

# ダイワ高格付カナダドル債 オープン (年1回決算型)

## 運用報告書 (全体版) 第10期

(決算日 2023年5月10日)

(作成対象期間 2022年5月11日~2023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し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先 (コールセンター)  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券		
信託期間	2013年7月29日~2028年5月10日		
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンドの受益証券	
	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	内外の公社債等および短期金融商品	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSEカナダ国債インデックス (円換算)		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率			
6期末(2019年5月10日)	円 9,219	円 0	% △ 1.3	9,945	% 1.0	% 97.3	% -	百万円 3,016
7期末(2020年5月11日)	9,073	0	△ 1.6	10,130	1.9	97.6	-	2,478
8期末(2021年5月10日)	10,418	0	14.8	11,357	12.1	97.0	-	2,097
9期末(2022年5月10日)	10,820	0	3.9	11,605	2.2	96.7	-	1,497
10期末(2023年5月10日)	11,056	0	2.2	11,974	3.2	96.6	-	1,210

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) FTSEカナダ国債インデックス (円換算) は、FTSEカナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) のデータをもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSEカナダ国債インデックス (カナダ・ドルベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

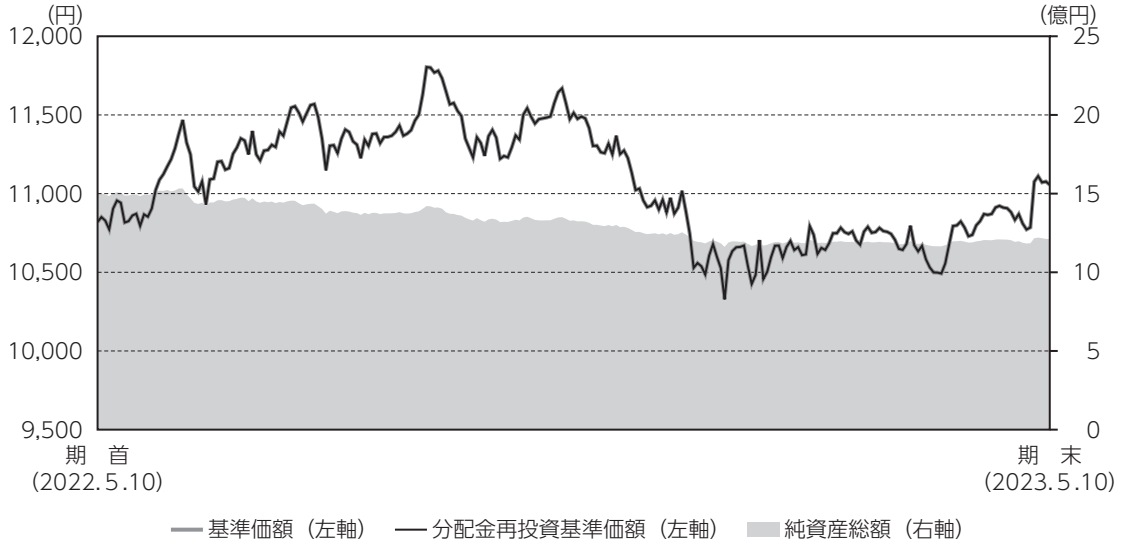
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。

\* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,820円

期末：11,056円（分配金0円）

騰落率：2.2%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

カナダ・ドル建ての債券に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことはマイナス要因となりましたが、債券の利息収入を得たことやカナダ・ドルが対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ高格付カナダドル債オープン（年1回決算型）

年 月 日	基 準 価 額		F T S E カ ナ ダ 国 債 インデックス (円換算)		公 社 債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2022年 5月10日	円 10,820	% -	11,605	% -	% 96.7	% -
5月末	11,022	1.9	11,900	2.5	96.7	-
6月末	11,351	4.9	12,137	4.6	96.5	-
7月末	11,486	6.2	12,511	7.8	97.2	-
8月末	11,368	5.1	12,297	6.0	96.7	-
9月末	11,322	4.6	12,215	5.3	96.7	-
10月末	11,644	7.6	12,489	7.6	97.0	-
11月末	11,022	1.9	11,938	2.9	96.8	-
12月末	10,527	△2.7	11,298	△2.6	96.9	-
2023年 1月末	10,641	△1.7	11,522	△0.7	97.1	-
2月末	10,789	△0.3	11,575	△0.3	96.7	-
3月末	10,794	△0.2	11,708	0.9	96.8	-
4月末	10,785	△0.3	11,693	0.8	97.0	-
(期末) 2023年 5月10日	11,056	2.2	11,974	3.2	96.6	-

(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

(2022.5.11～2023.5.10)

### ■カナダ債券市況

カナダ債券市場の金利は上昇しました。

当作成期の前半は、インフレ抑制のためにカナダ銀行（中央銀行）が積極的な利上げを実施したことや、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を受けて、カナダの金利は上昇しました。また、堅調な経済指標が発表されたことも、金利の上昇圧力となりました。当作成期の後半は、カナダ銀行が利上げを停止したことや米国の地方銀行の経営破綻を背景に米国金利が低下したことなどから、カナダの金利は低下しました。

### ■為替相場

カナダ・ドルの対円為替レートは、当作成期を通じて見ると上昇しました。

当作成期の前半は、カナダで利上げが実施され、カナダの金利が上昇する中、日本との金利差拡大が意識されたことなどから、カナダ・ドル円は上昇しました。また、堅調な経済指標が発表されたことも、カナダ・ドルの上昇を後押ししました。後半に入り、カナダの金利が低下したことでカナダと日本との金利差の縮小が意識されたことや、日銀の政策修正を背景に円高が進行したことなどから、カナダ・ドル円は下落しました。また、米国の地方銀行の経営破綻により市場のリスク回避姿勢が強まったことや原油価格が軟調に推移したことも、カナダ・ドル円の下落要因となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2022.5.11～2023.5.10)

### ■当ファンド

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」を高位に組み入れました。

### ■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

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

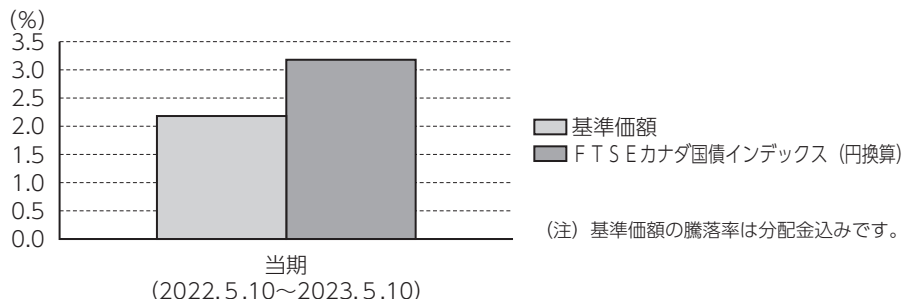
債券種別構成に関しては、カナダの州債の組入比率を高めには保ちました。

為替に関しては、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保ちました。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。当ファンドは、運用方針により、参考指数と比較して州債や事業債など国債以外の債券にも投資しているという特徴があります。参考指数はカナダの外国債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。



## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2022年5月11日 ～2023年5月10日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,291

（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。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022.5.11~2023.5.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	153円	1.381%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,062円です。
（投 信 会 社）	(61)	(0.553)	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）	(86)	(0.773)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(6)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	－	－	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	－	－	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	3	0.028	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0.020)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	156	1.409	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

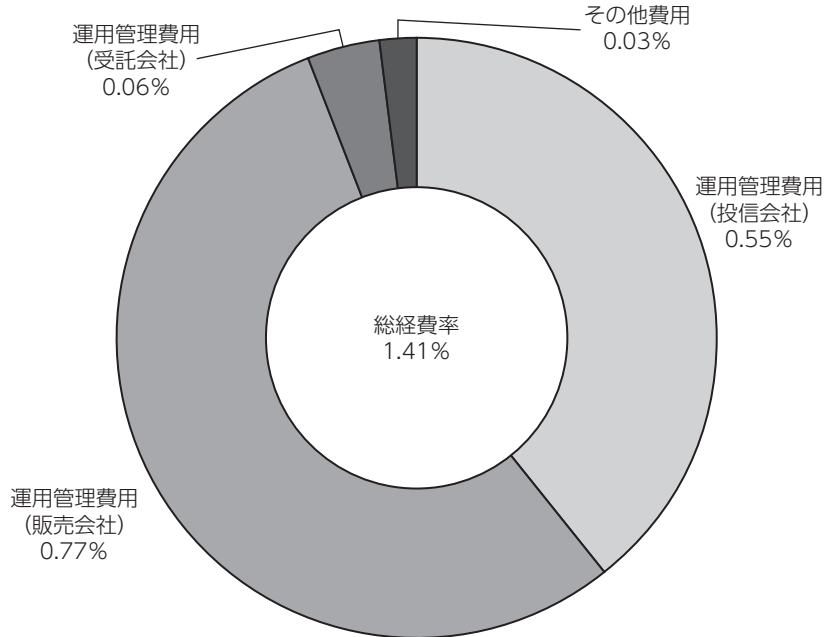
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.41%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

# ダイワ高格付カナダドル債オープン (年1回決算型)

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2022年5月11日から2023年5月10日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ高格付カナダドル債 マザーファンド	8,392	18,077	163,836	360,256

(注) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

## ■組入資産明細表

### 親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千口	千円
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	705,782	550,339	1,202,105	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	1,202,105	98.3
コール・ローン等、その他	21,244	1.7
投資信託財産総額	1,223,349	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=100.99円です。

(注3) ダイワ高格付カナダドル債マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(83,723,323千円)の投資信託財産総額(83,929,182千円)に対する比率は、99.8%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年5月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,223,349,931円
コール・ローン等	16,159,677
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド(評価額)	1,202,105,862
未収入金	5,084,392
(B) 負債	13,097,877
未払解約金	4,804,755
未払信託報酬	8,243,750
その他未払費用	49,372
(C) 純資産総額(A - B)	1,210,252,054
元本	1,094,622,293
次期繰越損益金	115,629,761
(D) 受益権総口数	1,094,622,293口
1万口当り基準価額(C/D)	11,056円

\*期首における元本額は1,384,332,874円、当作成期間中における追加設定元本額は43,250,489円、同解約元本額は332,961,070円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は11,056円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年5月11日 至2023年5月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,032円
受取利息	344
支払利息	△ 4,376
(B) 有価証券売買損益	42,904,410
売買益	57,522,494
売買損	△ 14,618,084
(C) 信託報酬等	△ 18,118,266
(D) 当期損益金(A + B + C)	24,782,112
(E) 前期繰越損益金	76,428,061
(F) 追加信託差損益金	14,419,588
(配当等相当額)	( 40,132,451)
(売買損益相当額)	(△ 25,712,863)
(G) 合計(D + E + F)	115,629,761
次期繰越損益金(G)	115,629,761
追加信託差損益金	14,419,588
(配当等相当額)	( 40,132,451)
(売買損益相当額)	(△ 25,712,863)
分配準備積立金	101,214,205
繰越損益金	△ 4,032

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

## ■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	24,783,571
(c) 収益調整金	40,132,451
(d) 分配準備積立金	76,430,634
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	141,346,656
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	141,346,656
(h) 受益権総口数	1,094,622,293口

# 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40期 (決算日 2023年5月10日)

(作成対象期間 2022年11月11日～2023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。

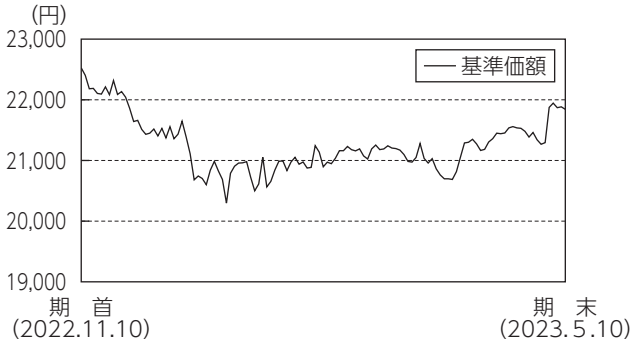
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等および短期金融商品
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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 組 比	債 先 比 率	券 物 率 率
	円	騰 落 率 %	(参考指数)	騰 落 率 %			
(期首)2022年11月10日	22,526	-	22,424	-	97.8	-	-
11月末	21,642	△3.9	21,804	△2.8	97.3	-	-
12月末	20,687	△8.2	20,634	△8.0	97.6	-	-
2023年1月末	20,938	△7.0	21,044	△6.2	97.8	-	-
2月末	21,254	△5.6	21,140	△5.7	97.4	-	-
3月末	21,289	△5.5	21,383	△4.6	97.5	-	-
4月末	21,294	△5.5	21,356	△4.8	97.6	-	-
(期末)2023年5月10日	21,843	△3.0	21,869	△2.5	97.3	-	-

- (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：22,526円 期末：21,843円 騰落率：△3.0%

【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) したことや債券の利息収入を得たことは基準価額のプラス要因となりましたが、カナダ・ドルが対円で下落 (円高) したこと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。

◆投資環境について

○カナダ債券市況

カナダ債券市場の金利は低下しました。

カナダ債券市況は、カナダ銀行 (中央銀行) が利上げを停止したことや米国の地方銀行の経営破綻を背景に米国金利が低下したことなどから、カナダの金利は低下しました。また、インフレ率の減速が確認されたことも、金利の低下要因となりました。

○為替相場

カナダ・ドルの対円為替レートは下落しました。

カナダ・ドル対円為替相場は、カナダの金利が低下したことでカナダと日本との金利差の縮小が意識されたことや、日銀の政策修正を背景に円高が進行したことなどから、下落しました。また、米国の地方銀行の経営破綻により市場のリスク回避姿勢が強まったことや原油価格が軟調に推移したことも、カナダ・ドル円の下落要因となりました。

◆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レーションを3 (年) 程度から5 (年) 程度の範囲内で変動させ、債券の種別構成や投資する債券の年限構成を決定します。為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を高位に保つ方針です。

# ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

## ■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用	2
(保管費用)	(2)
(その他)	(0)
合計	2

(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

(2022年11月11日から2023年5月10日まで)

外	カナダ	国債証券	買付額	売付額
			千カナダ・ドル	千カナダ・ドル
国	カナダ	国債証券	27,712	25,626 ( - )
		地方債証券	10,100	29,760 ( - )
		特殊債券	-	3,788 ( - )
		社債券	-	19,887 ( - )

(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

(2022年11月11日から2023年5月10日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	柄	柄	柄
金額		金額	
CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 2% 2032/6/1	千円 2,710,538	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 1.5% 2026/6/1	千円 1,396,076
ONTARIO PROVINCE (カナダ) 3.75% 2032/6/2	984,043	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 2% 2028/6/1	1,116,898
		HSBC Bank Canada (カナダ) 2.542% 2023/1/31	996,981
		Bank of Montreal (カナダ) 2.89% 2023/6/20	966,479
		ONTARIO PROVINCE (カナダ) 2.9% 2028/6/2	949,065
		Province of Alberta Canada (カナダ) 2.2% 2026/6/1	769,418
		ONTARIO PROVINCE (カナダ) 9.5% 2025/6/2	553,064
		Province of Alberta Canada (カナダ) 2.35% 2025/6/1	490,572
		CANADA HOUSING TRUST (カナダ) 2.65% 2028/12/15	380,307
		BRITISH COLUMBIA (カナダ) 9% 2024/8/23	198,872

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1) 外国(外貨建)公社債(通貨別)

作成期	当		期		末			
	額面金額	評価額		組入比率	うちB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
カナダ	千カナダ・ドル 845,822	千カナダ・ドル 807,472	千円 81,546,660	% 97.3	% -	% 32.2	% 44.5	% 20.5

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	期		末		償 還 年 月 日
			年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	5,000	4,677	472,360	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	45,000	42,645	4,306,779	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	20,000	19,110	1,929,979	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	10,000	9,643	973,876	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,000	4,462	450,672	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	46,000	42,580	4,300,237	2032/06/01
	Province of Quebec Canada	地 方 債 証 券	2.5000	67,000	64,714	6,535,530	2026/09/01
	Province of Quebec Canada	地 方 債 証 券	1.9000	35,000	31,313	3,162,345	2030/09/01
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	9.5000	2,822	3,127	315,887	2025/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.4000	65,000	62,582	6,320,221	2026/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.9000	40,000	38,943	3,932,914	2028/06/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	2.2500	10,000	8,991	908,041	2031/12/02
	ONTARIO PROVINCE	地 方 債 証 券	3.7500	45,000	45,289	4,573,816	2032/06/02
	PROVINCE OF SASKATCHEWAN	地 方 債 証 券	8.7500	2,000	2,182	220,410	2025/05/30
	Province of Alberta Canada	地 方 債 証 券	2.2000	55,000	52,617	5,313,886	2026/06/01
	Province of Alberta Canada	地 方 債 証 券	3.3000	6,000	5,191	524,338	2046/12/01
	Province of Alberta Canada	地 方 債 証 券	2.3500	20,000	19,370	1,956,257	2025/06/01
	PROVINCE OF ALBERTA CANADA	地 方 債 証 券	1.6500	13,000	11,209	1,132,074	2031/06/01
	PSP Capital Inc	特 殊 債 券	3.0000	15,000	14,684	1,482,962	2025/11/05
	CPPIB Capital Inc	特 殊 債 券	3.0000	15,000	14,666	1,481,190	2028/06/15
	CANADA HOUSING TRUST	特 殊 債 券	1.9000	35,000	31,515	3,182,775	2031/03/15
	Toronto-Dominion Bank/The	社 債 券	3.2260	15,000	14,720	1,486,658	2024/07/24
	Toronto-Dominion Bank/The	社 債 券	1.9090	25,000	24,865	2,511,141	2023/07/18
	NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING	社 債 券	2.0000	55,000	49,351	4,984,007	2028/04/17
	Apple Inc	社 債 券	2.5130	57,000	55,475	5,602,503	2024/08/19
	Canadian Imperial Bank of Commerce/Canad	社 債 券	3.3000	45,000	43,954	4,438,934	2025/05/26
	Canadian Imperial Bank of Commerce/Canad	社 債 券	2.9700	10,000	9,969	1,006,769	2023/07/11
	Bank of Montreal	社 債 券	2.7000	55,000	53,517	5,404,702	2024/09/11
	BANK OF MONTREAL	社 債 券	3.1900	10,000	9,538	963,283	2028/03/01
	BANK OF MONTREAL	社 債 券	2.7000	5,000	4,731	477,793	2026/12/09
	Royal Bank of Canada	社 債 券	2.3330	12,000	11,826	1,194,307	2023/12/05
合 計	銘 柄 数 金 額	31銘柄		845,822	807,472	81,546,660	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2023年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	81,546,660	97.2
コール・ローン等、その他	2,382,521	2.8
投資信託財産総額	83,929,182	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=100.99円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(83,723,323千円)の投資信託財産総額(83,929,182千円)に対する比率は、99.8%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年5月10日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>84,204,415,634円</b>
コール・ローン等	1,087,902,473
公社債(評価額)	81,546,660,378
未収入金	764,503,041
未収利息	680,541,008
前払費用	17,880,763
差入委託証拠金	106,927,971
<b>(B) 負債</b>	<b>369,609,753</b>
未払金	275,323,118
未払解約金	94,286,635
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>83,834,805,881</b>
元本	38,381,327,224
次期繰越損益金	45,453,478,657
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>38,381,327,224口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>21,843円</b>

\* 期首における元本額は40,627,928,614円、当作成期間中における追加設定元本額は24,194,607円、同解約元本額は2,270,795,997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)	144,392,683円
常陽3分法ファンド	54,786,924円
ダイワ高格付カナダドル債オープン (年1回決算型)	550,339,176円
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)	33,310,985円
ダイワ世界債券ファンドVA (適格機関投資家専用)	6,070,957円
ダイワ世界債券ファンド (毎月分配型)	1,398,683,302円
ダイワ・グローバル債券ファンド (年2回決算型)	23,387,726円
ダイワ世界債券ファンド (年2回決算型)	2,217,712円
ダイワ高格付カナダドル債オープン (毎月分配型)	30,762,892,263円
ダイワ・グローバル債券ファンド (毎月分配型)	5,405,245,496円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,843円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年11月11日 至2023年5月10日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>1,104,519,901円</b>
受取利息	1,102,747,573
その他収益金	1,811,427
支払利息	△ 39,099
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 3,989,792,145</b>
売買益	2,177,240,429
売買損	△ 6,167,032,574
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 6,679,651</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 2,891,951,895</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>50,889,262,734</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 2,570,535,528</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>26,703,346</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>45,453,478,657</b>
<b>次期繰越損益金(H)</b>	<b>45,453,478,657</b>

(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。