

ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり/為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第19期

(決算日 2024年7月19日)

(作成対象期間 2024年1月20日~2024年7月19日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/その他資産(バンクローン)	
信託期間	2015年1月30日~2025年1月17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「GIM トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド JPYクラス」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネースtock・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「GIM トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス」の受益証券(円建) ロ. ダイワ・マネースtock・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・マネースtock・マザーファンド	円建ての債券
組入制限	投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。	
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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国投資信託を通じて米ドル建てのバンクローン等に投資することにより、安定的なインカム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。当完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/>

<5653>
<5654>

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	期騰落 中率			
	円	円	%	%	%	百万円
15期末(2022年7月19日)	7,363	210	△ 7.3	—	99.0	410
16期末(2023年1月19日)	7,443	180	3.5	—	99.0	412
17期末(2023年7月19日)	7,406	100	0.8	—	99.0	408
18期末(2024年1月19日)	7,451	50	1.3	—	99.0	411
19期末(2024年7月19日)	7,444	50	0.6	0.0	99.0	390

(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。

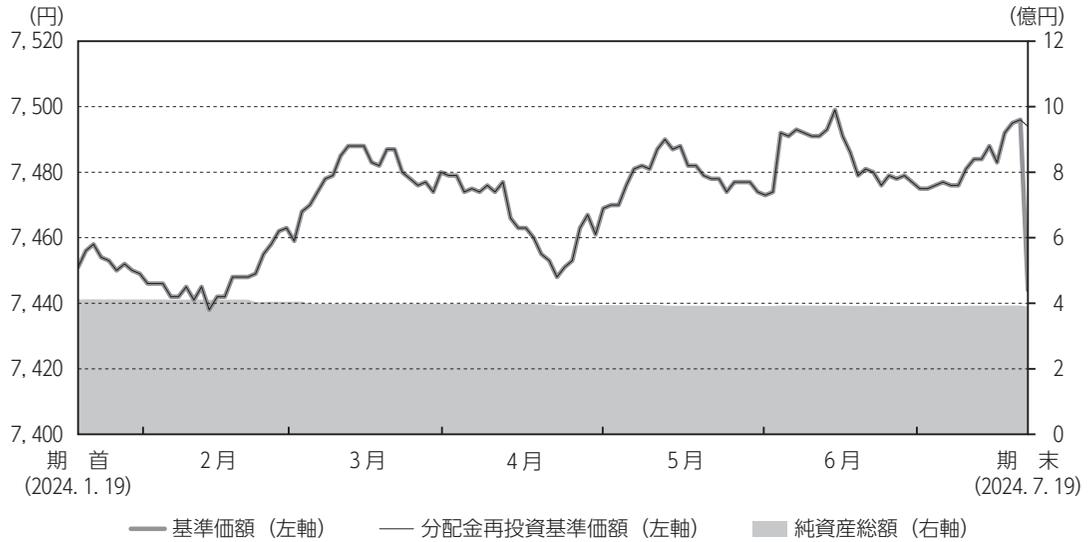
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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：7,451円

期末：7,444円（分配金50円）

騰落率：0.6%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

米国バンクローン（貸付債権）市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジあり）

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %		
(期首) 2024年 1月19日	7,451	—	—	99.0
1月末	7,449	△ 0.0	—	99.0
2月末	7,463	0.2	—	99.0
3月末	7,480	0.4	0.0	99.1
4月末	7,469	0.2	0.0	99.0
5月末	7,473	0.3	0.0	99.8
6月末	7,475	0.3	0.0	99.0
(期末) 2024年 7月19日	7,494	0.6	0.0	99.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2024. 1. 20 ~ 2024. 7. 19）

■米国バンクローン市況

米国バンクローン市況は上昇しました。

米国バンクローン市況は、2024年4月にパウエルF R B（米国連邦準備制度理事会）議長を含む複数のF R B高官が利下げに慎重な発言をしたことや、6月にインフレ指標をはじめ発表された経済指標の多くが予想を下振れたことなどを受けて、軟調に推移する場面も見られましたが、バンクローンの安定的なインカム収益が下支えとなり、当作成期を通じて上昇基調で推移しました。

■短期金利市況

日銀は、政策金利である「無担保コールレート（オーバーナイト物）」を0～0.1%程度に引き上げました。米国は、政策金利であるF Fレート（フェデラル・ファンド・レート）の誘導目標を5.25～5.50%に据え置きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドは、「G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Y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、米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Yクラス

ファンダメンタルズが改善基調にある銘柄やリスク対比で魅力的な銘柄の選定を行ってまいります。さらに、クレジット（企業の信用力）の劣化には迅速に対応することで、パフォーマンスの向上に努める方針です。

また、為替変動リスクを低減するため、米ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・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。

ポートフォリオについて

(2024. 1. 20 ~ 2024. 7. 19)

■当ファンド

当ファンドは、「G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Y クラス」と「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」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「G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Y クラス」への投資割合を高位に維持することを基本としました。

■G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Y クラス

米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。

また、米ドル建ての資産に対して米ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行いました。

■ダイワ・マネースtock・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	
	2024年1月20日 ～2024年7月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	50
対基準価額比率	（％）	0.67
当期の収益	（円）	50
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,079

- (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。
- (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	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	272.11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		116.89
(d) 分配準備積立金		740.87
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		1,129.88
(f) 分配金		50.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		1,079.88

- (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

当ファンドは、「GIM トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド JPY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、米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■GIM トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド JPYクラス

ファンダメンタルズが改善基調にある銘柄やリスク対比で魅力的な銘柄の選定を行ってまいります。さらに、クレジット（企業の信用力）の劣化には迅速に対応することで、パフォーマンスの向上に努める方針です。

また、為替変動リスクを低減するため、米ドル売り／日本円買いの為替ヘッジを行います。

■ダイワ・マネースtock・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 (2024. 1. 20～2024. 7. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.588%	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7,471円です。
（投 信 会 社）	(14)	(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）	(29)	(0.383)	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	44	0.592	

(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。

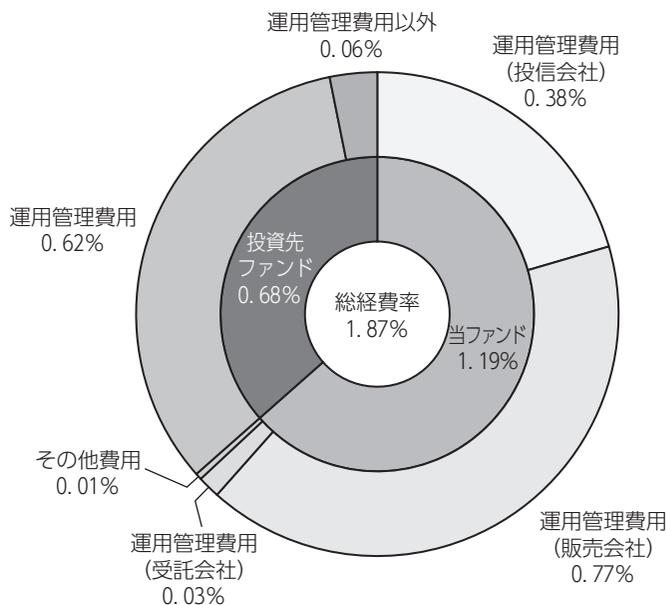
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.87%です。



総経費率 (① + ② + ③)	1.87%
①当ファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) 投資先ファンドとは、当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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) 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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) 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8) 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

（2024年1月20日から2024年7月19日まで）

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外国 （邦貨建）	GIM TRUST2 SENIOR SECURED LOAN FUND JPY CLASS （ケイマン諸島）	千口 267,34819	千円 16,833	千口 411,23616	千円 26,040

（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
外国投資信託受益証券 （ケイマン諸島） GIM TRUST2 SENIOR SECURED LOAN FUND JPY CLASS	千口 6,210,96762	千円 386,191	% 99.0

（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	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	千口 0	千口 0	千円 0

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年7月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 386,191	% 97.7
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	0	0.0
コール・ローン等、その他	8,958	2.3
投資信託財産総額	395,151	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

2024年7月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	398,301,031円
コール・ローン等	5,808,279
投資信託受益証券（評価額）	386,191,756
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド（評価額）	997
未収入金	6,299,999
(B) 負債	8,240,543
未払金	3,150,000
未払収益分配金	2,620,034
未払解約金	112,430
未払信託報酬	2,341,845
その他未払費用	16,234
(C) 純資産総額（A－B）	390,060,488
元本	524,006,934
次期繰越損益金	△ 133,946,446
(D) 受益権総口数	524,006,934口
1万口当り基準価額（C/D）	7,444円

* 期首における元本額は552,512,725円、当作成期間中における追加設定元本額は286,662円、同解約元本額は28,792,453円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,444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133,946,446円です。

■損益の状況

当期 自 2024年 1月20日 至 2024年 7月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	16,617,292円
受取配当金	16,616,200
受取利息	1,119
支払利息	△ 27
(B) 有価証券売買損益	△ 11,994,194
売買益	183,932
売買損	△ 12,178,126
(C) 信託報酬等	△ 2,358,079
(D) 当期損益金 (A + B + C)	2,265,019
(E) 前期繰越損益金	△ 121,547,114
(F) 追加信託差損益金	△ 12,044,317
(配当等相当額)	(6,125,348)
(売買損益相当額)	(△ 18,169,665)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 131,326,412
(H) 収益分配金	△ 2,620,034
次期繰越損益金 (G + H)	△ 133,946,446
追加信託差損益金	△ 12,044,317
(配当等相当額)	(6,125,348)
(売買損益相当額)	(△ 18,169,665)
分配準備積立金	50,461,341
繰越損益金	△ 172,363,470

- (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せん。
- (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	14,259,213円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	6,125,348
(d) 分配準備積立金	38,822,162
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	59,206,723
(f) 分配金	2,620,034
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	56,586,689
(h) 受益権総口数	524,006,934口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

50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
15期末(2022年7月19日)	8,878	240	12.5	—	99.0	87
16期末(2023年1月19日)	8,322	330	△ 2.5	—	99.0	122
17期末(2023年7月19日)	8,956	330	11.6	—	99.0	133
18期末(2024年1月19日)	9,663	310	11.4	—	99.0	132
19期末(2024年7月19日)	10,235	340	9.4	0.0	99.0	78

(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。

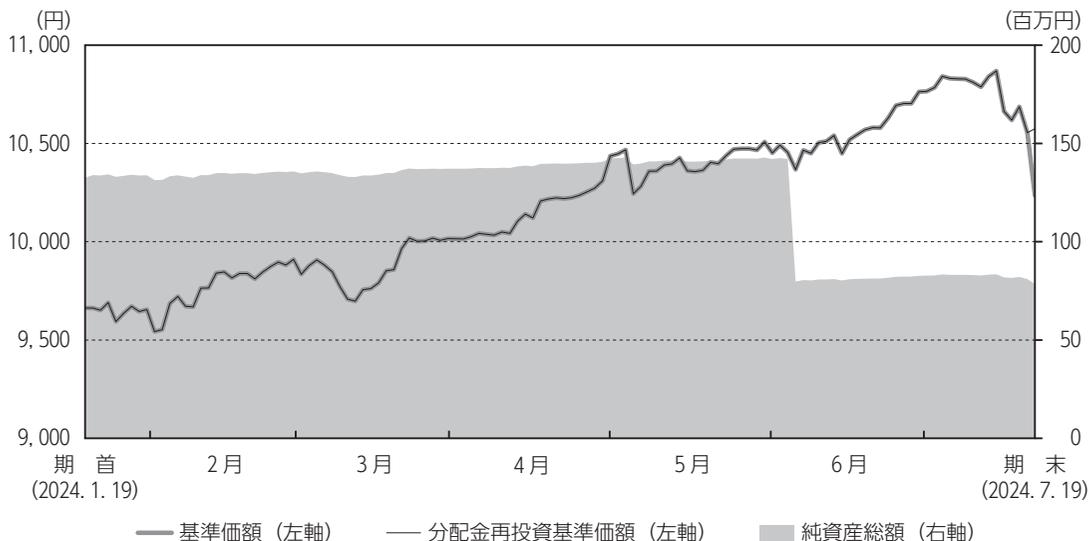
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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：9,663円

期末：10,235円（分配金340円）

騰落率：9.4%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

米国バンクローン（貸付債権）市場が上昇したことや、米ドル円相場が上昇（円安）したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率 組 入 比	投 資 信 託 受 益 証 券 組 入 比 率
	円	騰 落 率 %		
(期首) 2024年 1月19日	9,663	—	—	99.0
1月末	9,655	△ 0.1	—	99.0
2月末	9,910	2.6	—	99.1
3月末	10,016	3.7	0.0	99.3
4月末	10,436	8.0	0.0	99.8
5月末	10,452	8.2	0.0	99.2
6月末	10,765	11.4	0.0	99.2
(期末) 2024年 7月19日	10,575	9.4	0.0	99.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2024. 1. 20 ~ 2024. 7. 19）

■米国バンクローン市況

米国バンクローン市況は上昇しました。

米国バンクローン市況は、2024年4月にパウエルF R B（米国連邦準備制度理事会）議長を含む複数のF R B高官が利下げに慎重な発言をしたことや、6月にインフレ指標をはじめ発表された経済指標の多くが予想を下振れたことなどを受けて、軟調に推移する場面も見られましたが、バンクローンの安定的なインカム収益が下支えとなり、当作成期を通じて上昇基調で推移しました。

■為替相場

米ドル為替相場は対円で上昇しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に、円安米ドル高となりました。2024年3月には、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、さらに円安米ドル高となりました。その後も、過度な円安米ドル高進行に対し政府・日銀が為替介入を行いました。7月に入ると、4 - 6月の経済データでインフレ改善への自信を深めたとのパウエルF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言を受け、米ドルは対円で下落（円高）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

当ファンドは、「G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド USD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、米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■G I M トラスト2 - シニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス

ファンダメンタルズが改善基調にある銘柄やリスク対比で魅力的な銘柄の選定を行ってまいります。さらに、クレジット（企業の信用力）の劣化には迅速に対応することで、パフォーマンスの向上に努める方針です。

■ダイワ・マネースtock・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。

ポートフォリオについて

（2024. 1. 20 ~ 2024. 7. 19）

■当ファンド

当ファンドは、「G I M トラスト2 -シニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス」と「ダイワ・マネースtock・マザーファンド」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「G I M トラスト2 -シニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス」への投資割合を高位に維持することを基本としました。

■G I M トラスト2 -シニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス

米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしました。

■ダイワ・マネースtock・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	
	2024年1月20日 ～2024年7月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	340
対基準価額比率	（％）	3.22
当期の収益	（円）	340
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,035

- (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。
- (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	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	397.79円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		513.42
(c) 収益調整金		274.72
(d) 分配準備積立金		189.23
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		1,375.18
(f) 分配金		340.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		1,035.18

- (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

当ファンドは、「G I M トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド USD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、米ドル建ての担保付バンクローン等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

■G I M トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド USDクラス

ファンダメンタルズが改善基調にある銘柄やリスク対比で魅力的な銘柄の選定を行ってまいります。さらに、クレジット（企業の信用力）の劣化には迅速に対応することで、パフォーマンスの向上に努める方針です。

■ダイワ・マネースtock・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 (2024. 1. 20～2024. 7. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	60円	0.588%	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10,193円です。
(投 信 会 社)	(20)	(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)	(39)	(0.383)	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	60	0.592	

(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。

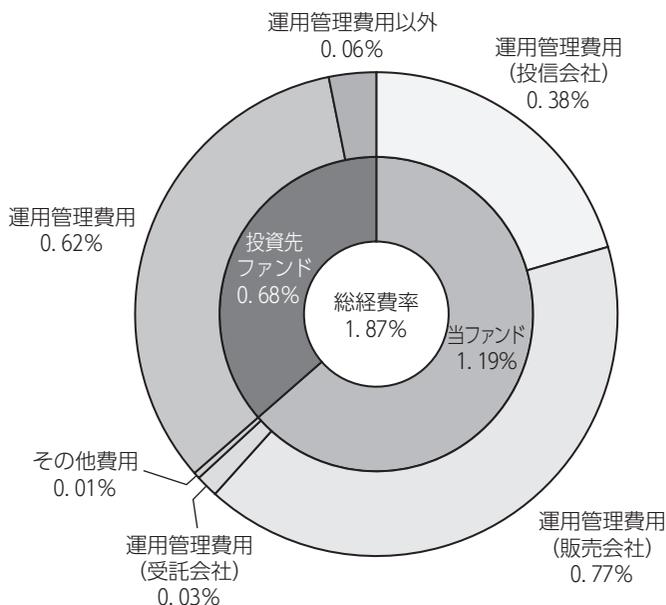
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.87%です。



総経費率 (① + ② + ③)	1.87%
①当ファンドの費用の比率	1.19%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.62%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06%

(注1) 投資先ファンドとは、当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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) 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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) 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8) 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。

ダイワ米国バンクローン・オープン（為替ヘッジなし）

■売買および取引の状況 投資信託受益証券

（2024年1月20日から2024年7月19日まで）

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国 （邦貨建）	GIM TRUST2 SENIOR SECURED LOAN FUND USD CLASS （ケイマン諸島）	千口 54.94076	千円 6,215	千口 573.20103	千円 67,289

（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		
	口 数	評 価 額	比 率
外国投資信託受益証券 （ケイマン諸島） GIM TRUST2 SENIOR SECURED LOAN FUND USD CLASS	千口 663.46643	千円 77,788	% 99.0

（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	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	千口 0	千口 0	千円 0

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年7月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 77,788	% 94.9
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド	0	0.0
コール・ローン等、その他	4,163	5.1
投資信託財産総額	81,952	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

2024年7月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	81,952,280円
コール・ローン等	4,163,162
投資信託受益証券（評価額）	77,788,121
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド（評価額）	997
(B) 負債	3,386,916
未払収益分配金	2,609,970
未払解約金	43,496
未払信託報酬	728,455
その他未払費用	4,995
(C) 純資産総額（A－B）	78,565,364
元本	76,763,835
次期繰越損益金	1,801,529
(D) 受益権総口数	76,763,835口
1万口当り基準価額（C/D）	10,235円

*期首における元本額は137,111,643円、当作成期間中における追加設定元本額は2,185,622円、同解約元本額は62,533,430円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,235円です。

■損益の状況

当期 自 2024年 1月20日 至 2024年 7月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,373,844円
受取配当金	3,373,142
受取利息	708
支払利息	△ 6
(B) 有価証券売買損益	4,354,498
売買益	6,290,801
売買損	△ 1,936,303
(C) 信託報酬等	733,450
(D) 当期損益金 (A + B + C)	6,994,892
(E) 前期繰越損益金	1,452,627
(F) 追加信託差損益金	4,036,020
(配当等相当額)	(2,108,924)
(売買損益相当額)	(△ 6,144,944)
(G) 合計 (D + E + F)	4,411,499
(H) 収益分配金	2,609,970
次期繰越損益金 (G + H)	1,801,529
追加信託差損益金	△ 4,036,020
(配当等相当額)	(2,108,924)
(売買損益相当額)	(△ 6,144,944)
分配準備積立金	5,837,549

- (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せん。
- (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	3,053,620円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,941,272
(c) 収益調整金	2,108,924
(d) 分配準備積立金	1,452,627
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	10,556,443
(f) 分配金	2,609,970
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	7,946,473
(h) 受益権総口数	76,763,835口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

340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。

G I M トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド
J P Yクラス／U S Dクラス

当ファンド（ダイワ米国バンクローン・オープン（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「G I M トラスト2ーシニア・セキュアード・ローン・ファンド J P Yクラス／U S Dクラス」の受益証券（円建）を主要投資対象としております。以下の内容は、直近で入手可能な Financial Statements 等から抜粋し、編集および一部翻訳したものです。

(米ドル建て)

貸借対照表
2023年8月31日現在

資産	
投資資産の公正価値による評価額（簿価 \$362, 042, 570）	\$ 356, 678, 698
現金	66, 248
中央清算されるデリバティブ取引に係るブローカーへの預託金	366, 031
外国為替先渡取引による評価損益	534
未取：	
利息	2, 961, 963
受益証券の発行	1, 307, 862
売却済みの投資	1, 028, 830
決済済み外国為替先渡取引	415
その他資産	315, 658
資産合計	362, 726, 239
負債	
外国為替先渡取引による評価損益	79, 505
未払：	
購入済みの投資	5, 065, 766
投資管理報酬	1, 256, 562
会計報酬および管理会社報酬	145, 851
専門家報酬	115, 393
保管会社報酬	62, 948
運用会社報酬	8, 753
名義書換代理人報酬	3, 093
負債合計	6, 737, 871
純資産	\$ 355, 988, 368
純資産	
クラス A - U S D クラス	\$ 353, 197, 230
クラス A - U S D クラス	2, 791, 138
	\$ 355, 988, 368
発行済み受益証券	
クラス A - U S D クラス	472, 117, 929
クラス A - U S D クラス	6, 200, 415
受益証券1口当り純資産額	
クラス A - U S D クラス	\$ 0. 748
クラス A - U S D クラス	\$ 0. 450

損益計算書

2023年8月31日に終了する年度

投資収益

受取利息	\$	30,541,497
その他収益		260,997
投資収益合計		30,802,494

費用

投資管理報酬		1,934,161
会計報酬および管理会社報酬		297,563
保管会社報酬		155,537
専門家報酬		94,955
名義書換代理人報酬		37,195
運用会社報酬		37,195
受託会社報酬		10,001
登録料		8,344
費用合計		2,574,951

純投資損益		28,227,543
--------------	--	-------------------

実現損益および評価損益の変動：

実現損益の内訳：

証券投資		(8,890,624)
スワップ取引の評価額		305,957
外国為替取引および外国為替先渡取引		(333,664)
純実現損益		(8,918,331)

評価損益の変動の内訳：

証券投資		8,050,722
未行使ローン・コミットメント		27,261
スワップ取引の評価額		182,650
外国為替換算および外国為替先渡取引		51,439
評価損益の純変動		8,312,072

純実現損益および評価損益の純変動		(606,259)
-------------------------	--	------------------

運用の結果による純資産の純増減	\$	27,621,284
------------------------	----	-------------------

ダイワ米国バンクローン・オープン

投資明細表
2023年8月31日現在

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
		債券* (95.1%)		
		カナダ (2.3%)		
		バンクローン (1.6%)		
U S D	1,338,297	Bausch Health Cos., Inc. 10.66% due 02/01/27		\$ 1,090,712
U S D	1,070,000	Clarios Global LP 9.08% due 05/06/30		1,066,993
U S D	299,244	Garda World Security Corp. due 02/01/29 (a)		298,442
U S D	850,000	9.67% due 10/30/26		848,028
U S D	1,009,853	Husky Injection Molding Systems Ltd. 8.73% due 03/28/25		1,002,441
U S D	1,359,193	KDC/ONE Development Corp., Inc. 10.33% due 08/15/28		1,311,621
U S D	125,000	NorthRiver Midstream Finance LP 8.33% due 08/16/30		124,688
		バンクローン合計		5,742,925
		社債 (0.7%)		
U S D	1,000,000	Bausch Health Cos., Inc. 5.50% due 11/01/25 (b) (c)		900,500
U S D	400,000	Garda World Security Corp. 4.63% due 02/15/27 (b) (c)		370,003
U S D	1,250,000	NorthRiver Midstream Finance LP 5.63% due 02/15/26 (b) (c)		1,201,563
		社債合計		2,472,066
		カナダ合計 (簿価 \$8,594,080)		8,214,991
		ケイマン諸島 (0.6%)		
		バンクローン (0.6%)		
U S D	1,952,250	AAdvantage Loyalty IP Ltd. 10.34% due 04/20/28		2,025,772
		バンクローン合計		2,025,772
		ケイマン諸島合計 (簿価 \$1,979,467)		2,025,772
		フランス (0.3%)		
		バンクローン (0.3%)		
U S D	1,399,993	Altice France S. A. 10.81% due 08/15/28		1,222,376
		バンクローン合計		1,222,376
		フランス合計 (簿価 \$1,358,177)		1,222,376
		ドイツ (0.3%)		
		バンクローン (0.3%)		
U S D	1,026,568	TK Elevator MidCo GmbH 9.38% due 07/30/27		1,024,576
		バンクローン合計		1,024,576
		ドイツ合計 (簿価 \$1,006,752)		1,024,576

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
		アイルランド (0.4%)		
		バンクローン (0.4%)		
U S D	1,434,163	Flutter Entertainment PLC 8.75% due 07/22/28		1,434,077
		バンクローン合計		1,434,077
		アイルランド合計 (簿価 \$1,410,545)		1,434,077
		ルクセンブルク (3.9%)		
		バンクローン (3.9%)		
U S D	1,291,810	Altice Financing S. A. 10.31% due 10/31/27		1,217,530
U S D	1,391,950	Cobham Ultra SeniorCo Sarl 9.36% due 08/06/29		1,381,510
U S D	1,103,550	Icon Public Ltd. Co., Lux Term Loan 7.75% due 07/03/28		1,103,671
U S D	274,950	Icon Public Ltd. Co., U. S. Term Loan 7.75% due 07/03/28		274,980
U S D	3,038,003	Intelsat Jackson Holdings S. A. 9.77% due 02/01/29		3,036,332
U S D	603,050	Jazz Pharmaceuticals Public Ltd. Co. 8.95% due 05/05/28		603,050
U S D	947,411	Summer (BC) Bidco B LLC 10.00% due 12/04/26		907,146
U S D	4,945,100	Sunshine Luxembourg VII Sarl 9.09% due 10/01/26		4,947,870
U S D	261,005	Trinseo Materials Operating SCA 7.54% due 09/06/24		255,949
		バンクローン合計		13,728,038
		ルクセンブルク合計 (簿価 \$13,752,378)		13,728,038
		オランダ (0.7%)		
		バンクローン (0.5%)		
U S D	1,821,938	Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV 7.93% due 12/20/29		1,824,780
		バンクローン合計		1,824,780
		社債 (0.2%)		
U S D	750,000	Trivium Packaging Finance BV 5.50% due 08/15/26 (b) (c)		707,448
		社債合計		707,448
		オランダ合計 (簿価 \$2,569,119)		2,532,228
		パナマ (0.2%)		
		バンクローン (0.2%)		
U S D	850,000	Carnival Corp. due 08/08/27 (a)		848,512
		バンクローン合計		848,512
		パナマ合計 (簿価 \$848,953)		848,512
		英国 (0.8%)		
		バンクローン (0.8%)		

ダイワ米国バンクローン・オープン

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	2,800,000	Formula One Management Ltd. 8.33% due 01/15/30		2,807,000
		バンクローン合計		2,807,000
		英国合計 (簿価 \$2,800,902)		2,807,000
		米国 (85.6%)		
		バンクローン (68.9%)		
U S D	790,405	ACProducts Holdings, Inc. 9.75% due 05/17/28		674,808
U S D	1,624,886	Adient US LLC 8.70% due 04/10/28		1,625,471
U S D	797,964	Ahead DB Holdings LLC 9.09% due 10/18/27		778,765
U S D	1,414,205	AHP Health Partners, Inc. 8.95% due 08/24/28		1,414,912
U S D	4,001,790	Alliance Laundry Systems LLC 8.90% due 10/08/27		4,004,871
U S D	1,556,185	Allied Universal Holdco LLC 9.18% due 05/12/28		1,510,962
U S D	470,000	Altar Bidco, Inc. 9.88% due 05/12/28		464,360
U S D	4,068,334	Altar Bidco, Inc. 7.99% due 02/01/29		4,046,284
U S D	765,000	American Axle & Manufacturing, Inc. 10.49% due 02/01/30		738,860
U S D	250,000	8.44% due 12/13/29		248,985
U S D	1,818,078	APi Group DE, Inc. 7.95% due 10/01/26		1,820,678
U S D	1,584,417	Arches Buyer, Inc. 8.68% due 12/06/27		1,538,612
U S D	1,080,318	Astoria Energy LLC 8.95% due 12/10/27		1,074,744
U S D	226,652	Asurion LLC 8.79% due 07/31/27		217,763
U S D	1,892,036	9.43% due 08/19/28		1,818,984
U S D	1,983,675	9.68% due 08/19/28		1,913,314
U S D	1,765,000	10.70% due 01/31/28		1,575,810
U S D	818,499	Avantor Funding, Inc. 7.68% due 11/08/27		818,639
U S D	1,357,648	AZZ, Inc. due 05/13/29		1,359,684
U S D	992,032	B&G Foods, Inc. 7.83% due 10/10/26		982,816
U S D	1,122,672	BK LC Lux SPV Sarl 8.88% due 04/28/28		1,118,462
U S D	2,581,405	Brookfield WEC Holdings, Inc. 8.20% due 08/01/25		2,577,352
		Buckeye Partners LP		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	992,366	7.67% due 11/01/26 Caesars Entertainment, Inc.		990,015
U S D	1,038,179	8.68% due 02/06/30 Calpine Construction Finance Co. LP		1,038,054
U S D	1,453,128	7.58% due 07/20/30 Camelot U. S. Acquisition 1 Co.		1,442,230
U S D	3,441,203	8.45% due 10/30/26 (a) Carroll County Energy LLC		3,439,688
U S D	905,874	8.84% due 02/13/26 Chariot Buyer LLC		883,608
U S D	1,976,766	8.68% due 11/03/28 Charter Communications Operating LLC		1,954,942
U S D	224,417	7.12% due 02/01/27 Ciena Corp.		223,268
U S D	1,875,575	7.81% due 01/18/30 Cincinnati Bell, Inc.		1,875,575
U S D	1,237,093	8.68% due 11/22/28 Claire's Stores, Inc.		1,204,310
U S D	224,176	11.93% due 12/18/26 Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		202,038
U S D	4,654,120	9.13% due 08/21/26 Commscope, Inc.		4,543,585
U S D	3,297,926	8.70% due 04/06/26 Conair Holdings LLC		3,024,198
U S D	2,503,869	9.29% due 05/17/28 Conservice Midco LLC		2,361,149
U S D	1,741,195	9.72% due 05/13/27 (a) Constellation Renewables LLC		1,739,767
U S D	1,687,352	8.18% due 12/15/27 CSC Holdings LLC		1,675,405
U S D	2,378,695	9.81% due 01/18/28 Curia Global, Inc.		2,239,946
U S D	1,009,331	9.17% due 08/30/26 DCert Buyer, Inc.		853,248
U S D	686,135	9.33% due 10/16/26		683,123
U S D	915,000	12.33% due 02/19/29 Deerfield Dakota Holding LLC		852,478
U S D	1,319,759	8.99% due 04/09/27 DexKo Global, Inc.		1,272,103
U S D	1,345,440	9.25% due 10/04/28 DIRECTV Financing LLC		1,301,551
U S D	1,608,735	10.45% due 08/02/27 Dun & Bradstreet Corp.		1,588,255
U S D	1,950,374	8.17% due 02/06/26 E. W. Scripps Co.		1,949,827
U S D	1,805,087	8.45% due 01/07/28		1,789,292

ダイワ米国バンクローン・オープン

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,521,102	Ecovyst Catalyst Technologies LLC 7.97% due 06/09/28		1,513,253
U S D	991,761	Elanco Animal Health, Inc. 7.17% due 08/01/27		981,536
U S D	2,071,239	Emrld Borrower LP 8.33% due 05/31/30		2,072,543
U S D	1,138,264	Endo Luxembourg Finance Co. I Sarl 14.50% due 03/27/28 (d)		830,933
U S D	854,080	Ensemble RCM LLC 9.22% due 08/03/26		854,541
U S D	1,607,941	Entegris, Inc. 7.99% due 07/06/29		1,609,951
U S D	2,273,764	Envision Healthcare Corp. 8.99% due 03/31/27		4,161
U S D	935,454	9.49% due 03/31/27		230,748
U S D	245,066	FGI Operating Co. LLC 16.16% due 09/17/40		26,712
U S D	930,343	First Student Bidco, Inc., Initial Term B Loan 8.50% due 07/21/28		916,053
U S D	64,935	First Student Bidco, Inc., Initial Term C Loan 8.50% due 07/21/28		63,937
U S D	2,489,012	First Student Bidco, Inc., 2022 Incremental Term B Loan 9.34% due 07/21/28		2,421,734
U S D	1,154,985	First Student Bidco, Inc., 2022 Incremental Term C Loan 9.34% due 07/21/28		1,123,766
U S D	658,703	Gates Global LLC 7.93% due 03/31/27		657,333
U S D	570,688	8.83% due 11/16/29		570,807
U S D	1,716,705	Gemini HDPE LLC 8.63% due 12/31/27		1,714,129
U S D	1,941,254	Genesee & Wyoming, Inc. 7.34% due 12/30/26		1,940,904
U S D	2,904,728	Genesys Cloud Services Holdings I LLC 9.45% due 12/01/27		2,902,927
U S D	1,516,025	Getty Images, Inc. 9.84% due 02/19/26		1,516,025
U S D	1,542,250	Go Daddy Operating Co. LLC 7.83% due 11/09/29		1,544,178
U S D	1,936,988	GoodRx, Inc. 8.18% due 10/10/25		1,932,494
U S D	1,788,156	Graham Packaging Co., Inc. 8.45% due 08/04/27		1,783,023
U S D	697,673	Gray Television, Inc. 7.93% due 01/02/26		693,020
U S D	714,433	8.43% due 12/01/28		705,631
		Griffon Corp.		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,329,391	7.64% due 01/24/29 Guardian US Holdco LLC		1,324,818
U S D	1,300,000	9.34% due 01/31/30 Harsco Corp.		1,299,350
U S D	1,852,725	7.70% due 06/09/28 Helios Software Holdings, Inc.		1,830,882
U S D	882,088	9.14% due 03/11/28 Hercules Achievement, Inc. (Varsity Brands Holding Co., Inc.)		872,994
U S D	1,167,522	10.45% due 12/15/26 Hertz Corp., Initial Term B Loan		1,131,772
U S D	1,466,833	8.70% due 06/30/28 Hertz Corp., Initial Term C Loan		1,464,589
U S D	282,083	8.70% due 06/30/28 Hub International Ltd.		281,651
U S D	2,121,209	9.58% due 06/20/30 iHeartCommunications, Inc.		2,126,958
U S D	2,234,304	8.45% due 05/01/26		1,988,888
U S D	2,012,858	8.70% due 05/01/26 INEOS Enterprises Holdings US Finco LLC		1,787,680
U S D	1,972,538	9.27% due 07/08/30 INEOS US Finance LLC		1,944,193
U S D	2,495,000	8.93% due 02/18/30 Ingram Micro, Inc.		2,475,664
U S D	921,894	9.04% due 06/30/28 Insulet Corp.		919,875
U S D	4,485,717	8.70% due 05/04/28 IRB Holding Corp.		4,487,960
U S D	1,335,425	8.43% due 12/15/27 LABL, Inc.		1,327,212
U S D	1,990,287	10.43% due 10/29/28 Leslie's Poolmart, Inc.		1,982,823
U S D	2,121,846	8.20% due 03/09/28 LifePoint Health, Inc.		2,082,358
U S D	955,549	9.38% due 11/16/25 Madison IAQ LLC		946,949
U S D	2,861,908	8.30% due 06/21/28 Mauser Packaging Solutions Holding Co.		2,844,021
U S D	2,493,750	9.32% due 08/14/26 MED Parentco LP		2,494,448
U S D	1,631,192	9.70% due 08/31/26 Medallion Midland Acquisition LLC		1,556,875
U S D	1,499,583	9.25% due 10/18/28 Medline Borrower LP		1,495,834
U S D	4,133,057	8.70% due 10/23/28 (a) MH Sub I LLC (Micro Holding Corp.)		4,128,304
U S D	1,956,121	9.58% due 05/03/28		1,878,306

ダイワ米国バンクローン・オープン

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	754,401	MI Windows and Doors LLC 8.93% due 12/18/27		754,401
U S D	1,631,579	Mileage Plus Holdings LLC 10.76% due 06/21/27		1,699,616
U S D	1,659,512	Mirion Technologies (US Holdings) , Inc. 8.25% due 10/20/28		1,657,935
U S D	338,277	Moran Foods LLC, 2022 Incremental FLSO Loan (First Lien) 12.21% due 06/30/26		263,281
U S D	1,555,512	Moran Foods LLC, Extended Closing Date Loan (First Lien) 12.21% due 06/30/26		1,269,764
U S D	597,767	Moran Foods LLC, Extended Closing Date Loan (Second Lien) 16.46% due 12/31/26		409,650
U S D	1,371,150	Naked Juice LLC 8.59% due 01/24/29		1,297,451
U S D	1,880,067	Netsmart, Inc. 9.45% due 10/01/27		1,878,130
U S D	908,102	Nexstar Broadcasting, Inc. 7.95% due 09/18/26		909,319
U S D	1,317,575	Nielsen Consumer, Inc. 9.08% due 03/06/28		1,258,284
U S D	1,704,050	Option Care Health, Inc. 8.20% due 10/27/28		1,707,782
U S D	2,876,543	Osмосе Utilities Services, Inc. 8.70% due 06/23/28 (a)		2,850,913
U S D	1,366,196	Packaging Coordinators Midco, Inc. 9.00% due 11/30/27		1,358,628
U S D	1,621,202	Pactiv Evergreen, Inc. 8.70% due 02/05/26		1,620,505
U S D	2,880,899	Parexel International Corp. 8.70% due 11/15/28		2,870,470
U S D	1,917,178	Park River Holdings, Inc. 8.52% due 12/28/27		1,843,981
U S D	1,385,664	Pathway Vet Alliance LLC 9.20% due 03/31/27		1,278,275
U S D	1,730,961	Petco Health and Wellness Co. , Inc. 8.75% due 03/03/28		1,719,502
U S D	396,009	PetVet Care Centers LLC 8.18% due 02/14/25		391,059
U S D	1,074,647	PG&E Corp. 8.93% due 02/14/25		1,065,921
U S D	907,881	Pike Corp. 8.45% due 06/23/25		906,120
U S D	2,288,547	Pike Corp. 8.45% due 01/21/28		2,287,357
U S D	749,338	Pre-Paid Legal Services, Inc. 8.83% due 01/21/28		750,274
U S D	1,157,285	Pre-Paid Legal Services, Inc. 9.20% due 12/15/28		1,136,674

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	3,930,327	Prime Security Services Borrower LLC 8.18% due 09/23/26		3,929,501
U S D	2,307,316	Project Boost Purchaser LLC 8.95% due 06/01/26		2,303,278
U S D	1,807,469	Proofpoint, Inc. 8.70% due 08/31/28		1,787,984
U S D	901,373	Quest Software US Holdings, Inc. 9.77% due 02/01/29		735,971
U S D	1,840,699	QUIKRETE Holdings, Inc. 8.43% due 03/18/29		1,840,589
U S D	2,279,400	RealPage, Inc. 8.45% due 04/24/28		2,251,682
U S D	986,223	RealTruck Group, Inc. 9.20% due 01/31/28		953,628
U S D	1,393,918	Ring Container Technologies Group LLC 8.95% due 08/12/28		1,392,872
U S D	1,350,530	Shearer's Foods LLC 8.95% due 09/23/27		1,349,220
U S D	1,481,626	Shutterfly Finance LLC 10.24% due 10/01/27		970,465
U S D	179,093	Signal Parent, Inc. 11.24% due 10/01/27		178,018
U S D	1,083,407	Skopima Consilio Parent LLC 8.93% due 04/03/28		910,062
U S D	2,291,992	Spirit AeroSystems, Inc. 9.45% due 05/12/28		2,228,046
U S D	744,375	SPX Flow, Inc. 9.62% due 01/15/27		742,514
U S D	1,285,334	SRS Distribution, Inc. 9.93% due 04/05/29		1,283,162
U S D	1,264,305	Staples, Inc. 8.93% due 06/02/28		1,246,921
U S D	2,349,327	Star US Bidco LLC 10.63% due 04/16/26		2,010,507
U S D	2,209,849	Synaptics, Inc. 9.68% due 03/17/27		2,207,087
U S D	1,848,953	TGP Holdings III LLC 7.74% due 12/02/28		1,836,251
U S D	1,133,641	ThoughtWorks, Inc. 8.68% due 06/29/28		1,020,594
U S D	508,430	Trans Union LLC 7.95% due 03/24/28		501,439
U S D	1,578,033	TransDigm, Inc. 7.70% due 12/01/28		1,576,502
U S D	1,254,519	8.49% due 02/22/27		1,257,267
U S D	883,591	8.49% due 08/24/28		883,989

ダイワ米国バンクローン・オープン

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,686,688	Trident TPI Holdings, Inc. 9.54% due 09/15/28		1,680,362
U S D	2,008,968	Triton Water Holdings, Inc. due 03/31/28		1,972,425
U S D	1,250,271	U. S. Renal Care, Inc. 10.35% due 06/20/28		787,670
U S D	1,106,636	UFC Holdings LLC 8.37% due 04/29/26		1,106,404
U S D	2,480,811	UKG, Inc. 8.62% due 05/04/26 (a)		2,477,958
U S D	1,121,228	Ultimate Software Group, Inc. 9.22% due 05/04/26		1,120,757
U S D	1,025,368	United Natural Foods, Inc. 8.70% due 10/22/25		1,026,158
U S D	1,372,340	University Support Services LLC 8.68% due 02/10/29		1,361,471
U S D	1,810,242	Univision Communications, Inc. 8.70% due 03/15/26		1,810,242
U S D	1,505,960	USI, Inc. 8.99% due 11/22/29		1,506,337
U S D	926,011	Utz Quality Foods LLC 8.45% due 01/20/28		926,270
U S D	1,679,488	Vertex Aerospace Services Corp. 8.93% due 12/06/28		1,676,784
U S D	2,038,328	Vertiv Group Corp. 8.18% due 03/02/27		2,036,351
U S D	436,678	Virtusa Corp. 9.18% due 02/15/29		431,901
U S D	727,665	VT Topco, Inc. 9.33% due 02/11/28		721,145
U S D	1,875,000	due 08/09/30 (a)		1,881,244
U S D	2,386,386	Whatabrands LLC 8.45% due 08/03/28		2,383,714
U S D	1,662,149	Wheel Pros, Inc. 10.11% due 05/11/28		1,097,650
U S D	1,595,161	White Cap Buyer LLC 9.08% due 10/19/27		1,592,497
U S D	2,135,000	WhiteWater Whistler Holdings LLC 8.49% due 02/15/30		2,135,000
U S D	2,173,438	WMG Acquisition Corp. 7.57% due 01/20/28		2,170,808
		バンクローン合計		245,223,523
		社債 (16.7%)		
U S D	502,000	ACI Worldwide, Inc. 5.75% due 08/15/26 (b) (c)		491,071
		Ahead DB Holdings LLC		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	750,000	6.63% due 05/01/28 (b) (c) Albertsons Cos., Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons LP / Albertsons LLC		648,396
U S D	1,000,000	3.25% due 03/15/26 (b) (c)		929,173
U S D	1,000,000	4.63% due 01/15/27 (b) (c) Ally Financial, Inc.		946,077
U S D	1,500,000	5.75% due 11/20/25 (c) American Airlines, Inc. / AAdvantage Loyalty IP Ltd.		1,454,624
U S D	1,283,333	5.50% due 04/20/26 (b) American Axle & Manufacturing, Inc.		1,259,192
U S D	2,100,000	6.50% due 04/01/27 (c) Amkor Technology, Inc.		1,990,570
U S D	1,625,000	6.63% due 09/15/27 (b) (c) Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp.		1,623,797
U S D	2,050,000	7.88% due 05/15/26 (b) (c) Avient Corp.		2,083,210
U S D	1,000,000	5.75% due 05/15/25 (b) (c) Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance, Inc.		986,668
U S D	2,265,000	5.75% due 07/15/27 (b) (c) Buckeye Partners LP		2,162,303
U S D	1,250,000	3.95% due 12/01/26 (c) Caesars Entertainment, Inc.		1,152,950
U S D	850,000	8.13% due 07/01/27 (b) (c) Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco, Inc.		863,073
U S D	500,000	5.75% due 07/01/25 (b) (c) Carnival Corp.		500,358
U S D	1,000,000	7.63% due 03/01/26 (b) (c) CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp.		996,796
U S D	2,870,000	5.13% due 05/01/27 (b) (c)		2,703,884
U S D	2,500,000	5.50% due 05/01/26 (b) (c) Chemours Co.		2,441,528
U S D	1,000,000	5.75% due 11/15/28 (b) (c) Chesapeake Energy Corp.		898,359
U S D	1,250,000	5.50% due 02/01/26 (b) (c) Clarios Global LP / Clarios US Finance Co.		1,220,056
U S D	850,000	6.25% due 05/15/26 (b) (c) Clean Harbors, Inc.		841,778
U S D	500,000	4.88% due 07/15/27 (b) (c) Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp.		477,928
U S D	1,500,000	5.63% due 05/01/27 (b) (c) DISH DBS Corp.		1,447,500
U S D	1,000,000	5.25% due 12/01/26 (b) (c)		842,686
U S D	750,000	5.88% due 11/15/24 Elanco Animal Health, Inc.		697,601

ダイワ米国バンクローン・オープン

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,500,000	6.65% due 08/28/28 (c) Energizer Holdings, Inc.		1,479,375
U S D	1,000,000	6.50% due 12/31/27 (b) (c) EQM Midstream Partners LP		963,750
U S D	2,000,000	7.50% due 06/01/27 (b) (c) Ford Motor Credit Co. LLC		2,018,342
U S D	3,000,000	4.27% due 01/09/27 (c)		2,773,642
U S D	2,000,000	4.54% due 08/01/26 (c)		1,885,424
U S D	890,000	6.80% due 05/12/28 (c) Gray Television, Inc.		889,643
U S D	750,000	7.00% due 05/15/27 (b) (c) Hertz Corp.		673,140
U S D	750,000	4.63% due 12/01/26 (b) (c) Hess Midstream Operations LP		679,042
U S D	750,000	5.63% due 02/15/26 (b) (c) Live Nation Entertainment, Inc.		730,800
U S D	1,500,000	6.50% due 05/15/27 (b) (c) MGM Resorts International		1,501,155
U S D	1,000,000	6.75% due 05/01/25 (c) Newell Brands, Inc.		1,001,639
U S D	1,500,000	4.70% due 04/01/26 (c) Nexstar Media, Inc.		1,433,993
U S D	1,000,000	5.63% due 07/15/27 (b) (c) Performance Food Group, Inc.		939,967
U S D	1,000,000	6.88% due 05/01/25 (b) (c) PetSmart, Inc. / PetSmart Finance Corp.		1,001,480
U S D	1,000,000	4.75% due 02/15/28 (b) (c) Royal Caribbean Cruises Ltd.		897,005
U S D	1,750,000	11.63% due 08/15/27 (b) (c) Sirius XM Radio, Inc.		1,905,987
U S D	1,000,000	5.00% due 08/01/27 (b) (c) SS&C Technologies, Inc.		922,700
U S D	1,000,000	5.50% due 09/30/27 (b) (c) Staples, Inc.		962,751
U S D	1,396,000	7.50% due 04/15/26 (b) (c) Tenet Healthcare Corp.		1,155,066
U S D	1,250,000	4.88% due 01/01/26 (c) Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance, Inc.		1,209,428
U S D	1,650,000	5.38% due 09/01/25 (b) (c) United Airlines, Inc.		1,535,667
U S D	500,000	4.38% due 04/15/26 (b) (c) Univision Communications, Inc.		470,892
U S D	1,000,000	6.63% due 06/01/27 (b) (c) WR Grace Holdings LLC		968,105
U S D	1,000,000	4.88% due 06/15/27 (b) (c)		932,641

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,000,000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp. 5.50% due 03/01/25 (b) (c)		987,897
		社債合計		59,579,109
		米国合計 (簿価 \$310,969,387)		304,802,632
		債券合計 (簿価 \$345,289,760)		338,640,202
	株数			
		優先株式 (0.2%)		
		米国 (0.2%)		
	247	Claire's Stores, Inc.		537,225
		米国合計 (簿価 \$64,375)		537,225
		優先株式合計 (簿価 \$64,375)		537,225
		普通株式 (0.6%)		
		米国 (0.6%)		
	151,515	Cineworld Group PLC		96
	290	Claire's Stores, Inc.		79,750
	34,996	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. Class A		50,744
	13,134	iHeartCommunications, Inc.		47,414
	1,748	iHeartMedia, Inc.		6,310
	919	Neiman Marcus Group Restricted		116,024
	15,278	NMG Parent LLC		1,928,847
	57,327	SAL Topco LLC		57,327
	116	Southcross Holdco		986
	1,707	Windstream Holdings II LLC		12,803
		米国合計 (簿価 \$1,487,465)		2,300,301
		普通株式合計 (簿価 \$1,487,465)		2,300,301
	元本			
		短期運用 (4.3%)		
		定期預金 (4.3%)		
		米国 (4.3%)		
		Citibank		
U S D	15,200,970	4.58% due 09/01/23		15,200,970
		定期預金合計		15,200,970
		米国合計 (簿価 \$15,200,970)		15,200,970
		短期投資合計 (簿価 \$15,200,970)		15,200,970
		投資総額 (簿価 \$362,042,570)	100.2%	\$ 356,678,698
		現金およびその他の資産を超過する負債	(0.2)	(690,330)
		純資産	100.0%	\$ 355,988,368

* バンクローンは変動金利債務です。表示されているクーポンレートは期間末時点の利率を表しています。

- (a) このポジションのすべてもしくは一部は期間末時点で未決済のローン・コミットメントを表しています。購入時の詳細は、クーポンレートを含め、決済日まで知り得ることができません。
- (b) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144A の下でSECへの届出を免除されている証券。これらの証券は、届出をしないで適格機関投資家に転売することができます。他に記載がない限り、非流動性資産とみなされることはありません。
- (c) 期限前償還条項付き証券
- (d) デフォルト証券

投資明細表のすべての有価証券は運用会社の最良の判断に基づいて有価証券の所在地ではなく、リスクの所在国によって分類されています。

ダイワ米国バンクローン・オープン

中央清算されたクレジット・デフォルト・スワップ契約（2023年8月31日現在）（純資産に占める割合 0.0%）*

通貨	想定元本	満期日	取引所	受取 (支払)	リファレンス債務	評価損益
U S D	3,513,288	6/20/2028	ICE	5.00%	CDX. NA. HY. 40-V1	\$ 134,318
						\$ 134,318

* 中央清算されたクレジット・デフォルト・スワップ契約のために、\$372,000の現金担保を差し入れました。

クラスB - J P Yクラスの外国為替先渡契約（2023年8月31日現在）（純資産に占める割合 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	純評価損益
J P Y	Barclays Bank PLC	403,236,842	09/12/2023	U S D	2,852,216	\$ -	\$ (79,423)	\$ (79,423)
J P Y	BNP Paribas	3,939,941	09/12/2023	U S D	27,174	-	(82)	(82)
U S D	BNP Paribas	24,547	09/12/2023	J P Y	3,492,075	534	-	534
						\$ 534	\$ (79,505)	\$ (78,971)

通貨の略称:

J P Y - 日本円
U S D - 米ドル

<補足情報>

当ファンド（ダイワ米国バンクローン・オープン（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・マネースtock・マザーファンド」の決算日（2023年12月11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（2024年7月19日）現在におけるダイワ・マネースtock・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・マネースtock・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2024年1月20日から2024年7月19日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
1219国庫短期証券 2024/6/24	千円 129,997,160		千円
1239国庫短期証券 2024/9/24	69,999,650		
1231国庫短期証券 2025/5/20	39,942,240		
1232国庫短期証券 2024/8/19	11,999,832		

(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

下記は、2024年7月19日現在におけるダイワ・マネースtock・マザーファンド（219,714,419千円）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

2024年7月19日現在							
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国債証券	千円 122,000,000	千円 121,947,207	% 55.5	% —	% —	% —	% 55.5

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

2024年7月19日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	1232国庫短期証券	% —	千円 12,000,000	千円 11,999,893	2024/08/19	
	1239国庫短期証券	—	70,000,000	69,999,745	2024/09/24	
	1231国庫短期証券	—	40,000,000	39,947,569	2025/05/20	
合 計	銘 柄 数	3銘柄				
	金 額		122,000,000	121,947,207		

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ・マネースtock・マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2023年12月11日)

(作成対象期間 2022年12月10日～2023年12月11日)

ダイワ・マネースtock・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。

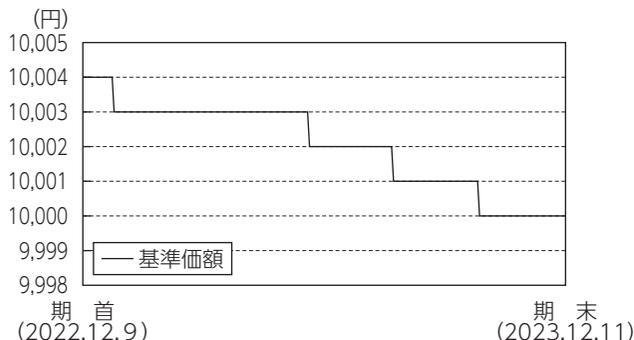
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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/>

■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		
(期首)2022年12月9日	円	%	%
	10,004	-	-
12月末	10,004	0.0	-
2023年1月1日	10,003	△0.0	-
2月末	10,003	△0.0	-
3月末	10,003	△0.0	-
4月末	10,003	△0.0	-
5月末	10,003	△0.0	-
6月末	10,002	△0.0	-
7月末	10,002	△0.0	-
8月末	10,001	△0.0	-
9月末	10,001	△0.0	-
10月末	10,000	△0.0	-
11月末	10,000	△0.0	-
(期末)2023年12月11日	10,000	△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：10,004円 期末：10,000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	-
合 計	-

(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) 項目ごとと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

2023年12月11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	224,869,425	100.0
投資信託財産総額	224,869,425	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・マネーストック・マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	224,869,425,628円
コール・ローン等	224,869,425,628
(B) 負債	1,500,000,000
未払解約金	1,500,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	223,369,425,628
元本	223,366,515,143
次期繰越損益金	2,910,485
(D) 受益権総口数	223,366,515,143口
1万口当り基準価額(C/D)	10,000円

* 期首における元本額は159,095,941,234円、当作成期間中における追加設定元本額は314,669,316,126円、同解約元本額は250,398,742,217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：

ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック	947,268円
ダイワ/ミレニアセット・インド株式ファンド - インドの匠	29,910,270円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジあり)	998円
ワールド・フィンテック革命ファンド (為替ヘッジなし)	998円
US短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/毎月決算型)	102,434円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (為替ヘッジあり)	39,849円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型)	3,985円
- ロボテック (年1回) - (為替ヘッジあり)	
iFreeレバレッジ S&P500	8,578,400,572円
iFreeレバレッジ NASDAQ100	136,597,495,537円
クリーンテック株式ファンド (資産成長型)	998,802円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド - ロボテック (毎月決算/予想分配金提示型)	999円
世界インフラ戦略ファンド (為替ヘッジなし/資産成長型)	499,501円
iFreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
iFreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
iFreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
iFreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
iFreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
iFreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
iFreeETF JPY日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
iFreeETF JPY日経400インバース・インデックス	114,002,117円
iFreeETF JPY日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
iFreeETF S&P500レバレッジ	556,085,029円
iFreeETF S&P500インバース	2,883,612,458円
先進国トータルリターン戦略ファンド (リスク抑制型/適格機関投資家専用)	207,414,601円
ダイワ日本国債15-20年ラダー型ファンド・マネーポートフォリオ - S/Lトレード	4,992,083円
ブルベア・マネー・ポートフォリオ6	25,460,730,955円
ブル3倍日本株ポートフォリオ6	11,487,636,953円
ベア2倍日本株ポートフォリオ6	3,017,601,716円
ダイワ/ハリス世界厳選株ファンド・マネー・ポートフォリオ	44,637,919円
ダイワUS短期ハイ・イールド社債ファンド (為替ヘッジあり/年1回決算型)	9,957円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジあり)	997円
ダイワ米国バンクローン・オープン (為替ヘッジなし)	997円
ダイワ/ミレニアセット亜細亜株式ファンド	4,148円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ミドル・コース	10,833円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	10,788円
通貨選択型ダイワ/ミレニアセット・グローバル好配当株α (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	12,751円
ロボット・テクノロジー関連株ファンド (年1回決算型) - ロボテック (年1回)	100,588円
ダイワ/ミレニアセット・アジア・セクターリーダー株ファンド	5,813円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,000円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月10日 至2023年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△69,335,817円
支払利息	△69,335,817
(B) 当期損益金(A)	△69,335,817
(C) 前期繰越損益金	62,057,963
(D) 解約差損益金	△51,876,027
(E) 追加信託差損益金	62,064,366
(F) 合計(B+C+D+E)	2,910,485
次期繰越損益金(F)	2,910,485

(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。