

ダイワ高格付カナダドル債オープン・
為替アクティブヘッジ
(毎月分配型)

運用報告書（全体版）

第112期（決算日 2023年12月11日）
第113期（決算日 2024年 1 月10日）
第114期（決算日 2024年 2 月13日）
第115期（決算日 2024年 3 月11日）
第116期（決算日 2024年 4 月10日）
満期償還（償還日 2024年 5 月10日）

(作成対象期間 2023年11月11日～2024年5月10日)

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するとともに、為替アクティブヘッジを行ない、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、信託期間中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、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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した。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	2014年7月9日～2024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、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、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。	

最近30期の運用実績

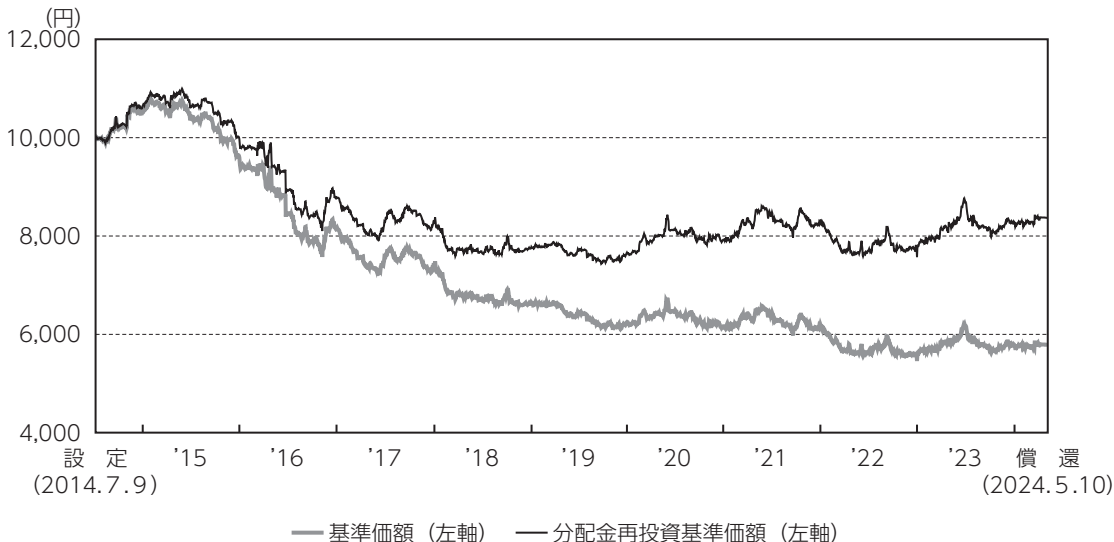
決 算 期	基 準 価 額			F T S E カナダ国債 インデックス (円換算)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
88 期末(2021年12月10日)	6,108	15	△1.7	11,035	△0.9	97.9	－	84
89 期末(2022年 1 月11日)	6,100	15	0.1	11,132	0.9	98.6	－	84
90 期末(2022年 2 月10日)	5,938	15	△2.4	11,024	△1.0	98.7	－	82
91 期末(2022年 3 月10日)	5,814	15	△1.8	10,922	△0.9	97.4	－	77
92 期末(2022年 4 月11日)	5,664	15	△2.3	11,432	4.7	97.6	－	75
93 期末(2022年 5 月10日)	5,603	15	△0.8	11,258	△1.5	96.7	－	74
94 期末(2022年 6 月10日)	5,715	15	2.3	11,741	4.3	98.3	－	76
95 期末(2022年 7 月11日)	5,603	15	△1.7	11,700	△0.3	97.4	－	74
96 期末(2022年 8 月10日)	5,761	15	3.1	12,035	2.9	94.9	－	79
97 期末(2022年 9 月12日)	5,932	15	3.2	12,286	2.1	95.5	－	81
98 期末(2022年10月11日)	5,595	15	△5.4	11,695	△4.8	96.6	－	77
99 期末(2022年11月10日)	5,593	15	0.2	11,911	1.8	97.5	－	76
100期末(2022年12月12日)	5,585	15	0.1	11,485	△3.6	92.0	－	70
101期末(2023年 1 月10日)	5,615	15	0.8	11,149	△2.9	96.8	－	68
102期末(2023年 2 月10日)	5,642	15	0.7	11,122	△0.2	96.1	－	71
103期末(2023年 3 月10日)	5,628	15	0.0	11,170	0.4	96.2	－	71
104期末(2023年 4 月10日)	5,791	15	3.2	11,409	2.1	95.7	－	72
105期末(2023年 5 月10日)	5,844	15	1.2	11,616	1.8	97.6	－	72
106期末(2023年 6 月12日)	5,931	15	1.7	11,752	1.2	98.0	－	69
107期末(2023年 7 月10日)	5,979	15	1.1	11,960	1.8	98.1	－	67
108期末(2023年 8 月10日)	5,849	15	△1.9	12,014	0.5	98.2	－	66
109期末(2023年 9 月11日)	5,759	15	△1.3	12,022	0.1	98.2	－	59
110期末(2023年10月10日)	5,664	15	△1.4	11,919	△0.9	96.7	－	58
111期末(2023年11月10日)	5,711	15	1.1	12,205	2.4	97.1	－	56
112期末(2023年12月11日)	5,820	15	2.2	12,334	1.1	96.3	－	52
113期末(2024年 1 月10日)	5,718	15	△1.5	12,588	2.1	99.0	－	50
114期末(2024年 2 月13日)	5,736	15	0.6	12,694	0.8	97.2	－	50
115期末(2024年 3 月11日)	5,749	15	0.5	12,669	△0.2	95.3	－	45
116期末(2024年 4 月10日)	5,794	15	1.0	12,876	1.6	95.8	－	46
償 還(2024年 5 月10日)	5,787.11	－	△0.1	13,087	1.6	－	－	43

(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



* 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

設定時：10,000円

償還時：5,787円11銭（既払分配金2,600円）

騰落率：△16.3%（分配金再投資ベース）

■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、カナダ・ドルは上昇（円安）したものの、金利が上昇（債券価格は下落）したことや為替ヘッジコストなどの要因により、基準価額は下落しました。当ファンドでは、市場全体のリスクの高まりや金利変動等を定量的に捉え、随時為替ヘッジを行いましたが、カナダ・ドルが上昇した局面においてもヘッジをかけており、基準価額の上昇要因を十分に捉えることができませんでした。くわしくは「設定以来の投資環境について」をご参照ください。

ダイワ高格付カナダドル債オープン・為替アクティブヘッジ（毎月分配型）

	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 券 率
			騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
第112期	(期首) 2023年11月10日	円 5,711	% －	12,205	% －	% 97.1	% －
	11月末	5,811	1.8	12,343	1.1	95.9	－
	(期末) 2023年12月11日	5,835	2.2	12,334	1.1	96.3	－
第113期	(期首) 2023年12月11日	5,820	－	12,334	－	96.3	－
	12月末	5,788	△0.5	12,574	1.9	98.1	－
	(期末) 2024年 1 月10日	5,733	△1.5	12,588	2.1	99.0	－
第114期	(期首) 2024年 1 月10日	5,718	－	12,588	－	99.0	－
	1 月末	5,793	1.3	12,683	0.8	97.7	－
	(期末) 2024年 2 月13日	5,751	0.6	12,694	0.8	97.2	－
第115期	(期首) 2024年 2 月13日	5,736	－	12,694	－	97.2	－
	2 月末	5,734	△0.0	12,730	0.3	96.6	－
	(期末) 2024年 3 月11日	5,764	0.5	12,669	△0.2	95.3	－
第116期	(期首) 2024年 3 月11日	5,749	－	12,669	－	95.3	－
	3 月末	5,820	1.2	12,924	2.0	96.5	－
	(期末) 2024年 4 月10日	5,809	1.0	12,876	1.6	95.8	－
償 還 期	(期首) 2024年 4 月10日	5,794	－	12,876	－	95.8	－
	4 月末	5,790	△0.1	13,074	1.5	－	－
	(償還) 2024年 5 月10日	5,787.11	△0.1	13,087	1.6	－	－

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2014.7.9～2024.5.10)

■カナダ債券市況

カナダ債券市場の金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当ファンド設定日から2016年9月にかけて、世界的な経済見通しの鈍化に加え、原油価格の下落によるインフレ圧力の低下などを受けて、金利は低下（債券価格は上昇）しました。2016年10月から2018年10月にかけては、カナダの経済指標が堅調な結果となったことや、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、米国景気に対する楽観的な見方が広がったことなどから米国の金利が大きく上昇し、カナダの金利もそれに連れて上昇しました。11月から2020年7月にかけては、原油価格が下落したことに加え、各地での新型コロナウイルスの感染拡大や米中間での緊張感の高まりなどから、市場のリスク回避姿勢が強まり、金利は低下しました。8月以降は、新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことや、世界的にインフレ懸念が高まったこと、米国で金融引き締め観測が強まり米国金利が上昇したことなどの要因により、金利は上昇しました。

■為替相場

カナダ・ドルの対円為替レートは上昇（円安）しました。

当ファンド設定日から2016年9月にかけては、中国の景気減速懸念が高まったことや、原油価格の下落により、カナダ・ドルは対円で下落（円高）しました。10月から2017年12月にかけては、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利し、市場のリスク選好度が強まったことなどから、カナダ・ドルは対円で上昇しました。2018年1月から2020年3月にかけては、米中貿易摩擦への懸念が高まったことや新型コロナウイルスの感染拡大を背景に、市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、カナダ・ドルは対円で下落しました。4月以降は、各国の財政・金融政策が評価されたことも含めて新型コロナウイルスに対する懸念が後退したことや、インフレ率の上振れなどからカナダの金利が上昇したこと、緩和政策を続ける日本との金利差が拡大して円安が進行したことなどから、カナダ・ドルは対円で大きく上昇しました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」を高位に組み入れます。また、市場全体のリスクの高まりや金利変動などを定量的に捉えて、為替アクティブヘッジ戦略を行います。

■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す。

信託期間中のポートフォリオについて

(2014.7.9～2024.5.10)

■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。また、市場全体のリスクの高まりや金利変動などを定量的に捉えて、為替アクティブヘッジ戦略を行いました。

■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

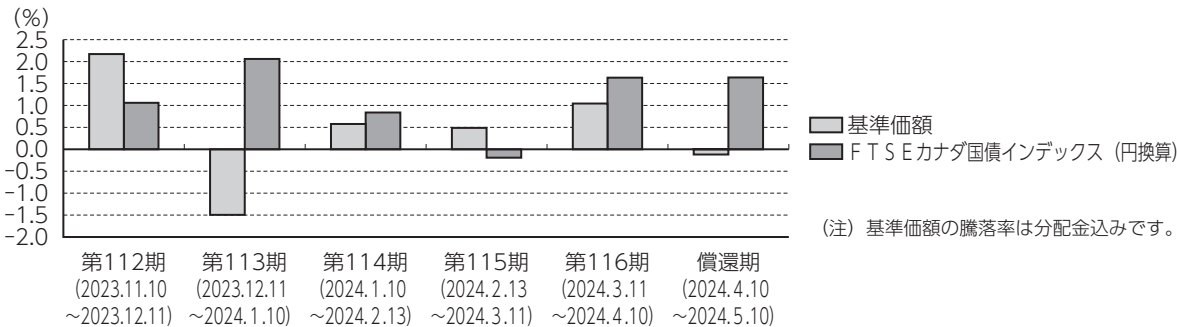
カナダ・ドル建ての公社債等を高位に組み入れ、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。金利変動リスクを表す修正デュレーションについては、3（年）程度から5（年）程度の範囲内で運用しました。

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。
以下のグラフは、当作成期における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。



分配金について

1万口当り、第1期～第86期各25円、第87期～第116期各15円の収益分配を行いました。

また、第112期～第116期の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。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した。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
	2023年11月11日 ～2023年12月11日	2023年12月12日 ～2024年1月10日	2024年1月11日 ～2024年2月13日	2024年2月14日 ～2024年3月11日	2024年3月12日 ～2024年4月10日
当期分配金（税込み）（円）	15	15	15	15	15
対基準価額比率（％）	0.26	0.26	0.26	0.26	0.26
当期の収益（円）	12	6	12	9	12
当期の収益以外（円）	2	8	2	5	2
翌期繰越分配対象額（円）	246	237	234	229	227

（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却等損益」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。

（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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第112期	第113期	第114期	第115期	第116期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 12.58円	✓ 6.01円	✓ 12.10円	✓ 9.86円	✓ 12.25円
(b) 経費控除後の有価証券売却等損益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	✓ 249.22	✓ 246.81	✓ 237.84	✓ 234.95	✓ 229.83
(d) 分配準備積立金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	261.80	252.83	249.95	244.82	242.08
(f) 分配金	15.00	15.00	15.00	15.00	15.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	246.80	237.83	234.95	229.82	227.08

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第112期～償還期 (2023.11.11～2024.5.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	43円	0.752%	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5,773円です。
（投 信 会 社）	(19)	(0.335)	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）	(23)	(0.390)	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）	(2)	(0.027)	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	0.021	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)	(0.009)	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
（そ の 他）	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	45	0.772	

(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。

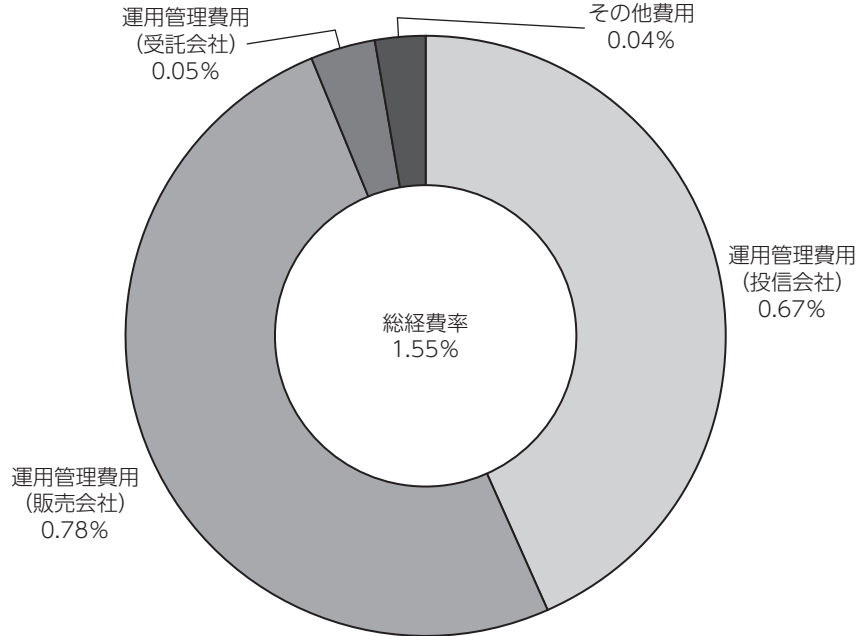
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.55%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。

■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11月11日から2024年5月10日まで)

決 算 期	第 112 期 ～ 償 還 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ高格付カナダドル債 マザーファンド	－	－	23,719	58,325

(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

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

親投資信託残高

種 類	第 111 期 末
	□ 数
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	千□ 23,719

(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	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	43,384	100.0
投資信託財産総額	43,384	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

(2023年12月11日)、(2024年1月10日)、(2024年2月13日)、(2024年3月11日)、(2024年4月10日)、(2024年5月10日)現在

項 目	第 112 期 末	第 113 期 末	第 114 期 末	第 115 期 末	第 116 期 末	償 還 時
(A) 資産	106,389,169円	51,803,876円	50,764,298円	89,563,324円	46,356,258円	43,384,206円
コール・ローン等	935,366	1,030,096	1,025,328	922,270	1,020,857	43,383,915
ダイワ高格付カナダドル債 マザーファンド(評価額)	51,448,261	50,773,780	49,738,970	44,316,669	45,335,401	－
未収入金	54,005,542	－	－	44,324,385	－	－
未収利息	－	－	－	－	－	291
(B) 負債	53,548,638	1,265,597	694,561	43,971,481	295,798	56,166
未払金	52,546,027	824,101	493,757	43,796,755	120,556	－
未払収益分配金	136,191	132,583	130,927	118,950	119,240	－
未払解約金	797,952	245,988	－	3,921	－	－
未払信託報酬	68,468	62,925	69,877	51,855	56,002	56,166
(C) 純資産総額(A－B)	52,840,531	50,538,279	50,069,737	45,591,843	46,060,460	43,328,040
元本	90,794,155	88,389,132	87,285,272	79,300,062	79,493,806	74,869,868
次期繰越損益金	△ 37,953,624	△37,850,853	△37,215,535	△33,708,219	△33,433,346	－
償還差損益金	－	－	－	－	－	△31,541,828
(D) 受益権総口数	90,794,155□	88,389,132□	87,285,272□	79,300,062□	79,493,806□	74,869,868□
1万口当り基準価額(C/D)	5,820円	5,718円	5,736円	5,749円	5,794円	－
1万口当り償還価額(C/D)	－	－	－	－	－	5,787円11銭

* 当作成期首における元本額は98,322,025円、当作成期間（第112期～償還期）中における追加設定元本額は1,477,003円、同解約元本額は24,929,160円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は5,787円11銭です。

* 償還時の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は31,541,828円です。

ダイワ高格付カナダドル債オープン・為替アクティブヘッジ（毎月分配型）

■損益の状況

第112期	自2023年11月11日	至2023年12月11日	第115期	自2024年2月14日	至2024年3月11日
第113期	自2023年12月12日	至2024年1月10日	第116期	自2024年3月12日	至2024年4月10日
第114期	自2024年1月11日	至2024年2月13日	償還期	自2024年4月11日	至2024年5月10日

項 目	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期	償 還 期
(A) 配当等収益	－円	－円	－円	－円	30円	2,768円
受取利息	－	－	－	－	30	2,768
(B) 有価証券売買損益	1,191,118	△ 705,647	363,458	274,681	532,410	1,452
売買益	1,778,853	2,096,630	865,190	687,247	1,304,164	－
売買損	△ 587,735	△ 2,802,277	△ 501,732	△ 412,566	△ 771,754	1,452
(C) 信託報酬等	△ 69,696	△ 63,728	△ 70,464	△ 53,079	△ 56,400	△ 57,388
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,121,422	△ 769,375	292,994	221,602	476,040	△ 53,168
(E) 前期繰越損益金	△26,750,061	△24,999,591	△25,441,004	△22,887,947	△22,742,641	△21,042,956
(F) 追加信託差損益金	△12,188,794	△11,949,304	△11,936,598	△10,922,924	△11,047,505	△10,445,704
(配当等相当額)	(2,262,841)	(2,181,588)	(2,076,032)	(1,863,223)	(1,827,051)	(1,700,210)
(売買損益相当額)	(△14,451,635)	(△14,130,892)	(△14,012,630)	(△12,786,147)	(△12,874,556)	(△12,145,914)
(G) 合計(D+E+F)	△37,817,433	△37,718,270	△37,084,608	△33,589,269	△33,314,106	△31,541,828
(H) 収益分配金	△ 136,191	△ 132,583	△ 130,927	△ 118,950	△ 119,240	－
次期繰越損益金(G+H)	△37,953,624	△37,850,853	△37,215,535	△33,708,219	△33,433,346	－
追加信託差損益金	△12,210,758	△12,028,680	△11,961,848	△10,963,625	△11,069,343	－
(配当等相当額)	(2,240,877)	(2,102,212)	(2,050,782)	(1,822,522)	(1,805,213)	(ー)
(売買損益相当額)	(△14,451,635)	(△14,130,892)	(△14,012,630)	(△12,786,147)	(△12,874,556)	(ー)
繰越損益金	△25,742,866	△25,822,173	△25,253,687	△22,744,594	△22,364,003	－
償還差損益金(G)	－	－	－	－	－	△31,541,828

(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) 第112期～第116期の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。
(注4) 投資信託財産の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：24,455円

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
(a) 経費控除後の配当等収益	114,227円	53,207円	105,677円	78,249円	97,402円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	2,262,841	2,181,588	2,076,032	1,863,223	1,827,051
(d) 分配準備積立金	0	0	0	0	0
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,377,068	2,234,795	2,181,709	1,941,472	1,924,453
(f) 分配金	136,191	132,583	130,927	118,950	119,240
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	2,240,877	2,102,212	2,050,782	1,822,522	1,805,213
(h) 受益権総口数	90,794,155□	88,389,132□	87,285,272□	79,300,062□	79,493,806□

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年7月9日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2024年5月10日		資産総額	43,384,206円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減又は追加信託	負債総額	56,166円
				純資産総額	43,328,040円
受益権口数	10,000,000口	74,869,868口	64,869,868口	受益権口数	74,869,868口
元本額	10,000,000円	74,869,868円	64,869,868円	1単位当り償還金	5,787円11銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	206,520,249	209,706,875	10,154	25	0.25
第2期	221,204,572	225,678,686	10,202	25	0.25
第3期	240,197,458	250,791,219	10,441	25	0.25
第4期	285,888,636	300,433,369	10,509	25	0.25
第5期	428,117,140	452,400,901	10,567	25	0.25
第6期	479,407,027	512,933,931	10,699	25	0.25
第7期	498,746,607	531,366,324	10,654	25	0.25
第8期	524,644,837	547,718,369	10,440	25	0.25
第9期	536,963,072	570,905,825	10,632	25	0.25
第10期	543,179,210	577,393,684	10,630	25	0.25
第11期	539,607,615	559,996,595	10,378	25	0.25
第12期	535,423,560	554,112,423	10,349	25	0.25
第13期	521,944,539	541,647,476	10,377	25	0.25
第14期	506,876,343	513,073,580	10,122	25	0.25
第15期	493,289,597	491,312,702	9,960	25	0.25
第16期	486,619,331	480,407,116	9,872	25	0.25
第17期	487,868,902	458,051,920	9,389	25	0.25
第18期	479,102,797	450,819,681	9,410	25	0.25
第19期	478,314,480	447,541,190	9,357	25	0.25
第20期	423,738,170	380,902,552	8,989	25	0.25
第21期	420,716,343	376,315,947	8,945	25	0.25
第22期	425,609,150	374,740,679	8,805	25	0.25
第23期	410,459,654	346,673,880	8,446	25	0.25
第24期	401,110,778	323,031,614	8,053	25	0.25
第25期	399,932,025	319,347,639	7,985	25	0.25

ダイワ高格付カナダドル債オープン・為替アクティブヘッジ（毎月分配型）

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第26期	399,790,627	316,273,959	7,911	25	0.25
第27期	395,907,761	304,909,524	7,702	25	0.25
第28期	315,408,496	261,686,539	8,297	25	0.25
第29期	314,947,108	256,049,940	8,130	25	0.25
第30期	302,867,770	239,576,606	7,910	25	0.25
第31期	297,646,939	228,641,772	7,682	25	0.25
第32期	293,715,293	221,494,250	7,541	25	0.25
第33期	291,645,344	216,386,348	7,420	25	0.25
第34期	286,971,487	208,165,758	7,254	25	0.25
第35期	283,862,679	218,401,740	7,694	25	0.25
第36期	255,299,442	191,490,199	7,501	25	0.25
第37期	250,661,315	191,127,630	7,625	25	0.25
第38期	248,553,850	189,450,460	7,622	25	0.25
第39期	251,691,430	190,152,660	7,555	25	0.25
第40期	241,961,605	177,225,756	7,325	25	0.25
第41期	239,634,742	176,626,352	7,371	25	0.25
第42期	241,245,373	169,204,252	7,014	25	0.25
第43期	238,429,123	163,341,005	6,851	25	0.25
第44期	236,519,493	160,910,325	6,803	25	0.25
第45期	233,815,872	158,704,770	6,788	25	0.25
第46期	233,971,605	157,388,572	6,727	25	0.25
第47期	230,866,207	154,678,567	6,700	25	0.25
第48期	223,132,846	149,186,534	6,686	25	0.25
第49期	219,167,533	144,289,084	6,584	25	0.25
第50期	217,624,847	146,956,843	6,753	25	0.25
第51期	213,653,547	141,319,101	6,614	25	0.25
第52期	208,467,232	137,951,010	6,617	25	0.25
第53期	208,051,207	137,304,246	6,600	25	0.25
第54期	207,334,925	136,667,026	6,592	25	0.25
第55期	207,572,496	136,980,116	6,599	25	0.25
第56期	202,899,279	133,171,222	6,563	25	0.25
第57期	203,745,209	131,998,017	6,479	25	0.25
第58期	200,619,856	128,177,880	6,389	25	0.25
第59期	201,299,137	129,402,254	6,428	25	0.25

ダイワ高格付カナダドル債オープン・為替アクティブヘッジ（毎月分配型）

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当たり分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第60期	202,756,612	127,973,656	6,312	25	0.25
第61期	203,215,875	126,205,764	6,210	25	0.25
第62期	199,276,050	122,559,946	6,150	25	0.25
第63期	194,635,008	119,258,123	6,127	25	0.25
第64期	191,004,515	116,769,251	6,113	25	0.25
第65期	172,291,445	106,953,673	6,208	25	0.25
第66期	171,173,244	105,965,006	6,191	25	0.25
第67期	170,704,919	110,682,506	6,484	25	0.25
第68期	170,736,435	108,392,463	6,349	25	0.25
第69期	170,857,854	109,523,849	6,410	25	0.25
第70期	169,261,762	112,427,099	6,642	25	0.25
第71期	168,674,062	107,783,443	6,390	25	0.25
第72期	165,688,801	104,872,353	6,329	25	0.25
第73期	166,099,679	105,680,925	6,363	25	0.25
第74期	166,410,612	103,962,201	6,247	25	0.25
第75期	167,140,498	104,792,577	6,270	25	0.25
第76期	160,342,456	99,898,680	6,230	25	0.25
第77期	153,538,958	94,150,981	6,132	25	0.25
第78期	151,745,695	93,311,395	6,149	25	0.25
第79期	143,532,250	90,178,857	6,283	25	0.25
第80期	143,216,789	90,931,651	6,349	25	0.25
第81期	144,008,608	93,542,249	6,496	25	0.25
第82期	141,580,111	92,075,633	6,503	25	0.25
第83期	142,173,757	89,703,398	6,309	25	0.25
第84期	142,490,144	88,842,139	6,235	25	0.25
第85期	139,919,911	85,776,907	6,130	25	0.25
第86期	138,821,064	86,429,961	6,226	25	0.25
第87期	139,171,787	86,705,089	6,230	15	0.15
第88期	138,823,394	84,789,968	6,108	15	0.15
第89期	138,836,907	84,693,274	6,100	15	0.15
第90期	138,839,704	82,439,935	5,938	15	0.15
第91期	133,202,340	77,448,116	5,814	15	0.15
第92期	133,178,486	75,429,035	5,664	15	0.15
第93期	133,285,784	74,685,728	5,603	15	0.15

ダイワ高格付カナダドル債オープン・為替アクティブヘッジ（毎月分配型）

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1 単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第94期	133,306,609	76,181,640	5,715	15	0.15
第95期	133,461,439	74,783,364	5,603	15	0.15
第96期	138,791,825	79,954,667	5,761	15	0.15
第97期	137,768,235	81,726,404	5,932	15	0.15
第98期	138,087,865	77,264,817	5,595	15	0.15
第99期	136,756,326	76,491,824	5,593	15	0.15
第100期	126,261,593	70,516,959	5,585	15	0.15
第101期	121,322,479	68,127,221	5,615	15	0.15
第102期	126,848,343	71,570,115	5,642	15	0.15
第103期	126,182,890	71,017,260	5,628	15	0.15
第104期	125,232,090	72,527,666	5,791	15	0.15
第105期	124,133,983	72,546,611	5,844	15	0.15
第106期	117,153,419	69,480,262	5,931	15	0.15
第107期	113,310,368	67,747,745	5,979	15	0.15
第108期	114,034,547	66,696,768	5,849	15	0.15
第109期	103,186,745	59,420,786	5,759	15	0.15
第110期	102,785,924	58,220,010	5,664	15	0.15
第111期	98,322,025	56,149,395	5,711	15	0.15
第112期	90,794,155	52,840,531	5,820	15	0.15
第113期	88,389,132	50,538,279	5,718	15	0.15
第114期	87,285,272	50,069,737	5,736	15	0.15
第115期	79,300,062	45,591,843	5,749	15	0.15
第116期	79,493,806	46,060,460	5,794	15	0.15

(注) 1 単位は受益権 1 万口。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ					
	第 112 期	第 113 期	第 114 期	第 115 期	第 116 期
1 万口当り分配金（税込み）	15円	15円	15円	15円	15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。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	5,787円11銭

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。

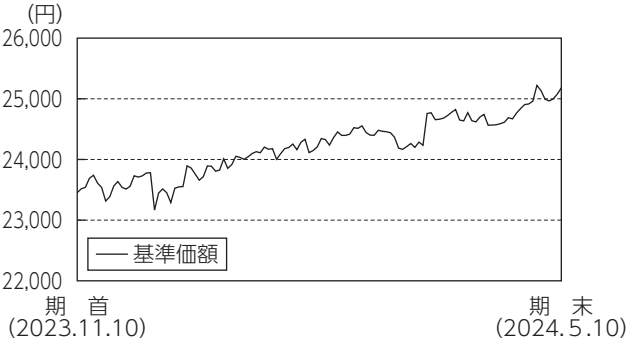
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等および短期金融商品
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		F T S E カナダ 国債インデックス (円換算)		公 社 債 入 組 比	債 先 比	券 物 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	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) 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 (債券価格は上昇) 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。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ カナダ債券市場

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。

■ 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)	3 (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)

			買 付 額	売 付 額
外 国	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 14,560	千カナダ・ドル 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
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 区 分	当		期		未			
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B 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。

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当		期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	千カナダ・ドル 5,000	千カナダ・ドル 4,743	千円 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。

■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V A（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。