジ・クラスの外国為替先渡取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
J P Y	Citibank N. A.	2, 589, 161, 597	10/13/2021	U S D	23, 527, 140	\$ -	\$ (320, 099)	\$ (320, 099)
U S D	Citibank N. A.	411, 292	10/13/2021	J P Y	45, 647, 410	2, 148	-	2, 148
U S D	Citibank N. A.	298, 156	10/13/2021	J P Y	33, 262, 903	16	-	16
						\$ 2, 164	\$ (320, 099)	\$ (317, 935)

NZ ドル・クラスの外国為替先渡取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
N Z D	Citibank N. A.	5, 885, 432	10/13/2021	U S D	4, 192, 118	\$ -	\$ (132, 225)	\$ (132, 225)
N Z D	Citibank N. A.	70, 095	10/13/2021	U S D	49, 773	-	(1, 420)	(1, 420)
U S D	Citibank N. A.	278, 264	10/13/2021	N Z D	394, 031	6, 452	-	6, 452
U S D	Citibank N. A.	47, 335	10/13/2021	N Z D	68, 796	-	(122)	(122)
						\$ 6, 452	\$ (133, 767)	\$ (127, 315)

## ダイワ債券コア戦略ファンド

トルコ・リラ・クラスの外国為替先渡取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.2%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
T R Y	Citibank N. A.	47,033	10/13/2021	U S D	5,446	\$ -	\$ (176)	\$ (176)
T R Y	Citibank N. A.	112,264,324	10/13/2021	U S D	13,228,543	-	(650,232)	(650,232)
T R Y	Citibank N. A.	2,309,413	10/13/2021	U S D	272,075	-	(13,324)	(13,324)
T R Y	Citibank N. A.	127,593	10/13/2021	U S D	14,826	-	(530)	(530)
T R Y	Citibank N. A.	388,775	10/13/2021	U S D	45,457	-	(1,898)	(1,898)
T R Y	Citibank N. A.	186,102	10/13/2021	U S D	21,745	-	(893)	(893)
T R Y	Citibank N. A.	244,869	10/13/2021	U S D	28,647	-	(1,211)	(1,211)
U S D	Citibank N. A.	1,099,215	10/13/2021	T R Y	9,476,822	37,414	-	37,414
U S D	Citibank N. A.	15,259	10/13/2021	T R Y	130,784	606	-	606
						\$ 38,020	\$ (668,264)	\$ (630,244)

南アフリカ・ランド・クラスの外国為替先渡取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
U S D	Citibank N. A.	133,947	10/13/2021	Z A R	1,919,787	\$ 6,511	\$ -	\$ 6,511
Z A R	Citibank N. A.	94,035,818	10/13/2021	U S D	6,546,317	-	(304,195)	(304,195)
Z A R	Citibank N. A.	618,942	10/13/2021	U S D	43,144	-	(2,058)	(2,058)
Z A R	Citibank N. A.	780,026	10/13/2021	U S D	53,874	-	(2,096)	(2,096)
						\$ 6,511	\$ (308,349)	\$ (301,838)

中央清算される金利スワップ取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.3%)

通貨	取引相手	想定元本	変動金利	固定金利 受取(支払)	終了日	支払(受取) プレミアム	評価益(損)	評価額
U S D	Bank of America N. A.	4,000,000	3-Month USD-LIBOR	(1.976%)	05/28/2051	\$ (59,064)	\$ (103,510)	\$ (162,574)
U S D	BNP Paribas S. A.	3,000,000	1 Day Overnight Federal Funds Effective Rate	0.150%	08/17/2025	314	(62,405)	(62,091)
U S D	Citibank N. A.	5,000,000	1 Day Overnight Federal Funds Effective Rate	0.683%	11/03/2030	340	(224,704)	(224,364)
U S D	Wells Fargo & Co.	7,500,000	1 Day Overnight Federal Funds Effective Rate	0.762%	12/04/2030	360	(289,642)	(289,282)
U S D	Wells Fargo & Co.	7,500,000	1 Day Overnight Federal Funds Effective Rate	0.757%	01/05/2031	361	(304,280)	(303,919)
						\$ (57,689)	\$ (984,541)	\$ (1,042,230)

中央清算されるクレジット・デフォルト・インデックス・スワップ取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-0.0%)

通貨	取引相手	想定元本	プロテクション	参照対象	固定金利 受取(支払)	終了日	支払(受取) プレミアム	評価益(損)	評価額
USD	Bank of America NA	3,650,000	Buy protection	Markit CDX North America	(5.000%)	06/20/2026	\$ (344,573)	\$ 2,698	\$ (341,875)
							<b>\$ (344,573)</b>	<b>\$ 2,698</b>	<b>\$ (341,875)</b>

信用売り 2021年9月30日現在 (純資産の-3.2%)

証券の明細	元本	通貨	金利	満期日	売却代金	評価額
FNCL	(11,250,000)	USD	3.50%	11/01/2051	\$ (11,923,386)	(11,911,157)
					<b>\$ (11,923,386)</b>	<b>\$ (11,911,157)</b>

買い現先取引残高 2021年9月30日現在 (純資産の-5.3%)

取引相手	元本	通貨	利率	受渡日	満期日	借入金額	未払 買い現先取引
Bank of America N. A.	(9,762,500)	USD	0.06%	9/30/2021	10/1/2021	\$ (9,762,500)	\$ (9,763,034)
JP Morgan Chase N. A.	(9,763,000)	USD	0.09%	9/30/2021	10/1/2021	(9,763,000)	(9,763,024)
						<b>\$ (19,525,500)</b>	<b>\$ (19,526,058)</b>

通貨の略称

AUD - 豪ドル  
 EUR - ユーロ  
 GBP - 英ポンド  
 ILS - イスラエル・シケル  
 JPY - 日本円  
 NZD - ニュージーランド・ドル  
 TRY - トルコ・リラ  
 USD - 米ドル  
 ZAR - 南アフリカ・ランド

## ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり／為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2021年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年3月7日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

2021年9月8日～2022年3月7日における主要な売買銘柄はありません。

### ■組入資産明細表

2022年3月7日現在、有価証券等の組み入れはありません。



# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## 運用報告書 第10期 (決算日 2021年12月9日)

(作成対象期間 2020年12月10日～2021年12月9日)

ダイワ・マネーアセット・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をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

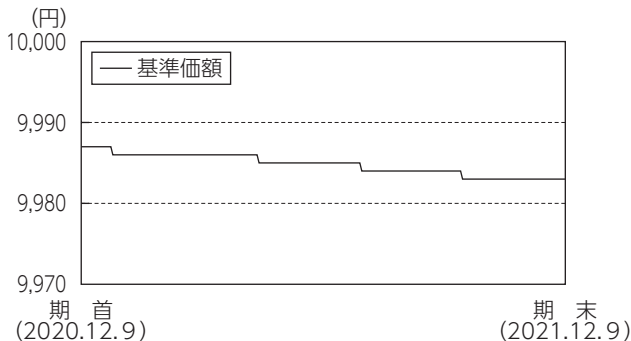
## 大和アセットマネジメント

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/>

# ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## ■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
	騰 落 率	騰 落 率	
	円	%	%
(期首)2020年12月9日	9,987	-	-
12月末	9,987	0.0	-
2021年1月末	9,986	△0.0	-
2月末	9,986	△0.0	-
3月末	9,986	△0.0	-
4月末	9,985	△0.0	-
5月末	9,985	△0.0	-
6月末	9,985	△0.0	-
7月末	9,984	△0.0	-
8月末	9,984	△0.0	-
9月末	9,983	△0.0	-
10月末	9,983	△0.0	-
11月末	9,983	△0.0	-
(期末)2021年12月9日	9,983	△0.0	-

(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）および債券先物を除きます。

(注3) 当ファンドは、安定した収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

### 《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：9,987円 期末：9,983円 騰落率：△0.0%

##### 【基準価額の主な変動要因】

コール・ローン等の利回りがマイナス圏で推移したことなどから、基準価額は下落しました。

#### ◆投資環境について

##### ○国内短期金融市況

当作成期を通じて、日銀は長短金利操作付き量的・質的金融緩和を維持しました。この金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

#### ◆前作成期末における「今後の運用方針」

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

#### ◆ポートフォリオについて

流動性や資産の安全性に配慮し、コール・ローン等による運用を行いました。

#### ◆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》

流動性や資産の安全性に配慮し、短期の国債やコール・ローン等による運用を行う方針です。

## ■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 (その他)	0 (0)
合 計	0

(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

当作成期中における売買および取引はありません。

## ■主要な売買銘柄

当作成期中における主要な売買銘柄はありません。

## ■組入資産明細表

当作成期末における有価証券等の組み入れはありません。

## ■投資信託財産の構成

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	602,175	100.0
投資信託財産総額	602,175	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	602,175,326円
コール・ローン等	602,175,326
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	602,175,326
元本	603,229,011
次期繰越損益金	△ 1,053,685
(D) 受益権総口数	603,229,011口
1万口当り基準価額(C / D)	9,983円

\* 当首における元本額は563,730,093円、当作成期間中における追加設定元本額は181,060,125円、同解約元本額は141,561,207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：

ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり)	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし)	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (毎月分配型)	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (年2回決算型)	24,953円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型)	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型)	66,873円
ダイワ米国株主還元株ファンド	36,730,213円
ダイワD Bモメンタム戦略ファンド (為替ヘッジあり)	6,592,748円
ダイワD Bモメンタム戦略ファンド (為替ヘッジなし)	10,288,683円
ダイワ/バリュー・パートナーズ・チャイナ・イノベーター・ファンド	10,000円
世界M&A戦略株ファンド	1,001,302円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	487円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	4,995円
ダイワ・ブラジル・レアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α50コース	49,911円
ダイワ・ブラジル・レアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α100コース	49,911円
S & P 500 (マルチアイ搭載)	60,069,073円
ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ	4,473,311円
ダイワ円債セレクト マネーコース	479,794,114円
ダイワ・スイス高配当株ツインα (毎月分配型)	2,996,106円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型)	1,235円
ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型)	1,598円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース (毎月分配型)	1,544円
通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース (毎月分配型)	1,984円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,983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1,053,685円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月10日 至2021年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 273,658円
受取利息	5,799
支払利息	△ 279,457
(B) その他費用	△ 1,940
(C) 当期損益金(A + B)	△ 275,598
(D) 前期繰越損益金	△ 746,310
(E) 解約差損益金	234,610
(F) 追加信託差損益金	△ 266,387
(G) 合計(C + D + E + F)	△1,053,685
次期繰越損益金(G)	△1,053,685

(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。