

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18期

(決算日 2024年1月19日)

(作成対象期間 2023年7月20日~2024年1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 (分配落)	額		公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
		税込み 分配金	期中騰 落率			
	円	円	%	%	%	百万円
14期末(2022年1月19日)	8,169	140	1.0	—	99.0	466
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

(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。

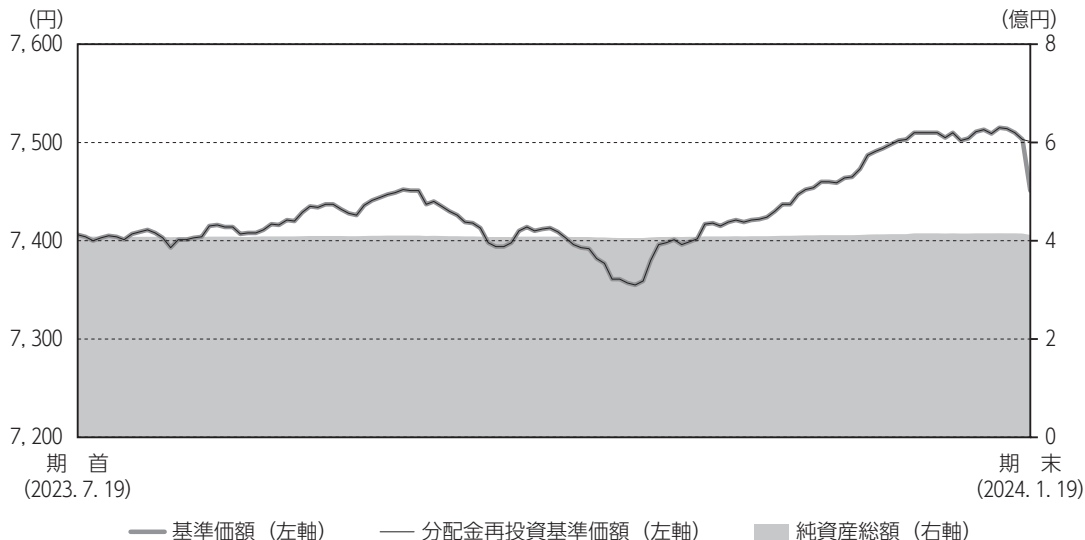
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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：7,406円

期末：7,451円（分配金50円）

騰落率：1.3%（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) 2023年 7月19日	7,406	—	—	99.0
7月末	7,409	0.0	—	99.3
8月末	7,435	0.4	—	99.3
9月末	7,419	0.2	—	99.4
10月末	7,357	△ 0.7	—	99.5
11月末	7,437	0.4	—	99.5
12月末	7,505	1.3	—	99.4
(期末) 2024年 1月19日	7,501	1.3	—	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

（2023. 7. 20 ~ 2024. 1. 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、当作成期首より、物価指標の下振れによりインフレ警戒感が後退したことなどから、上昇しました。2023年10月に入ると、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、米国長期金利の上昇などが嫌気され、下落しました。しかし11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、F R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言を受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇して当作成期末を迎えました。

■短期金利市況

日銀は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」の枠組みを継続し、短期金利は低位で推移しました。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. 00～5. 25%から5. 25～5. 50%に上げました。

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

（2023. 7. 20 ~ 2024. 1. 19）

■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 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ーシニア・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ーシニア・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、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	
	2023年7月20日 ～2024年1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）	857

- (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	✓	271.86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		116.48
(d) 分配準備積立金		519.39
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		907.74
(f) 分配金		50.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		857.74

- (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 (2023. 7. 20～2024. 1. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.594%	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7,432円です。
（投 信 会 社）	(14)	(0.193)	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)	(0.387)	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	0.598	

(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。

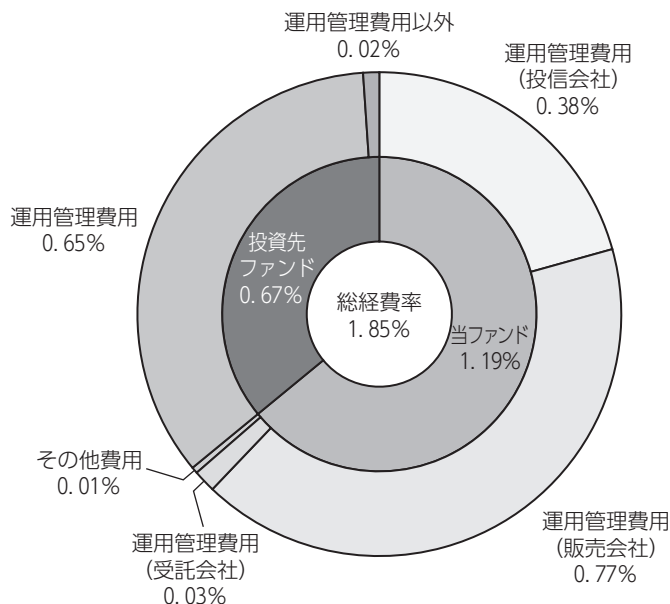
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.85%です。



総経費率 (① + ② + ③)	1.85%
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	0.65%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02%

(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

（2023年7月20日から2024年1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 JPY CLASS （ケイマン諸島）	千口 270.99129	千円 17,485	千口 74.27708	千円 4,770

（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。

■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 JPY CLASS	千口 6,354.85559	千円 407,581	% 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1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 407,581	% 97.8
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	9,286	2.2
投資信託財産総額	416,868	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1月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	416,868,975円
コール・ローン等	9,286,606
投資信託受益証券（評価額）	407,581,372
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド（評価額）	997
(B) 負債	5,215,101
未払収益分配金	2,762,563
未払信託報酬	2,435,631
その他未払費用	16,907
(C) 純資産総額（A－B）	411,653,874
元本	552,512,725
次期繰越損益金	△ 140,858,851
(D) 受益権総口数	552,512,725口
1万口当り基準価額（C/D）	7,451円

* 期首における元本額は551,695,056円、当作成期間中における追加設定元本額は3,432,424円、同解約元本額は2,614,755円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は7,451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140,858,851円です。

■損益の状況

当期 自 2023年7月20日 至 2024年1月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	17,473,533円
受取配当金	17,474,058
支払利息	△ 525
(B) 有価証券売買損益	△ 9,832,228
売買益	8,918
売買損	△ 9,841,146
(C) 信託報酬等	△ 2,452,538
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	5,188,767
(E) 前期繰越損益金	△ 130,652,652
(F) 追加信託差損益金	△ 12,632,403
(配当等相当額)	(6,436,034)
(売買損益相当額)	(△ 19,068,437)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 138,096,288
(H) 収益分配金	△ 2,762,563
次期繰越損益金 (G + H)	△ 140,858,851
追加信託差損益金	△ 12,632,403
(配当等相当額)	(6,436,034)
(売買損益相当額)	(△ 19,068,437)
分配準備積立金	40,955,543
繰越損益金	△ 169,181,991

- (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	15,020,995円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	6,436,034
(d) 分配準備積立金	28,697,111
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	50,154,140
(f) 分配金	2,762,563
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	47,391,577
(h) 受益権総口数	552,512,725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 (分配落)	額		公社債 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	純資産額
		税込み 分配金	期中騰 落率			
14期末(2022年1月19日)	円 8,106	円 140	% 5.2	% —	% 99.0	百万円 89
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

(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。

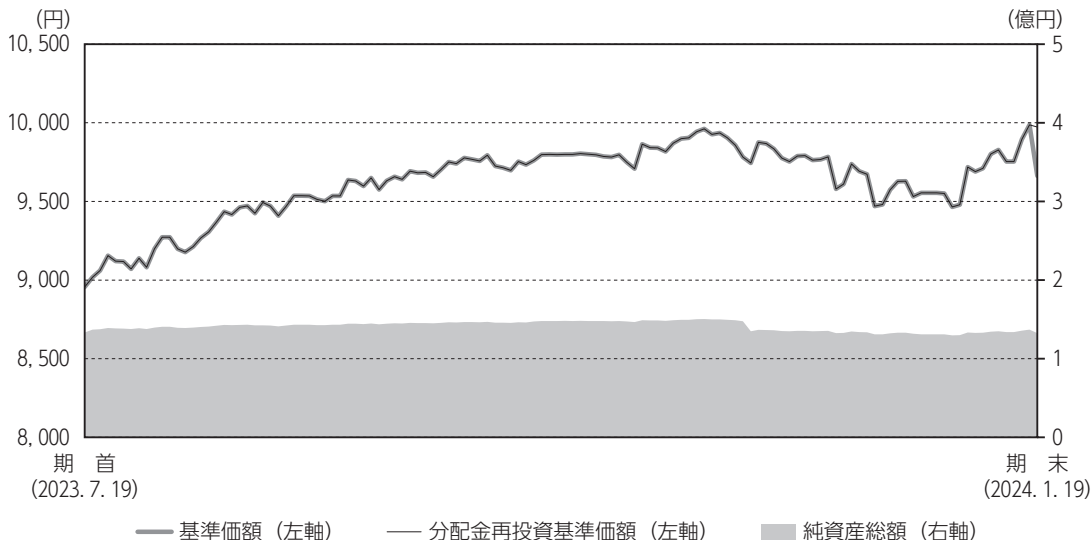
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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：8,956円

期末：9,663円（分配金310円）

騰落率：11.4%（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、米ドル円為替相場が上昇（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) 2023年 7月19日	8,956	—	—	99.0
7月末	9,081	1.4	—	99.1
8月末	9,513	6.2	—	99.0
9月末	9,768	9.1	—	99.2
10月末	9,708	8.4	—	98.6
11月末	9,753	8.9	—	98.9
12月末	9,465	5.7	—	99.0
(期末) 2024年 1月19日	9,973	11.4	—	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

（2023. 7. 20 ~ 2024. 1. 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、当作成期首より、物価指標の下振れによりインフレ警戒感が後退したことなどから、上昇しました。2023年10月に入ると、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、米国長期金利の上昇などが嫌気され、下落しました。しかし11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、F R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言を受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇して当作成期末を迎えました。

■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、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、上昇しました。しかし2023年11月以降は、米国金利の大幅な低下を背景に日米金利差の縮小が意識され、米ドルは対円で下落（円高）しました。2024年1月に入ると、市場予想を上回る米国経済指標の発表やF R B（米国連邦準備制度理事会）高官の利下げに対する発言などから、米ドルは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」

■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

（2023. 7. 20 ~ 2024. 1. 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、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	
	2023年7月20日 ～2024年1月19日	
当期分配金（税込み）	（円）	310
対基準価額比率	（％）	3.11
当期の収益	（円）	310
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	463

- (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	✓	384.14円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		118.13
(c) 収益調整金		271.65
(d) 分配準備積立金		0.00
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		773.93
(f) 分配金		310.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		463.93

- (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 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。

■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

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 (2023. 7. 20～2024. 1. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	57円	0.594%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,627円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.194)	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)	(37)	(0.387)	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	58	0.598	

(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。

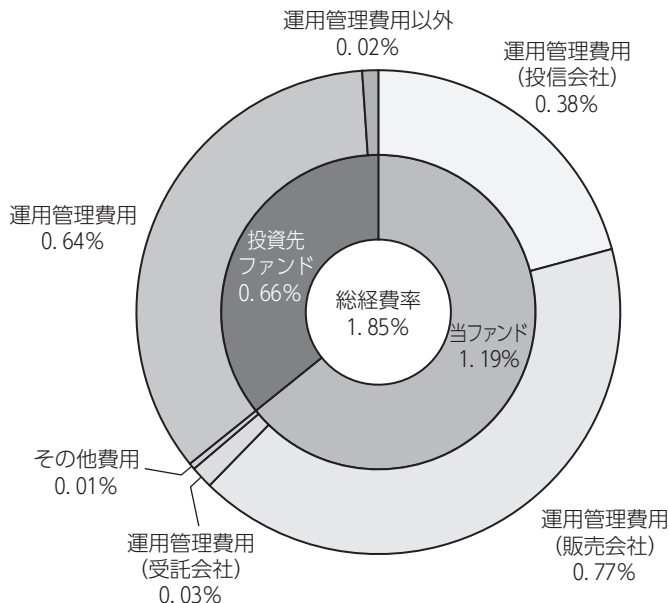
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.85%です。



総経費率（① + ② + ③）	1.85%
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	0.64%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02%

(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

（2023年7月20日から2024年1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 79.62666	千円 8,585	千口 175.08792	千円 19,230

（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。

■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 1,181.7267	千円 131,211	% 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	期 首	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1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 131,211	% 95.4
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	6,377	4.6
投資信託財産総額	137,590	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1月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	137,590,358円
コール・ローン等	6,377,519
投資信託受益証券（評価額）	131,211,842
ダイワ・マネースtock・ マザーファンド（評価額）	997
(B) 負債	5,094,364
未払収益分配金	4,250,460
未払解約金	197
未払信託報酬	837,948
その他未払費用	5,759
(C) 純資産総額（A－B）	132,495,994
元本	137,111,643
次期繰越損益金	△ 4,615,649
(D) 受益権総口数	137,111,643口
1万口当り基準価額（C/D）	9,663円

* 期首における元本額は148,717,629円、当作成期間中における追加設定元本額は4,333,503円、同解約元本額は15,939,489円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,663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4,615,649円です。

■損益の状況

当期 自 2023年7月20日 至 2024年1月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	5,587,818円
受取配当金	5,588,058
支払利息	△ 240
(B) 有価証券売買損益	9,110,878
売買益	9,914,426
売買損	△ 803,548
(C) 信託報酬等	843,707
(D) 当期損益金 (A + B + C)	13,854,989
(E) 前期繰越損益金	△ 6,968,248
(F) 追加信託差損益金	△ 7,251,930
（配当等相当額）	（ 3,724,764）
（売買損益相当額）	（△ 10,976,694）
(G) 合計 (D + E + F)	△ 365,189
(H) 収益分配金	△ 4,250,460
次期繰越損益金 (G + H)	△ 4,615,649
追加信託差損益金	△ 7,251,930
（配当等相当額）	（ 3,724,764）
（売買損益相当額）	（△ 10,976,694）
分配準備積立金	2,636,281

(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	5,267,041円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,619,700
(c) 収益調整金	3,724,764
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	10,611,505
(f) 分配金	4,250,460
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,361,045
(h) 受益権総口数	137,111,643口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

310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
2022年8月31日現在

資産	
投資資産の評価額（簿価 \$472,338,071）	\$ 458,923,477
現金	87,266
中央清算デリバティブ取引のためのブローカへの預入金	1,981,773
外国為替先渡取引による評価益	236
未取：	
売却済みの投資	5,876,233
利息	2,761,320
決済済み外国為替先渡取引	415
資産合計	<u>469,630,720</u>
負債	
外国為替先渡取引による評価損	130,646
未決済ローン・コミットメントによる評価損	27,261
未払：	
購入済みの投資	16,801,530
投資運用会社報酬	997,354
専門家報酬	95,204
会計および管理会社報酬	89,518
運用会社報酬	32,725
保管会社報酬	20,329
名義書換代理人報酬	2,988
その他負債	37,259
負債合計	<u>18,234,814</u>
純資産	<u>\$ 451,395,906</u>
純資産	
クラス A - U S D クラス	\$ 448,377,315
クラス B - J P Y クラス	3,018,591
	<u>\$ 451,395,906</u>
発行済み受益証券口数	
クラス A - U S D クラス	605,120,961
クラス B - J P Y クラス	6,135,517
受益証券1口当り純資産額	
クラス A - U S D クラス	\$ 0.741
クラス B - J P Y クラス	\$ 0.492

損益計算書

2022年8月31日に終了する年度

投資収益

受取利息	\$	24,617,460
配当収益（源泉徴収税 \$80,766控除後）		171,754
その他収益		39,740
投資収益合計		24,828,954

費用

投資運用会社報酬		2,868,307
会計および管理会社報酬		439,487
保管会社報酬		155,538
専門家報酬		94,954
名義書換代理人報酬		55,160
運用会社報酬		55,160
受託会社報酬		10,000
登録料		8,344
費用合計		3,686,950

投資利益

21,142,004

実現損益および評価損益の変動：

実現損益：

証券投資	(8,638,989)
スワップ取引の評価額	(1,214,680)
外国為替取引および外国為替先渡取引	(1,876,376)
実現損失	(11,730,045)

評価損益の変動の内訳：

証券投資	(18,922,681)
未決済ローン・コミットメント	(27,288)
スワップ取引の評価額	(48,332)
外国為替換算および外国為替先渡取引	(123,589)
評価損益の変動	(19,121,890)

実現損益および評価損益

(30,851,935)

運用による純資産の増減額

\$ (9,709,931)

ダイワ米国バンクローン・オープン

投資明細表
2022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 (86.2%)*		
		カナダ (2.9%)		
		バンクローン (2.2%)		
U S D	2,750,000	Bausch Health Companies, Inc. due 02/01/27 (a)		\$ 2,186,250
U S D	850,000	Garda World Security Corp. 7.24% due 10/30/26		824,857
U S D	1,305,508	Kestrel Bidco, Inc. 5.03% due 12/11/26		1,191,041
U S D	2,401,403	Knowlton Development Corp., Inc. 6.27% due 12/22/25		2,281,333
U S D	1,192,199	NorthRiver Midstream Finance LP 5.53% due 10/01/25		1,174,316
U S D	2,209,929	Titan Acquisition Ltd. 5.88% due 03/28/25		2,096,979
		バンクローン合計		9,754,776
		社債 (0.7%)		
U S D	1,000,000	Bausch Health Cos, Inc. 5.50% due 11/01/25 (b) (c)		830,000
U S D	400,000	Garda World Security Corp. 4.63% due 02/15/27 (b) (c)		351,560
U S D	2,210,000	NOVA Chemicals Corp. 5.00% due 05/01/25 (b) (c)		2,078,495
		社債合計		3,260,055
		カナダ合計 (簿価 \$14,071,654)		13,014,831
		ドイツ (0.3%)		
		バンクローン (0.3%)		
U S D	1,468,471	TK Elevator Midco GmbH 6.87% due 07/30/27		1,423,507
		バンクローン合計		1,423,507
		ドイツ合計 (簿価 \$1,457,099)		1,423,507
		ルクセンブルク (3.9%)		
		バンクローン (3.9%)		
U S D	1,402,000	Altice Financing S. A. 5.26% due 07/15/25		1,360,908
U S D	1,996,154	Cobham Ultra SeniorCo Sarl 7.06% due 08/06/29		1,925,051
U S D	1,668,617	Icon Public Ltd. Co. 4.56% due 07/03/28		1,640,668
U S D	2,737,295	Intelsat Jackson Holdings S. A. 7.44% due 02/01/29 (a)		2,589,016
U S D	2,383,244	Jazz Pharmaceuticals Public Ltd. Co. 6.02% due 05/05/28		2,334,721
		Summer (BC) Bidco B LLC		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	957,054	6.75% due 12/04/26 Sunshine Luxembourg VII Sarl		923,557
U S D	6,947,211	6.00% due 10/01/26 (a) バンクローン合計 ルクセンブルグ合計 (簿価 \$18,006,278) オランダ (0.3%) 社債 (0.3%) Trivium Packaging Finance BV		6,682,383
				17,456,304
				17,456,304
U S D	1,250,000	5.50% due 08/15/26 (b) (c) 社債合計 オランダ合計 (簿価 \$1,243,878) 英国 (0.8%) バンクローン (0.8%) Formula One Management Ltd.		1,200,000
				1,200,000
				1,200,000
U S D	1,098,145	5.02% due 02/01/24 INEOS Enterprises Holdings Ltd.		1,087,624
U S D	2,777,000	6.57% due 08/28/26 バンクローン合計 英国合計 (簿価 \$3,873,936) 米国 (78.0%) バンクローン (64.6%) ACProducts Holdings, Inc.		2,724,931
				3,812,555
				3,812,555
U S D	1,352,669	6.50% due 05/17/28 Adient US LLC		1,104,454
U S D	2,583,414	5.77% due 04/10/28 Alliance Laundry Systems LLC		2,526,914
U S D	3,652,958	5.96% due 10/08/27 Allied Universal Holdco LLC		3,572,593
U S D	1,872,781	6.27% due 05/12/28 Altar Bidco, Inc.		1,784,068
U S D	3,503,529	5.51% due 02/01/29 (a)		3,359,745
U S D	765,000	7.35% due 02/01/30 American Axle & Manufacturing, Inc.		694,238
U S D	1,282,464	4.70% due 04/06/24 APi Group DE, Inc.		1,261,226
U S D	2,190,058	5.02% due 10/01/26 Arches Buyer, Inc.		2,153,791
U S D	3,188,523	5.77% due 12/06/27 Astoria Energy LLC		3,005,853
U S D	1,095,830	6.02% due 12/10/27 Asurion LLC		1,074,735
U S D	1,769,002	5.52% due 11/03/24 (a)		1,698,560
U S D	730,750	5.77% due 07/31/27		667,416
U S D	653,200	6.40% due 08/19/28		608,567

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	1,765,000	7.77% due 01/31/28 Avantor Funding, Inc.		1,509,075
U S D	2,673,400	4.77% due 11/08/27 AZZ, Inc.		2,625,786
U S D	2,458,838	6.91% due 05/13/29 B&G Foods, Inc.		2,430,143
U S D	1,210,031	5.02% due 10/10/26 BK LC Lux SPV Sarl		1,152,929
U S D	2,180,494	5.10% due 04/28/28 Brookfield WEC Holdings, Inc.		2,101,451
U S D	2,813,237	5.27% due 08/01/25 Buckeye Partners LP		2,742,568
U S D	533,578	4.62% due 11/01/26 BWay Holding Co.		524,604
U S D	2,638,482	5.62% due 04/03/24 Caesars Resort Collection LLC		2,578,642
U S D	3,443,823	5.27% due 12/23/24 Calpine Construction Finance Co. LP		3,395,300
U S D	1,719,821	4.52% due 01/15/25 Camelot U. S. Acquisition 1 Co.		1,684,358
U S D	1,715,944	5.52% due 10/30/26 Carroll County Energy LLC		1,668,755
U S D	1,049,380	5.75% due 02/16/26 Chariot Buyer LLC		983,468
U S D	1,996,834	6.02% due 11/03/28 Cincinnati Bell, Inc.		1,896,993
U S D	2,288,480	5.81% due 11/22/28 Claire's Stores, Inc.		2,237,470
U S D	226,493	9.02% due 12/18/26 Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.		213,922
U S D	5,659,457	6.31% due 08/21/26 Commscope, Inc.		5,229,508
U S D	3,593,344	5.77% due 04/06/26 Conair Holdings LLC		3,439,513
U S D	2,954,283	6.00% due 05/17/28 Conservice Midco LLC		2,540,684
U S D	2,665,282	6.77% due 05/13/27 CSC Holdings LLC		2,585,324
U S D	4,205,126	4.64% due 07/17/25		4,065,852
U S D	4,498	4.64% due 01/15/26 Curia Global, Inc.		4,348
U S D	2,279,172	6.56% due 08/30/26 DCert Buyer, Inc.		2,193,703
U S D	693,227	6.90% due 10/16/26		673,394

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	915,000	9.90% due 02/19/29 Deerfield Dakota Holding LLC		867,420
U S D	1,333,365	6.21% due 04/09/27 DexKo Global, Inc.		1,297,538
U S D	1,861,583	6.00% due 10/04/28 Diamond Sports Group LLC		1,777,812
U S D	2,158,260	5.64% due 08/24/26 DIRECTV Financing LLC		391,573
U S D	2,223,318	7.52% due 08/02/27 (a) Dun & Bradstreet Corp.		2,122,712
U S D	995,284	5.74% due 02/06/26 E. W. Scripps Co.		965,923
U S D	1,613,794	5.27% due 01/07/28 Ecovyst Catalyst Technologies LLC		1,588,715
U S D	1,841,663	5.31% due 06/09/28 Endo Luxembourg Finance Co. I Sarl (d)		1,801,146
U S D	1,138,264	11.50% due 03/27/28 Ensemble RCM LLC		991,713
U S D	1,206,674	6.56% due 08/03/26 Entegris, Inc.		1,176,760
U S D	1,810,000	5.69% due 07/06/29 Envision Healthcare Corp.		1,804,190
U S D	2,321,370	6.33% due 03/31/27		568,736
U S D	948,804	6.83% due 03/31/27 ExGen Renewables IV LLC		474,402
U S D	1,789,235	5.57% due 12/15/27 FGI Operating Co. LLC		1,763,040
U S D	246,613	12.25% due 05/16/22 First Student Bidco, Inc.		26,881
U S D	2,943,474	5.23% due 07/21/28 Gates Global LLC		2,825,735
U S D	2,413,438	5.02% due 03/31/27 Gemini HDPE LLC		2,362,418
U S D	2,717,417	5.81% due 12/31/27 Genesee & Wyoming, Inc.		2,664,428
U S D	1,961,318	4.25% due 12/30/26 (a) Getty Images, Inc.		1,916,738
U S D	1,125,000	due 02/19/26 (a) GI Consilio Parent LLC		1,112,580
U S D	2,766,457	6.52% due 05/12/28 GoodRx, Inc.		2,660,750
U S D	2,957,507	5.27% due 10/10/25 Graham Packaging Co., Inc.		2,879,872
U S D	1,823,734	5.52% due 08/04/27 Gray Television, Inc.		1,778,141

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	404,840	4.87% due 02/07/24		401,355
U S D	906,024	4.87% due 01/02/26		888,701
U S D	962,436	5.37% due 12/01/28		946,624
U S D	4,081,969	Greeneden U. S. Holdings I LLC 6.52% due 12/01/27 Griffon Corp.		4,006,167
U S D	1,351,096	5.49% due 01/24/29 Harsco Corp.		1,311,684
U S D	738,997	4.81% due 03/10/28 Helios Software Holdings, Inc.		693,423
U S D	1,625,238	5.95% due 03/11/28 Hercules Achievement, Inc. (Varsity Brands Holding Co., Inc.)		1,562,943
U S D	1,200,000	6.02% due 12/16/24 Hertz Corp.		1,162,248
U S D	3,521,340	5.78% due 06/30/28 Homer City Generation LP		3,432,743
U S D	108,646	due 04/05/23 Hostess Brands LLC		54,323
U S D	886,263	4.77% due 08/03/25 Hub International Ltd.		872,597
U S D	1,881,260	5.77% due 04/25/25 Hyland Software, Inc.		1,839,721
U S D	1,315,793	6.02% due 07/01/24 iHeartCommunications, Inc.		1,297,464
U S D	2,234,304	5.52% due 05/01/26		2,156,506
U S D	2,012,858	5.77% due 05/01/26 (a) Indy US Bidco LLC		1,943,414
U S D	1,556,553	6.27% due 03/06/28 Ineos US Finance LLC		1,485,216
U S D	1,316,700	due 11/08/28 (a) Ingram Micro, Inc.		1,290,089
U S D	1,605,872	5.75% due 06/30/28 Insulet Corp.		1,541,637
U S D	3,759,649	5.77% due 05/04/28 (a) Invenergy Thermal Operating I LLC		3,665,657
U S D	980,783	6.32% due 08/28/25 IRB Holding Corp.		953,811
U S D	1,018,310	5.27% due 02/05/25		995,825
U S D	1,846,875	5.39% due 12/15/27 LABL, Inc.		1,784,155
U S D	2,687,193	7.52% due 10/29/28 Leslie's Poolmart, Inc.		2,588,519
U S D	2,345,846	5.02% due 03/09/28 LifePoint Health, Inc.		2,300,595
U S D	2,466,917	6.27% due 11/16/25		2,387,507

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,410,335	LogMeIn, Inc. 7.12% due 08/31/27		1,094,420
U S D	2,839,846	Madison IAQ LLC 4.52% due 06/21/28		2,735,708
U S D	1,748,397	MED Parentco LP 6.77% due 08/31/26		1,546,248
U S D	1,512,149	Medallion Midland Acquisition LLC 6.27% due 10/18/28		1,487,576
U S D	3,806,663	Medline Borrower LP 5.77% due 10/23/28 (a)		3,625,161
U S D	884,771	MetroNet Systems Holdings LLC 6.18% due 06/02/28		854,689
U S D	2,084,051	MH Sub I LLC (Micro Holding Corp.) 6.27% due 09/13/24		2,030,220
U S D	762,060	MI Windows and Doors LLC 6.06% due 12/18/27		747,581
U S D	1,445,366	Mirion Technologies (US Holdings) , Inc. 5.63% due 10/20/28		1,413,756
U S D	195,885	Moran Foods LLC due 04/01/24		166,502
U S D	1,504,711	9.25% due 04/01/24		1,279,004
U S D	914,959	13.00% due 10/01/24		561,172
U S D	1,929,234	NAI Entertainment Holdings LLC 5.03% due 05/08/25		1,890,650
U S D	1,385,000	Naked Juice LLC 5.40% due 01/24/29		1,325,639
U S D	2,899,300	Netsmart, Inc. 6.52% due 10/01/27		2,822,585
U S D	519,412	Nexstar Broadcasting, Inc. 5.02% due 09/18/26		514,545
U S D	1,785,908	Numericable US LLC 6.20% due 01/31/26		1,723,955
U S D	637,795	Olympus Water US Holding Corp. 6.06% due 11/09/28		612,583
U S D	1,721,350	Option Care Health, Inc. 5.27% due 10/27/28		1,700,918
U S D	1,426,681	Osiose Utilities Services, Inc. 5.77% due 06/23/28		1,356,360
U S D	2,673,395	Packaging Coordinators Midco, Inc. 6.00% due 11/30/27		2,599,048
U S D	2,849,914	Pactiv Evergreen, Inc. 5.77% due 02/05/26		2,776,301
U S D	649,467	6.02% due 09/24/28		630,912
U S D	4,103,095	Parexel International Corp. 5.77% due 08/11/28 (a)		3,990,260

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	1,936,804	Park River Holdings, Inc. 5.53% due 12/28/27		1,755,229
U S D	2,095,189	Pathway Vet Alliance LLC 6.00% due 11/01/2026		1,972,621
U S D	4,145,262	Petco Health and Wellness Co., Inc. 5.50% due 03/03/28 (a)		4,013,153
U S D	400,188	PetVet Care Centers LLC 5.27% due 02/14/25		383,680
U S D	3,310,446	PG&E Corp. 6.02% due 02/14/25		3,200,108
U S D	1,306,233	Pike Corp. 5.56% due 06/23/25		1,279,299
U S D	2,483,547	5.53% due 01/21/28		2,424,961
U S D	755,000	5.81% due 01/21/28		741,788
U S D	1,546,125	Pre-Paid Legal Services, Inc. 6.82% due 12/15/28		1,502,648
U S D	2,994,474	Prime Security Services Borrower LLC 5.11% due 09/23/26		2,921,020
U S D	2,260,395	Project Boost Purchaser LLC 6.02% due 06/01/26		2,188,808
U S D	1,825,819	Proofpoint 6.32% due 06/09/28		1,754,155
U S D	2,675,000	Quest Software US Holdings, Inc. 6.98% due 02/01/29		2,424,593
U S D	356,693	Quidditch Acquisition, Inc. 9.52% due 03/21/25		349,559
U S D	2,225,256	QUIKRETE Holdings, Inc. 5.52% due 05/22/28		2,149,108
U S D	2,302,600	RealPage, Inc. 5.52% due 04/24/28		2,212,085
U S D	742,192	Red Ventures LLC 5.02% due 11/08/24		726,888
U S D	1,723,863	Ring Container Technologies Group LLC 6.27% due 08/12/28 (a)		1,688,661
U S D	1,301,800	Sabre GLBL, Inc. 6.02% due 12/17/27		1,217,183
U S D	1,364,382	Shearer's Foods LLC 6.02% due 09/23/27		1,317,270
U S D	1,658,150	Shutterfly LLC 7.25% due 09/25/26		1,248,454
U S D	2,674,228	Signal Parent, Inc. 6.02% due 04/03/28		2,005,671
U S D	2,947,439	SP PF Buyer LLC 7.02% due 12/22/25		2,471,339
		Spin Holdco, Inc.		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,641,127	5.61% due 03/04/28 SPX Flow, Inc.		1,538,556
U S D	1,645,000	7.06% due 04/05/29 (a) SRS Distribution, Inc.		1,558,638
U S D	1,777,141	6.18% due 06/02/28 Staples, Inc.		1,706,055
U S D	1,875,172	7.78% due 04/16/26 Star US Bidco LLC		1,647,132
U S D	2,613,708	6.77% due 03/17/27 Synaptics, Inc.		2,489,557
U S D	2,379,914	4.36% due 12/02/28 Team Health Holdings, Inc.		2,359,089
U S D	1,573,677	7.71% due 03/02/27 Tekni-Plex, Inc.		1,395,332
U S D	132,963	6.25% due 07/29/28		128,448
U S D	1,491,291	6.25% due 07/29/28 Tenneco, Inc.		1,440,647
U S D	2,101,524	5.52% due 10/01/25 TGP Holdings III LLC		2,073,069
U S D	39,721	5.77% due 06/29/28		31,601
U S D	1,204,970	5.77% due 06/29/28 ThoughtWorks, Inc.		958,638
U S D	2,326,859	5.27% due 03/24/28 (a) Trans Union LLC		2,305,056
U S D	1,397,967	4.77% due 12/01/28 (a) TransDigm, Inc.		1,370,260
U S D	1,013,422	4.77% due 08/22/24		993,498
U S D	922,994	4.77% due 05/30/25		900,011
U S D	415,822	4.77% due 12/09/25 Triton Water Holdings, Inc.		404,441
U S D	2,470,345	5.75% due 03/31/28 Truck Hero, Inc.		2,305,449
U S D	1,743,606	6.02% due 01/31/28 TTM Technologies, Inc.		1,582,916
U S D	111,275	4.87% due 09/28/24 UFC Holdings LLC		110,580
U S D	1,639,300	5.52% due 04/29/26 UKG Inc.		1,590,121
U S D	2,560,698	5.54% due 05/04/26 Ultimate Software Group, Inc.		2,477,014
U S D	1,132,877	6.27% due 05/04/26 United Natural Foods, Inc.		1,101,870
U S D	1,395,962	5.82% due 10/22/25 University Support Services LLC		1,380,983
U S D	1,888,797	5.77% due 02/10/29		1,823,634

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	1,199,523	Univision Communications, Inc. 5.77% due 03/15/26		1,169,967
U S D	1,486,196	US Renal Care, Inc. 7.56% due 06/26/26		1,127,651
U S D	1,521,333	USI, Inc. 5.25% due 05/16/24		1,501,997
U S D	1,387,803	Utz Quality Foods LLC 5.52% due 01/20/28		1,359,006
U S D	2,196,495	Vertex Aerospace Services Corp. 6.27% due 12/06/28		2,164,470
U S D	2,827,341	Vertiv Group Corp. 5.11% due 03/02/27		2,720,128
U S D	933,188	Virtusa Corp. 6.27% due 02/11/28		908,691
U S D	441,100	WCG Purchaser Corp. 6.31% due 02/15/29		429,248
U S D	4,522,783	Whatabrands LLC 6.35% due 01/08/27		4,409,713
U S D	2,636,750	Wheel Pros, Inc. 5.77% due 08/03/28		2,495,842
U S D	2,479,066	White Cap Buyer LLC 6.87% due 05/11/28		2,067,814
U S D	1,811,356	WMG Acquisition Corp. 6.21% due 10/19/27		1,746,727
U S D	3,173,438	4.65% due 01/20/28 (a)		3,084,835
		バンクローン合計		291,664,855
		社債 (13.4%)		
U S D	925,000	ACI Worldwide, Inc. 5.75% due 08/15/26 (b) (c)		915,750
U S D	750,000	Ahead DB Holdings LLC 6.63% due 05/01/28 (b) (c)		675,730
U S D	2,000,000	Albertsons Cos, Inc. / Safeway, Inc. / New Albertsons LP / Albertsons LLC		1,802,710
U S D	1,650,000	Allison Transmission, Inc. 4.75% due 10/01/27 (b) (c)		1,534,500
U S D	1,125,000	Amkor Technology, Inc. 6.63% due 09/15/27 (b) (c)		1,098,900
U S D	2,050,000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp.		2,085,875
U S D	1,500,000	Avis Budget Car Rental LLC / Avis Budget Finance, Inc. 5.75% due 07/15/27 (b) (c)		1,421,250
		Buckeye Partners LP		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
U S D	1,750,000	3.95% due 12/01/26 (c) Caesars Entertainment, Inc.		1,553,934
U S D	850,000	8.13% due 07/01/27 (b) (c) Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco, Inc.		836,336
U S D	1,000,000	5.75% due 07/01/25 (b) (c) CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp.		980,020
U S D	5,075,000	5.00% due 02/01/28 (b) (c) Chemours Co.		4,650,768
U S D	1,000,000	5.75% due 11/15/28 (b) (c) Clarios Global LP / Clarios US Finance Co.		895,000
U S D	850,000	6.25% due 05/15/26 (b) (c)		840,557
U S D	650,000	8.50% due 05/15/27 (b) (c) Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp.		634,238
U S D	1,250,000	5.63% due 05/01/27 (b) (c) Dana Financing Luxembourg Sarl		1,165,625
U S D	1,500,000	5.75% due 04/15/25 (b) (c) DISH DBS Corp.		1,476,113
U S D	1,000,000	5.00% due 03/15/23		978,632
U S D	1,500,000	5.25% due 12/01/26 (b) (c)		1,238,437
U S D	2,250,000	5.88% due 11/15/24 Elanco Animal Health, Inc.		2,036,250
U S D	1,500,000	6.40% due 08/28/28 (c) Energizer Holdings, Inc.		1,396,785
U S D	2,000,000	6.50% due 12/31/27 (b) (c) Ford Motor Credit Co. LLC		1,860,556
U S D	2,060,000	4.39% due 01/08/26		1,931,662
U S D	2,000,000	4.27% due 01/09/27 (c) Gray Television, Inc.		1,832,136
U S D	750,000	7.00% due 05/15/27 (b) (c) Hertz Corp.		739,406
U S D	1,250,000	4.63% due 12/01/26 (b) (c) Hess Midstream Operations LP		1,063,563
U S D	1,500,000	5.63% due 02/15/26 (b) (c) IQVIA, Inc.		1,462,605
U S D	1,000,000	5.00% due 10/15/26 (b) (c) Live Nation Entertainment, Inc.		968,760
U S D	2,000,000	6.50% due 05/15/27 (b) (c) PetSmart, Inc. / PetSmart Finance Corp.		1,996,750
U S D	1,750,000	4.75% due 02/15/28 (b) (c) Post Holdings, Inc.		1,559,456
U S D	526,000	5.75% due 03/01/27 (b) (c) Royal Caribbean Cruises Ltd		514,110
U S D	2,000,000	9.13% due 06/15/23 (b) (c) Scotts Miracle-Gro Co.		2,019,940

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	1,250,000	4.50% due 10/15/29 (c) Sirius XM Radio, Inc.		1,001,450
U S D	2,000,000	5.00% due 08/01/27 (b) (c) Six Flags Entertainment Corp.		1,882,760
U S D	2,000,000	5.50% due 04/15/27 (b) (c) SS&C Technologies, Inc.		1,833,990
U S D	2,000,000	5.50% due 09/30/27 (b) (c) Staples, Inc.		1,890,468
U S D	1,396,000	7.50% due 04/15/26 (b) (c) Tenet Healthcare Corp.		1,179,704
U S D	3,250,000	4.88% due 01/01/26 (b) (c) Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance, Inc.		3,097,413
U S D	1,650,000	5.38% due 09/01/25 (b) (c) Univision Communications, Inc.		1,419,528
U S D	1,500,000	6.63% due 06/01/27 (b) (c) WESCO Distribution, Inc.		1,447,515
U S D	1,250,000	7.13% due 06/15/25 (b) (c) WR Grace Holdings LLC		1,250,174
U S D	1,500,000	4.88% due 06/15/27 (b) (c)		1,387,320
		社債合計		60,556,676
		米国合計 (簿価 \$366,638,614)		352,221,531
		債券合計 (簿価 \$405,291,459)		389,128,728
	株数			
		優先株式 (0.1%)		
		米国 (0.1%)		
	208	Claire's Stores, Inc.		514,800
		米国合計 (簿価 \$64,375)		514,800
		優先株式合計 (簿価 \$64,375)		514,800
		普通株式 (1.1%)		
		米国 (1.1%)		
	151,515	Cineworld Group PLC (c)		5,994
	290	Claire's Stores, Inc.		76,125
	34,996	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. Class A (c)		55,994
	13,134	iHeartCommunications, Inc.		116,236
	1,748	iHeartMedia, Inc.		15,470
	919	Neiman Marcus Group Restricted		165,420
	15,278	NMG Parent LLC (c)		2,750,040
	10,500	Oasis Petroleum, Inc. (c)		1,486,275
	57,327	SAL Topco LLC		37,606
	116	Southcross Holdco		986
		米国合計 (簿価 \$2,435,478)		4,710,146
		普通株式合計 (簿価 \$2,435,478)		4,710,146
	証券数			
		ワラント (0.0%)		
		米国 (0.0%)		

	額面	銘柄	純資産に 占める割合	評価額
	1,707	Windstream Holdings, Inc. 米国合計 (簿価 \$0) ワラント合計 (簿価 \$0)		23,044 23,044 23,044
	元本	短期投資 (14.3%) 日本 (10.0%) 定期預金 (10.0%) Sumitomo Mitsui Banking Corp.		
U S D	45,038,048	1.58% due 09/01/22 定期預金合計 日本合計 (簿価 \$45,038,048) 英国 (4.3%) 定期預金 (4.3%) Barclays Bank PLC		45,038,048 45,038,048 45,038,048
U S D	19,508,711	1.58% due 09/01/22 定期預金合計 英国合計 (簿価 \$19,508,711) 短期投資合計 (簿価 \$64,546,759) 投資合計合計 (簿価 \$472,338,071) 現金及び他の資産を超過する負債 純資産	101.7 % (1.7) <u>100.0 %</u>	19,508,711 19,508,711 19,508,711 64,546,759 \$ 458,923,477 (7,527,571) \$ 451,395,906

* 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 (2022年8月31日現在) (純資産に占める割合 -0.1%)*

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
USD	22,364,102	06/20/2027	ICE	5.00%	CDX. NA. HY. 38-V2	\$ (48,332)
						\$ (48,332)

* 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、\$2,009,000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 (2022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	HSBC Bank	411,837,416	09/12/2022	USD	3,100,682	\$ -	\$ (127,616)	\$ (127,616)
J P Y	Merrill Lynch International	6,583,385	09/12/2022	USD	49,464	-	(1,939)	(1,939)
J P Y	State Street Bank and Trust Co.	2,908,629	09/12/2022	USD	22,088	-	(1,091)	(1,091)
USD	BNP Paribas	25,849	09/12/2022	J P Y	3,547,936	236	-	236
						\$ 236	\$ (130,646)	\$ (130,410)

通貨の略称:

J P Y - 日本円
USD - 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1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

2023年7月20日～2024年1月19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

2024年1月19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。

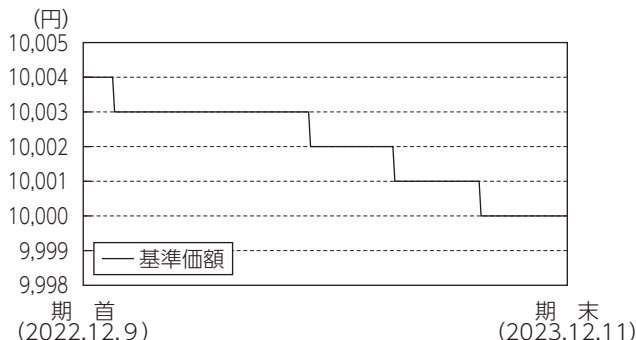
運用方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		
	円	%	%
(期首)2022年12月9日	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
コール・ローン等、その他	千円 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)	
i Freeレバレッジ S&P500	8,578,400,572円
i Free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
i FreeETF 日経平均レバレッジ・インデックス	3,766,275,979円
i FreeETF 日経平均ダブルインバース・インデックス	7,383,524,817円
i FreeETF TOPIXレバレッジ (2倍) 指数	1,207,970,593円
i FreeETF TOPIXダブルインバース (-2倍) 指数	926,253,680円
i FreeETF 日経平均インバース・インデックス	8,758,653,432円
i FreeETF TOPIXインバース (-1倍) 指数	11,471,375,420円
i FreeETF JPY日経400レバレッジ・インデックス	788,263,236円
i FreeETF JPY日経400インバース・インデックス	114,002,117円
i FreeETF JPY日経400ダブルインバース・インデックス	78,926,070円
i FreeETF S&P500レバレッジ	556,085,029円
i FreeETF 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。