【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2020年5月13日提出
【計算期間】	ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型） 第29特定期間 （自　2019年8月21日　至　2020年2月20日） ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型） 第23計算期間 （自　2019年8月21日　至　2020年2月20日）
【ファンド名】	ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型） ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、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。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

1. ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）（愛称：ワールドプライム）

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券　一般　高格付債））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

2. ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）（愛称：ワールドプライム）

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	債券
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（債券　一般　高格付債））
	決算頻度	年2回
	投資対象地域	グローバル（除く日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注1）商品分類の定義

- 「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- 「海外」…目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「債券」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの

（注2）属性区分の定義

- 「その他資産」…組入れている資産
- 「債券　一般」…公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのもの
- 「高格付債」…目論見書等において、特にクレジットに対して明確な記載があるもの
- 「年12回（毎月）」…目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
- 「年2回」…目論見書等において、年2回決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「ファミリーファンド」…目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- 「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表〈各ファンド共通〉

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表〈ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）（愛称：ワールドプライム）〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル（除く日本）	ファミリーファンド	あり（　　）
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性（　　）	年2回	日本		
不動産投信	年4回	北米		
その他資産（投資信託証券（債券　一般　高格付債））	年6回（隔月）	欧州		
資産複合（　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回（毎月）	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	日々	オセアニア		
	その他（　　）	中南米		
		アフリカ		
		中近東（中東）		
		エマージング		

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分表〈ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）（愛称：ワールドプライム）〉

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （債券 一般 高格付債）） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （除く日本） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリー ファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり （　　） なし

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス http://www.toushin.or.jp/）をご参照下さい。

＜信託金の限度額＞

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）について5兆円、ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）について5,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

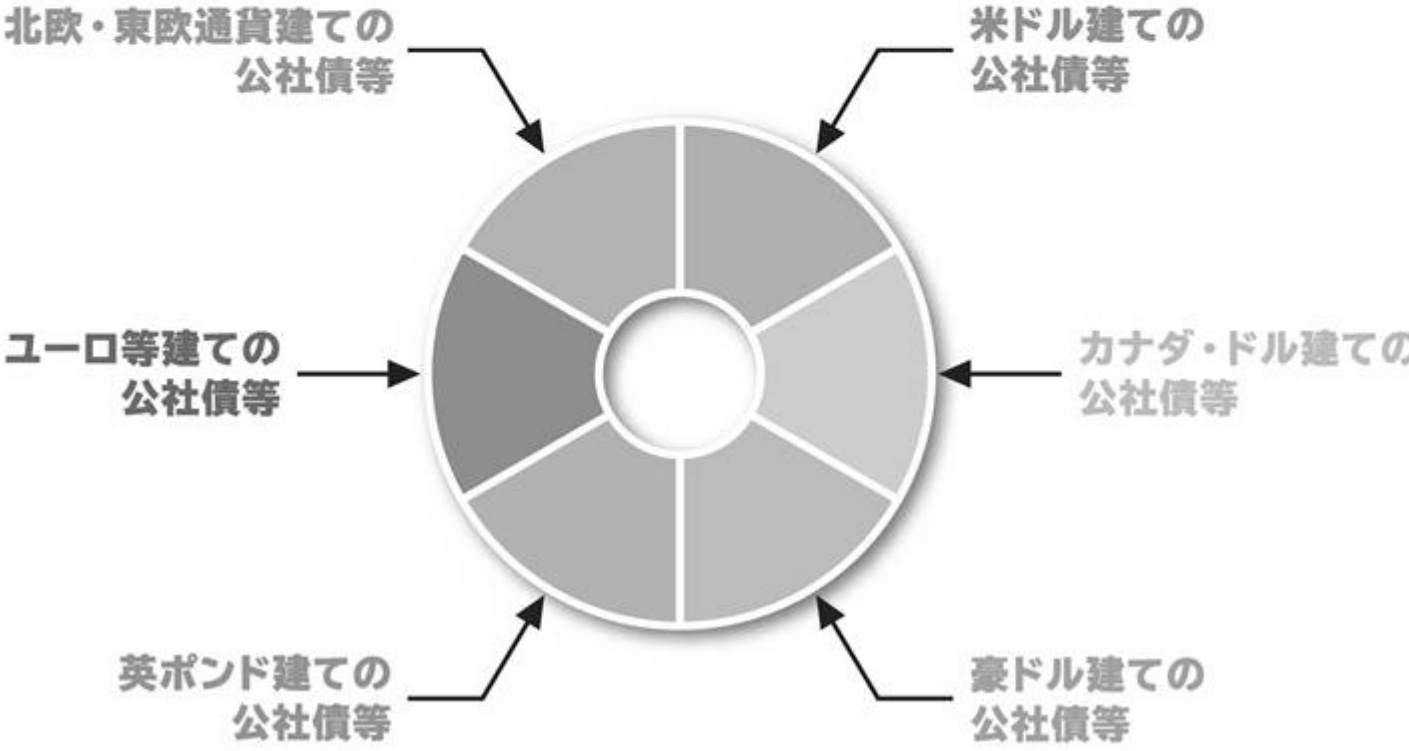
1 通貨を分散し、外貨建ての公社債等に投資します。

◆米ドル、カナダ・ドル、豪ドル、ユーロ等、英ポンドおよび北欧・東欧通貨の各通貨建ての公社債等に均等に投資することをめざします。

※北欧・東欧通貨とは、スウェーデン・クローネ（SKr）、デンマーク・クローネ（DKr）、ノルウェー・クローネ（NKr）、チェコ・コルナ（Kc）、ポーランド・ズロチ（ZL）、ハンガリー・フォリント（Ft）等とします。

※北欧・東欧通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、投資比率を見直します。

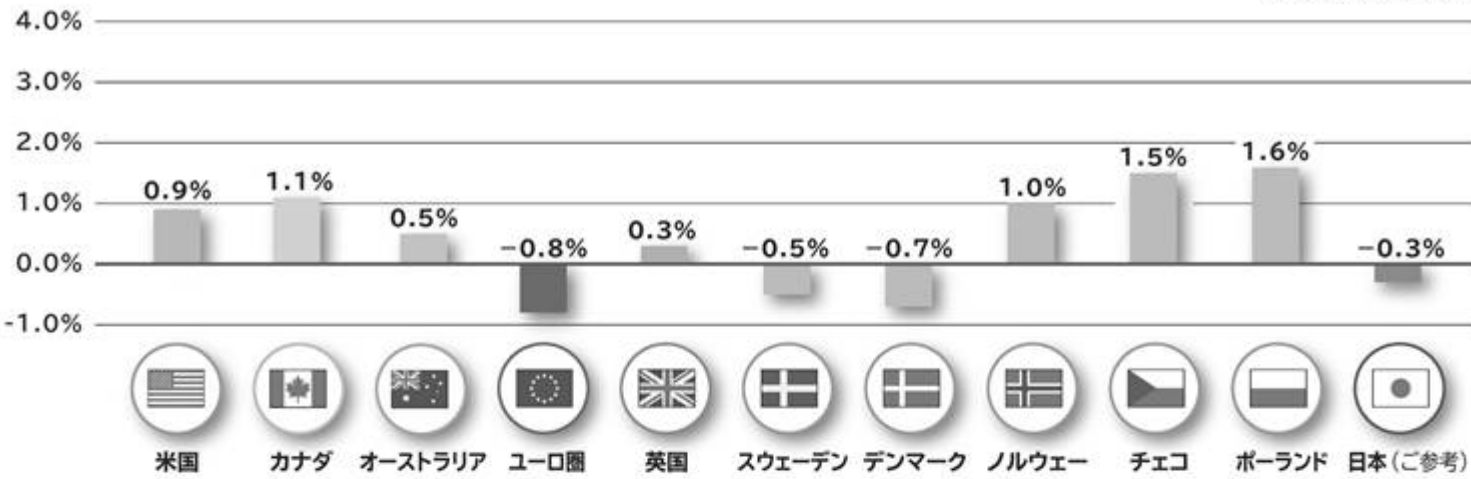
投資イメージ



（注）上記はイメージであり、実際の投資比率とは異なります。

各国の国債利回り（残存期間5年程度の国債利回り）

（2020年2月末現在



※日本は投資対象国ではありませんが、参考までに表示しています。
※外貨建資産には為替変動リスクがあります。表示の利回りは税引前です。
※当ファンドが上記の利回りで運用されることを示唆するものではありません。
※上記は、過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。
※上記は5年国債で運用することを示唆するものではありません。
※ユーロ圏はドイツ国債の利回りを使用しています。

（出所）ブルームバーグ

ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

（注）ヨーロッパ各国の金利水準が大きく変わる等、市場環境等によっては、ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンドを通じて、「ユーロ」および「北欧・東欧通貨」以外のヨーロッパの通貨に投資することがあります。

2 投資する公社債等の格付けは、取得時においてAA格相当以上※1とすることを基本とします。ただし、ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンドを通じて投資する国家機関等の公社債等（注）については、取得時においてA格相当以上※2とすることを基本とします。

（注）「国家機関等の公社債等」とは、国家機関（政府・州等を含みます。）、国際機関等、もしくはそれらに準ずると判断される機関およびそれらの代理機関等が発行・保証する公社債等をいいます。

債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	S&Pの場合	フィッチ・レーティングスの場合
高い	Aaa	AAA	AAA
	Aa1	AA+	AA+
	Aa2	AA	AA
	Aa3	AA−	AA−
投資適格	A1	A+	A+
	A2	A	A
	A3	A−	A−
	Baa	BBB	BBB
	Ba	BB	BB
	B	B	B
	Caa	CCC	CCC
	Ca	CC	CC
	C	C	C
低い		D	D

※1
※2

※1 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上
（ダイワ高格付豪ドル債マザーファンドを通じて投資する公社債等の格付けは、ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA−以上もしくはフィッチでAA−以上）
※2 ムーディーズでA3以上またはS&PでA−以上

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ（Moody's）、S&Pグローバル・レーティング（S&P）、フィッチ・レーティングス（Fitch）といった格付会社が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

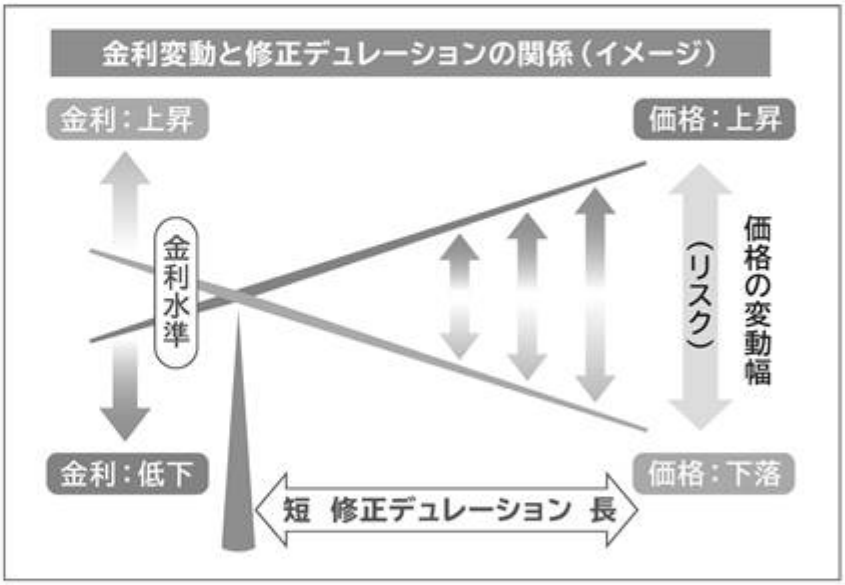
◆各マザーファンドにおいて、公社債等のポートフォリオの修正デュレーションは、下記の範囲とすることを基本とします。

ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	3（年）程度から5（年）程度の範囲
ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	
ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	
ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド	
ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド	
ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド	3（年）程度から7（年）程度の範囲

修正デュレーションについて

■修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。

■修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動（ブレ幅）が大きくなります。

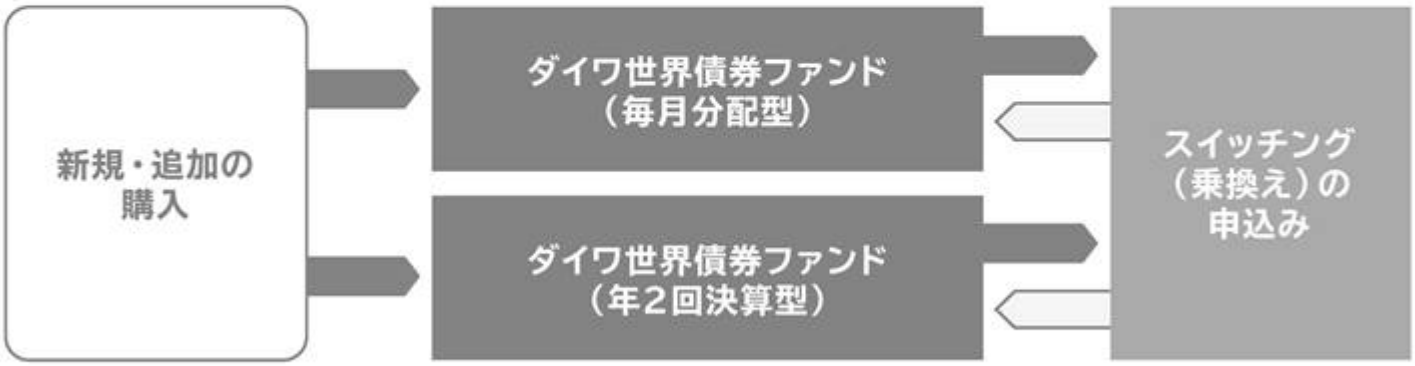


・マザーファンドの受益証券の組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の90％程度以上に維持することを基本とします。
・外貨建資産（マザーファンドを通じて投資するものを含みます。）について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1．および2．の運用が行なわれないことがあります。

3 ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）、ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）の2つのファンドがあります。

◆各ファンド間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。



2つのファンドの運用方針は同一ですが、それぞれ、別のファンドとして運用を行なうため、運用実績は異なる場合があります。

4 2つのファンドは、それぞれ毎月または年2回決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

毎月分配型

毎月20日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

【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。）等とします。

ⓑ 原則として、安定した分配を継続的に行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、上記にかかわらず今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮したうえで分配をすることがあります。なお、分配対象額が少額の場合は分配を行なわない場合があります。

年2回決算型

毎年2月20日および8月20日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

【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。）等とします。

ⓑ 原則として、信託財産の成長に資することを目的に、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。

・上記はイメージ図であり、**将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。**

・分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものはありません。**分配金が支払われない場合もあります。**

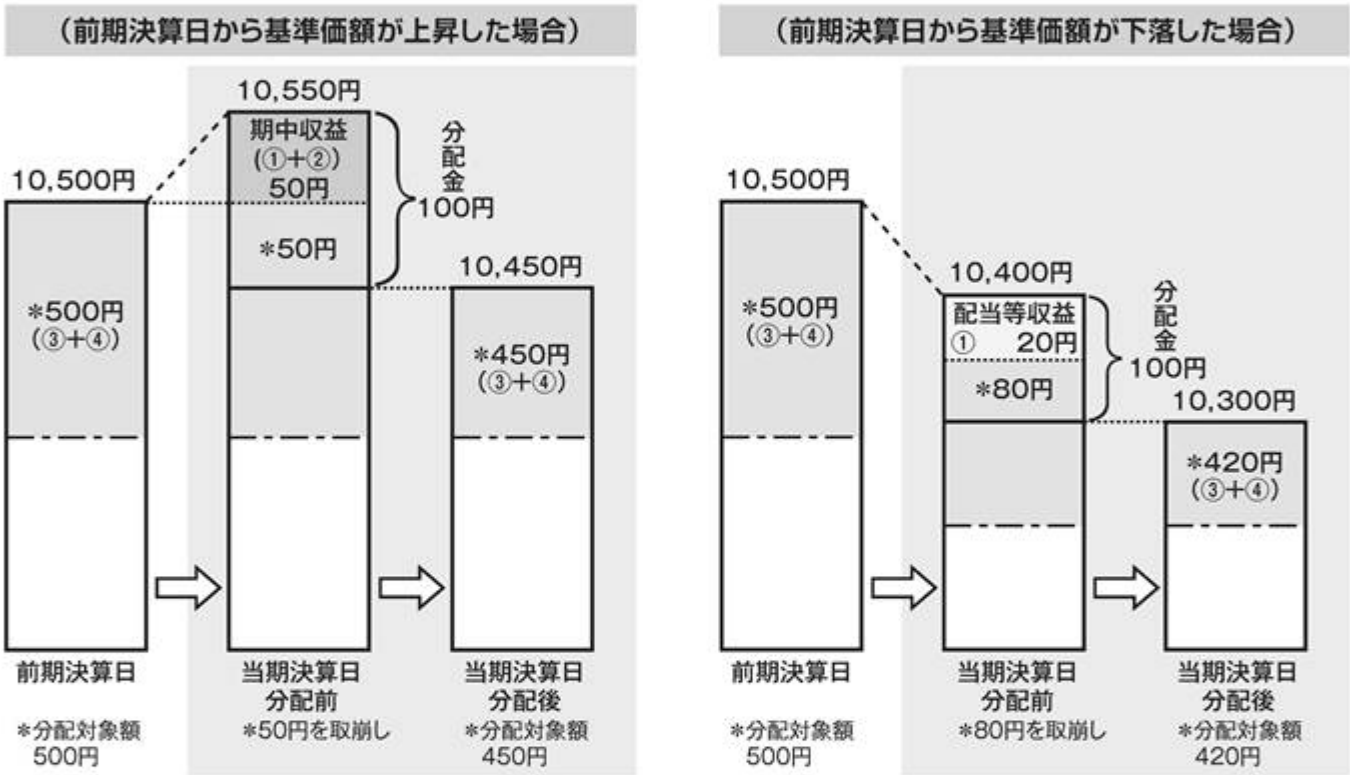
・**ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。**

[収益分配金に関する留意事項]

●分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）

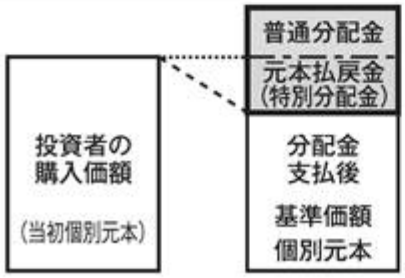


（注）分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。
分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

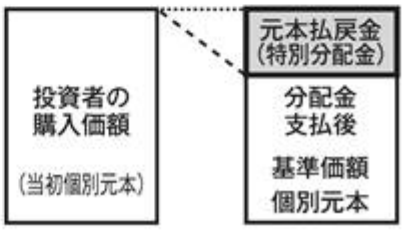
●投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



※元本払戻金（特別分配金）は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金（特別分配金）部分は非課税扱いとなります。

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金） … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

（注）普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金（5）課税上の取扱い」をご参照下さい。

[参考]各マザーファンドの投資態度

<table>
<tr><th>ダイワ高格付米ドル債マザーファンド</th><th>ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド</th></tr>
<tr><td>①　主として米ドル建ての公社債、ＡＢＳ、ＭＢＳなど（以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。</td><td>①　主としてユーロ建ての公社債、ＡＢＳ、ＭＢＳなど（以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。</td></tr>
<tr><td>②　米ドル建ての公社債等への投資にあたっては、以下の観点からポートフォリオを構築し、運用を行ないます。</td><td>②　ユーロ建ての公社債等への投資にあたっては、以下の観点からポートフォリオを構築し、運用を行ないます。</td></tr>
<tr><td colspan="2">イ．各銘柄の格付けは、取得時においてＡＡ格相当以上（Ｓ＆ＰでＡＡ－以上またはムーディーズでＡａ３以上）とすることを基本とします。</td></tr>
<tr><td colspan="2">ロ．取得後、格付けの低下によってＡＡ格相当以上でなくなった場合、委託会社の判断により当該銘柄を保有することもできますが、その範囲は、信託財産の純資産総額の10%程度を上限とします。</td></tr>
<tr><td colspan="2">ハ．政府およびその代理機関が発行・保証する公社債等を除き、一発行体当たりの投資比率は、信託財産の純資産総額の10%程度を上限とします。</td></tr>
<tr><td colspan="2">ニ．ポートフォリオの修正デュレーションは、3（年）程度から5（年）程度の範囲とすることを基本とします。</td></tr>
<tr><td>ホ．金利リスク調整のため、米国債先物取引等を利用することがあります。</td><td>ホ．金利リスク調整のため、ユーロ建ての国債先物取引等を利用することがあります。</td></tr>
<tr><td>③　為替については、米ドル建資産の投資比率を100%に近づけることを基本とします。</td><td>③　為替については、ユーロ建資産の投資比率を100%に近づけることを基本とします。</td></tr>
<tr><td colspan="2">④　有価証券取引、為替・短期資金取引の相手方の選定は、委託会社の社内規則に則って行ないます。</td></tr>
<tr><td colspan="2">⑤　大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</td></tr>
</table>

ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

①　主として豪ドル建ての公社債、ＡＢＳ、ＭＢＳなど（以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。	①　主としてカナダ・ドル建ての公社債（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。
②　豪ドル建ての公社債等への投資にあたっては、以下の観点からポートフォリオを構築し、運用を行ないます。	②　公社債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
イ．各銘柄の格付けは、取得時においてＡＡ格相当以上（Ｓ＆ＰでＡＡ－以上またはムーディーズでＡａ３以上もしくはフィッチでＡＡ－以上）とすることを基本とします。	イ．投資対象の格付けは、取得時においてＡＡ格相当以上（ムーディーズでＡａ３以上またはＳ＆ＰでＡＡ－以上）とすることを基本とします。
ロ．取得後、格付けの低下によってＡＡ格相当以上でなくなった場合、委託会社の判断により当該銘柄を保有することもできますが、その範囲は、信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。	ロ．取得後、格付けの低下によってＡＡ格相当以上でなくなった場合、委託会社の判断により当該銘柄を保有することもできますが、その範囲は、合計で信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。
ハ．政府・州およびそれらの代理機関、国際機関等が発行・保証する公社債等を除き、一発行体当たりの投資比率は、信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。	ハ．国家機関（政府・州等を含みます。）、国際機関等、もしくはそれらに準ずると判断される機関およびそれらの代理機関等が発行・保証する公社債等を除き、一発行体当たりの投資比率は、信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。
ニ．ポートフォリオの修正デュレーションは、3（年）程度から5（年）程度の範囲とすることを基本とします。	ニ．ポートフォリオの修正デュレーションは、3(年)程度から5(年)程度の範囲を基本とします。
ホ．金利リスク調整のため、豪ドル建ての国債先物取引等を利用することがあります。	ホ．金利リスク調整のため、カナダ・ドル建ての国債先物取引等を利用することがあります。
③　為替については、豪ドル建資産の投資比率を信託財産の純資産総額の100％に近づけることを基本とします。	③　為替については、カナダ・ドル建資産の投資比率を信託財産の純資産総額の100％に近づけることを基本とします。
④　有価証券取引、為替・短期資金取引の相手方の選定は、委託会社の社内規則に則って行ないます。	
⑤　大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。	

ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド
①　主として英ポンド建公社債（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。
②　投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
イ．投資対象の格付けは、取得時においてＡＡ格相当以上（ムーディーズでＡａ３以上またはＳ＆ＰでＡＡ－以上）とすることを基本とします。
ロ．取得後、格付けの低下によってＡＡ格相当以上でなくなった場合、委託会社の判断により当該銘柄を保有することもできますが、その範囲は、合計で信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。
ハ．国家機関（政府・州等を含みます。）、国際機関等、もしくはそれらに準ずると判断される機関およびそれらの代理機関等が発行・保証する公社債等を除き、一発行体当たりの投資比率は、信託財産の純資産総額の10％程度を上限とします。
ニ．ポートフォリオの修正デュレーションは、3（年）程度から5（年）程度の範囲を基本とします。
ホ．金利リスク調整のため、英ポンド建ての国債先物取引等を利用することがあります。
③　外貨建資産の投資にあたっては、英ポンド建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100％に近づけることを基本とします。
④　保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
⑤　大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド
①　主としてヨーロッパの通貨建ての公社債（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。以下「公社債等」といいます。）およびコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品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て運用を行ないます。

②　公社債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。
イ．各通貨圏別の投資比率については、北欧・東欧通貨圏の通貨（注1）を信託財産の純資産総額の60%程度、ユーロ等（注2）を信託財産の純資産総額の40%程度とすることを基本とします（ただし、北欧・東欧通貨圏の対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて各通貨圏別の配分比率を見直します。）。 注1：当ファンドにおける北欧・東欧通貨圏の通貨とは、主として、スウェーデン、デンマーク、ノルウェー、チェコ、ポーランドおよびハンガリー等の通貨を指しますが、この他、委託会社が北欧・東欧通貨圏の通貨に相当すると判断したヨーロッパの通貨を含みます。 注2：ヨーロッパ各国の金利水準が大きく変わる等、市場環境等によっては、ユーロに投資する比率の制約の範囲内で、ユーロ・北欧・東欧通貨圏以外のヨーロッパの通貨に投資することがあります。
ロ．投資対象の格付けは、取得時においてＡＡ格相当以上とすることを基本とします。
ハ．ただし、国家機関（政府・州等を含みます。）、国際機関等、もしくはそれらに準ずると判断される機関およびそれらの代理機関等が発行・保証する公社債等（以下「国家機関等の公社債等」といいます。）については、取得時においてＡ格相当以上とすることを基本とします。
ニ．国家機関等の公社債等を除き、一発行体当たりの投資比率は、信託財産の純資産総額の10%程度を上限とします。
ホ．ポートフォリオの修正デュレーションは、3(年)程度から7(年)程度の範囲を基本とします。
ヘ．金利リスク調整のため、ヨーロッパの通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。
③　為替については、ヨーロッパの通貨建資産の投資比率を信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。
④　有価証券取引、為替・短期資金取引の相手方の選定および格付けの定義は、委託会社の社内規則に則って行ないます。
⑤　大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2)　【ファンドの沿革】

＜ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）＞

2005年12月16日	信託契約締結、当初自己設定、運用開始
2006年12月12日	・信託期間を無期限に変更（当初は2015年12月7日まで） ・計算期間を毎月21日から翌月20日まで、ただし、第13計算期間は、2006年12月6日から2007年1月20日までに変更（当初は毎月6日から翌月5日まで、ただし、最終計算期間は、2015年11月6日から2015年12月7日まで）
2006年12月29日	ファンド名称に（愛称：ワールドプライム）を追加

＜ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）＞

2008年10月31日　　信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	

収益分配金（注）、償還金など↑↓お申込金（※3）

お取扱窓口	販売会社	受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（※1）に基づき、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集の取扱い ②一部解約請求に関する事務 ③収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務　など

↑↓※1　　収益分配金、償還金など↑↓お申込金（※3）

委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。)(※2)の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（＊）	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（＊）に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	内外の公社債等および短期金融商品　など （ファミリーファンド方式で運用を行ないます。）

(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

※1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
※2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
※3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

◎委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

＊再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

＜委託会社の概況（2020年2月末日現在）＞

・資本金の額　151億7,427万2,500円

・沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 （金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号）

・大株主の状況

名　称	住　所	所有株式数	比率
		株	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

＜各ファンド共通＞

①　主要投資対象

次に掲げるマザーファンド（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。

1. ダイワ高格付米ドル債マザーファンドの受益証券
2. ダイワ高格付カナダドル債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ高格付豪ドル債マザーファンドの受益証券
4. ダイワ高格付ユーロ債マザーファンドの受益証券
5. ダイワ高格付英ポンド債マザーファンドの受益証券
6. ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンドの受益証券

② 投資態度

イ．通貨を分散し、外貨建ての公社債等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て運用を行ないます。

ロ．米ドル、カナダ・ドル、豪ドル、ユーロ等、英ポンドおよび北欧･東欧通貨＊の各通貨建ての公社債等に均等に投資することをめざします（ただし、北欧･東欧通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、投資比率を見直します。）。

＊ 北欧･東欧通貨とは、スウェーデン・クローネ(SKr)、デンマーク・クローネ(DKr)、ノルウェー・クローネ(NKr)、チェコ・コルナ(Kc)、ポーランド・ズロチ(ZL)、ハンガリー・フォリント(Ft)等とします。

ハ．各通貨の公社債への投資は以下のマザーファンドの受益証券を通じて行ないます。

米ドルへの投資は「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」、カナダ・ドルへの投資は「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」、豪ドルへの投資は「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」、ユーロ等への投資は「ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド」および「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」、英ポンドへの投資は「ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド」、北欧・東欧通貨への投資は「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」の受益証券を通じて行ないます。

ニ．マザーファンドの受益証券の組入比率の合計は、通常の状態で信託財産の純資産総額の90％程度以上に維持することを基本とします。

ホ．外貨建資産（マザーファンドを通じて投資するものを含みます。）について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

ヘ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

(2) 【投資対象】

＜各ファンド共通＞

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたダイワ高格付米ドル債マザーファンド、ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド、ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド、ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド、ダイワ高格付英ポンド債マザーファンドおよびダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド（以下、総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15. の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10. の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

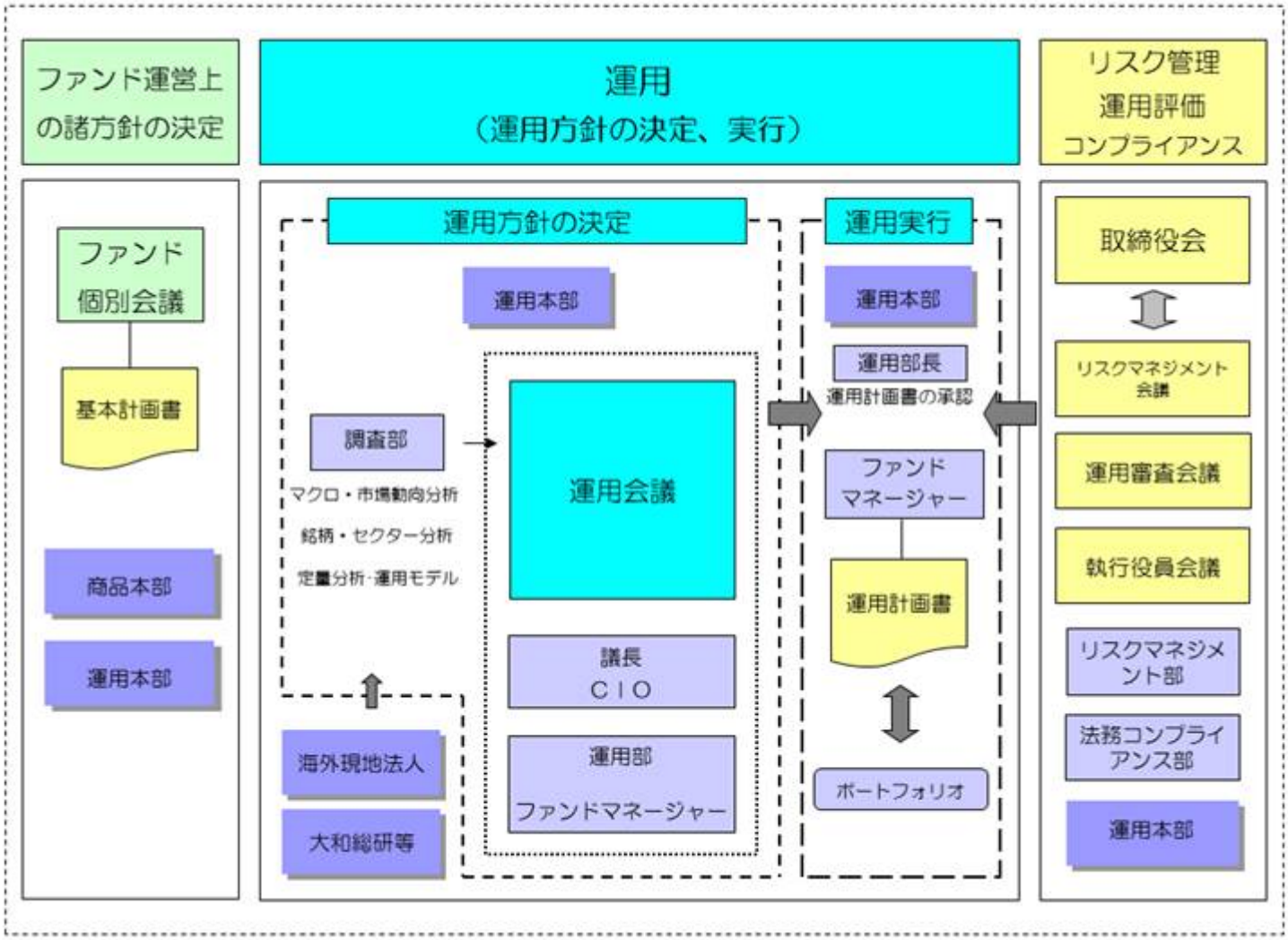
③　委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3)　【運用体制】

①　運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



②　運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

③　職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

・ファンド運用に関する組織運営
・ファンドマネージャーの任命・変更
・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
・各ファンドの分配政策の決定
・代表取締役に対する随時の的確な状況報告
・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

④　運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ロ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

⑤　受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

※　上記の運用体制は2020年2月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

＜ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）＞

①　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。）等とします。

②　原則として、安定した分配を継続的に行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、上記にかかわらず今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮したうえで分配をすることがあります。なお、分配対象額が少額の場合は分配を行なわない場合があります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

＜ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）＞

①　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。）等とします。

②　原則として、信託財産の成長に資することを目的に、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。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

＜各ファンド共通＞

①　株式（信託約款）

イ．株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

ロ．委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ハ．前ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

②　投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

③　投資する株式の範囲（信託約款）

イ．委託会社が投資することを指図する株式は、金融商品取引所（※）に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式については、この限りではありません。

（※）金融商品取引所について

＜ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）＞

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

＜ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）＞

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。

ロ．前イ．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

④　先物取引等（信託約款）

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤　スワップ取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

へ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額

が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ヘ．前ホ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ト．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑦　デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

⑧　同一銘柄の転換社債等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑨　有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

⑩　外貨建資産（信託約款）w

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

⑪　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

⑫　外国為替予約取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

ロ．前イ．の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

ハ．前ロ．においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ニ．前ロ．の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑬　信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

⑭　資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンドの概要

(1) 投資方針

①　主要投資対象

イ．ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

内外の公社債、ＡＢＳ（アセットバック証券：各種の債権や商業用不動産などの資産を裏付けとして発行された証券）、ＭＢＳ（モーゲージ担保証券：不動産担保融資の債権を裏付けとして発行された証券）および短期金融商品を主要投資対象とします。

ロ．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を主要投資対象とします。

ハ．ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

内外の公社債、ＡＢＳ（アセットバック証券：各種の債権や商業用不動産などの資産を裏付けとして発行された証券）、ＭＢＳ（モーゲージ担保証券：不動産担保融資の債権を裏付けとして発行された証券）および短期金融商品を主要投資対象とします。

ニ．ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド

内外の公社債、ＡＢＳ（アセットバック証券：各種の債権や商業用不動産などの資産を裏付けとして発行された証券）、ＭＢＳ（モーゲージ担保証券：不動産担保融資の債権を裏付けとして発行された証券）などおよび短期金融商品を主要投資対象とします。

ホ．ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド

内外の公社債等および短期金融商品を主要投資対象とします。

ヘ．ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド

内外の公社債等および短期金融商品を主要投資対象とします。

② 投資態度

「1　ファンドの性格」「(1) ファンドの目的及び基本的性格」＜ファンドの特色＞の「［参考］各マザーファンドの投資態度」をご参照下さい。

(2) 投資対象

＜ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンド＞

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前6.までの証券または証書の性質を有するもの
8. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
9. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
10. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
11. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
12. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
13. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
14. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
15. 外国の者に対する権利で前14. の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前7.ならびに前11.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前5.までの証券および前7.ならびに前11.の証券または証書のうち前2.から前5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前8.の証券および前9.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③　委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

＜ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
   イ．有価証券
   ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)④、⑤および⑥に定めるものに限ります。）
   ハ．約束手形
   ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15. の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

③ 委託会社は、信託金を、前②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

＜ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンド＞

① 株式

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

② 投資信託証券

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

③ 外貨建資産

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

④ 先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下「＜参　考＞ マザーファンドの概要」において同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

⑤ スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

＜ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド＞

①　株式

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

②　投資信託証券

（ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンドと同規定）

③　外貨建資産

（ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンドと同規定）

④　先物取引等

（ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンドと同規定）

⑤　スワップ取引

（ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンドと同規定）

⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

（ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド以外の各ファンドと同規定）

3　【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

① 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

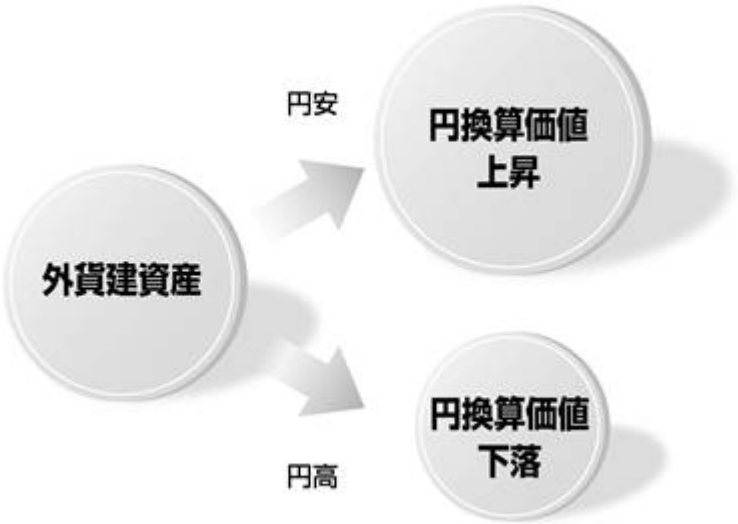
※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

② 外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドにおいては、外貨建資産（マザーファンドを通じて投資するものを含みます。）について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

③　その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

①　金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、お買付け、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。

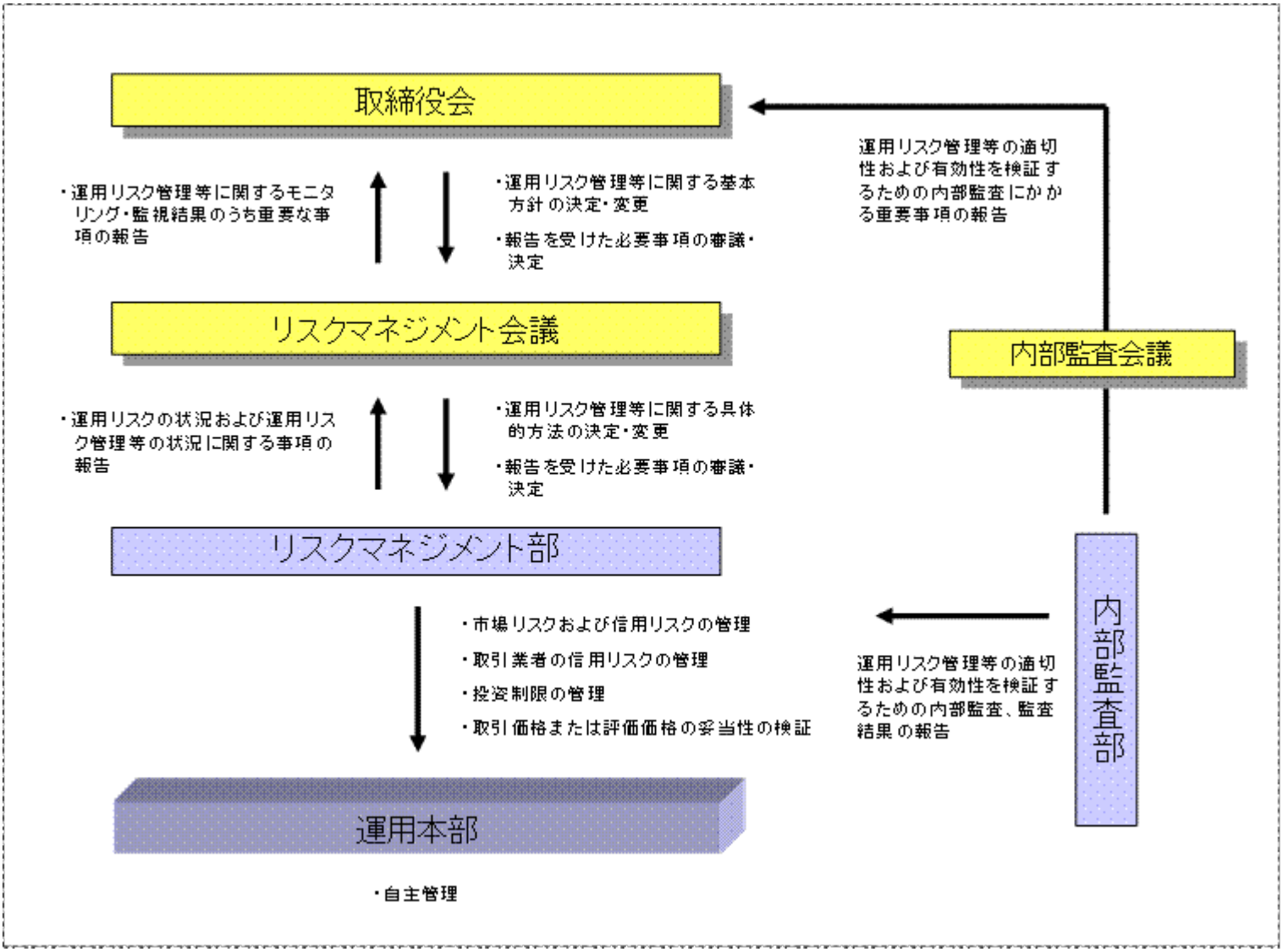
②　ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

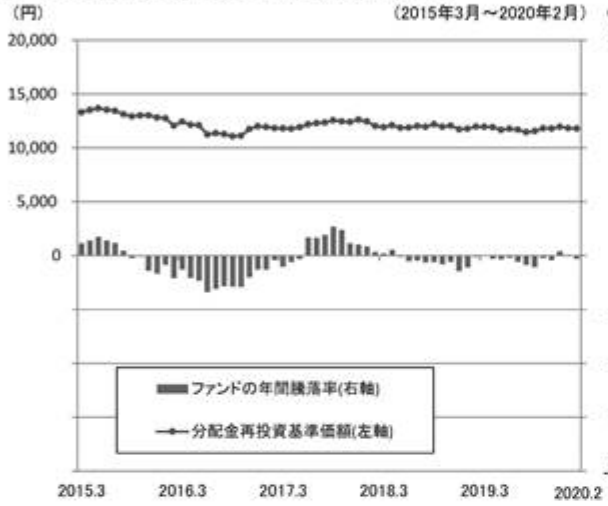
■参考情報

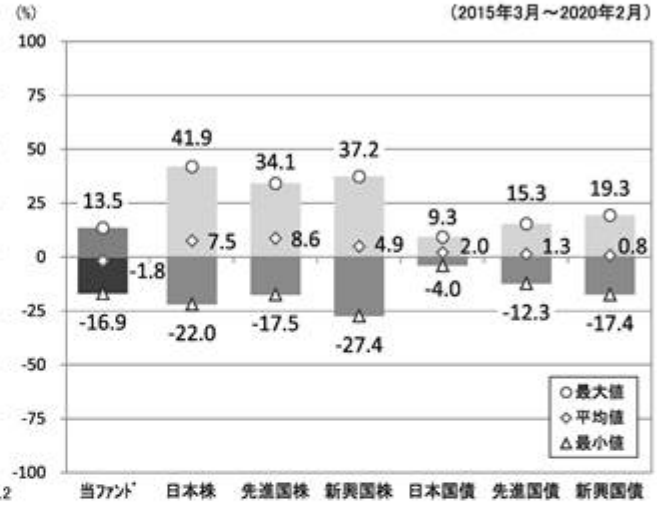
◆下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

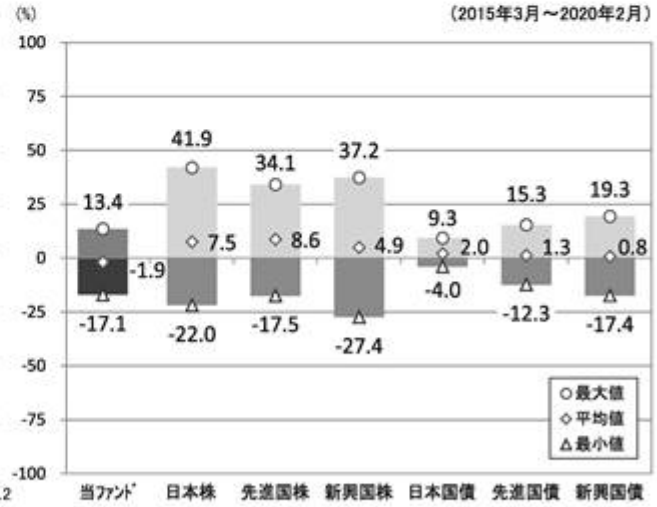
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

[ダイワ世界債券ファンド(毎月分配型)]





[ダイワ世界債券ファンド(年2回決算型)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日 本 株：東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)
新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド(円ベース)

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、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。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4　【手数料等及び税金】

(1)　【申込手数料】

①　販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.2%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）

＜スイッチング（乗換え）について＞

・「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）」の受益権の取得申込みを行なうこと、および「ダ

イワ世界債券ファンド（年2回決算型）」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の受益権の取得申込みを行なうことをいいます。

・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。

・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。

② 申込手数料には、消費税等が課されます。

③ 「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

(2) 【換金(解約)手数料】

① 換金手数料

ありません。

② 信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

① 信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.375%（税抜1.25%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

② 信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

③ 信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、純資産総額に対し次のとおりです。

「ダイワ世界債券ファンド(毎月分配型)」および「ダイワ世界債券ファンド(年2回決算型)」の信託財産の純資産総額の合計額が	委託会社	販売会社	受託会社

300億円未満の場合	年率0.50% （税抜）	年率0.70% （税抜）	年率0.05% （税抜）
300億円以上1,000億円未満の場合	年率0.45% （税抜）	年率0.75% （税抜）	
1,000億円以上の場合	年率0.40% （税抜）	年率0.80% （税抜）	

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

④　前③の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：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、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)　【その他の手数料等】

①　信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

②　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

③　信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

④　信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（※）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

各マザーファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5)　【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

※少額投資非課税制度「愛称：ＮＩＳＡ（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたＮＩＳＡをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

②　法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収※され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

① 投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

② 投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

③ 投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にそ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、その後の当該投資者の個別元本となります。

＜注2＞収益分配金の課税について

① 追加型株式投資信託の収益分配金には、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）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

② 投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

（※）外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

（※）上記は、2020年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（※）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5　【運用状況】

【ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）】

(1) 【投資状況】（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		26,402,324,671	99.51
	内　日本	26,402,324,671	99.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		131,281,675	0.49
純資産総額		26,533,606,346	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2020年2月28日現在）

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,725,729,215	1.5712 7,425,065,796	1.5680 7,409,943,409	27.93
2	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,663,526,574	1.6673 4,440,897,885	1.6565 4,412,131,769	16.63
3	ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,736,276,685	1.1897 4,445,048,372	1.1738 4,385,641,572	16.53
4	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,448,802,719	1.8251 4,469,309,898	1.7802 4,359,358,600	16.43
5	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,637,154,519	2.7191 4,451,586,852	2.6500 4,338,459,475	16.35

6	ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	854,575,990	1.7482 1,493,969,746	1.7515 1,496,789,846	5.64

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.51%
合計	99.51%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの純資産額 (分配付)(円)
第10特定期間末 (2010年8月20日)	184,471,745,334	185,149,520,212	0.6804	0.6829
第11特定期間末 (2011年2月21日)	140,904,564,852	141,426,048,759	0.6755	0.6780
第12特定期間末 (2011年8月22日)	114,828,488,702	115,267,065,030	0.6546	0.6571
第13特定期間末 (2012年2月20日)	90,193,220,083	90,470,017,757	0.6517	0.6537
第14特定期間末 (2012年8月20日)	81,163,540,050	81,418,056,133	0.6378	0.6398
第15特定期間末 (2013年2月20日)	91,171,376,919	91,414,718,428	0.7493	0.7513
第16特定期間末 (2013年8月20日)	80,408,194,341	80,626,038,509	0.7382	0.7402

第17特定期間末 (2014年2月20日)	76,901,909,223	77,100,519,241	0.7744	0.7764
第18特定期間末 (2014年8月20日)	72,009,097,809	72,193,153,659	0.7825	0.7845
第19特定期間末 (2015年2月20日)	66,914,829,501	67,079,129,133	0.8145	0.8165
第20特定期間末 (2015年8月20日)	62,379,319,391	62,533,689,101	0.8082	0.8102
第21特定期間末 (2016年2月22日)	52,607,693,332	52,755,981,238	0.7095	0.7115
第22特定期間末 (2016年8月22日)	45,633,296,838	45,775,847,702	0.6402	0.6422
第23特定期間末 (2017年2月20日)	44,658,311,499	44,791,134,075	0.6725	0.6745
第24特定期間末 (2017年8月21日)	39,971,973,818	40,090,019,434	0.6772	0.6792
第25特定期間末 (2018年2月20日)	35,260,696,910	35,340,312,841	0.6643	0.6658
第26特定期間末 (2018年8月20日)	33,326,208,986	33,404,307,726	0.6401	0.6416
第27特定期間末 (2019年2月20日)	31,223,763,516	31,272,707,934	0.6379	0.6389
2019年2月末日	31,182,825,718	－	0.6413	－
3月末日	30,540,906,737	－	0.6397	－
4月末日	30,096,191,698	－	0.6373	－
5月末日	29,214,238,907	－	0.6222	－
6月末日	29,118,175,840	－	0.6268	－
7月末日	28,589,691,853	－	0.6212	－
第28特定期間末 (2019年8月20日)	27,903,439,855	27,949,237,577	0.6093	0.6103
8月末日	27,808,094,055	－	0.6082	－
9月末日	27,850,186,345	－	0.6127	－
10月末日	28,063,434,378	－	0.6253	－
11月末日	27,589,973,619	－	0.6232	－
12月末日	27,558,302,140	－	0.6305	－
2020年1月末日	26,885,266,008	－	0.6226	－
第29特定期間末 (2020年2月20日)	26,960,810,035	27,003,749,921	0.6279	0.6289
2月末日	26,533,606,346	－	0.6201	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10特定期間	0.0200
第11特定期間	0.0150
第12特定期間	0.0150
第13特定期間	0.0135
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0120
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120
第22特定期間	0.0120
第23特定期間	0.0120
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0095
第26特定期間	0.0090
第27特定期間	0.0070
第28特定期間	0.0060
第29特定期間	0.0060

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第10特定期間	△4.7
第11特定期間	1.5
第12特定期間	△0.9
第13特定期間	1.6
第14特定期間	△0.3
第15特定期間	19.4
第16特定期間	0.1
第17特定期間	6.5
第18特定期間	2.6
第19特定期間	5.6
第20特定期間	0.7
第21特定期間	△10.7

第22特定期間	△8.1
第23特定期間	6.9
第24特定期間	2.5
第25特定期間	△0.5
第26特定期間	△2.3
第27特定期間	0.7
第28特定期間	△3.5
第29特定期間	4.0

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第10特定期間	18,616,008,582	70,447,024,317
第11特定期間	13,750,948,811	76,267,337,436
第12特定期間	12,185,275,924	45,348,307,638
第13特定期間	1,798,087,821	38,829,781,671
第14特定期間	460,148,241	11,600,943,863
第15特定期間	1,002,170,462	6,589,457,707
第16特定期間	274,860,547	13,023,531,054
第17特定期間	777,747,228	10,394,822,153
第18特定期間	502,933,809	7,780,017,885
第19特定期間	293,538,012	10,171,646,737
第20特定期間	160,306,352	5,125,267,229
第21特定期間	198,429,688	3,239,332,048
第22特定期間	188,764,124	3,057,284,929
第23特定期間	972,720,086	5,836,864,083
第24特定期間	176,761,360	7,565,241,174
第25特定期間	131,105,230	6,076,626,033
第26特定期間	862,976,416	1,874,437,227
第27特定期間	98,312,072	3,219,720,148
第28特定期間	78,841,092	3,225,537,237
第29特定期間	75,309,744	2,933,145,964

（参考）マザーファンド
ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

国債証券		12,512,629,123	58.52
	内 アメリカ	12,512,629,123	58.52
特殊債券		336,415,178	1.57
	内 アメリカ	336,415,178	1.57
社債券		7,862,015,313	36.77
	内 アメリカ	7,862,015,313	36.77
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		670,162,654	3.13
純資産総額		21,381,222,268	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（売建）		164,115,000	△0.77
	内 日本	164,115,000	△0.77

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2020年2月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	28,000,000	101.08 3,097,153,210	100.83 3,089,532,812	2.750000 2020/09/30	14.45
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	18,000,000	100.73 1,984,242,210	101.41 1,997,513,334	1.625000 2022/11/15	9.34
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	17,500,000	100.72 1,928,853,361	101.36 1,941,203,391	1.750000 2022/04/30	9.08
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000,000	106.05 1,740,823,383	106.92 1,755,054,754	2.250000 2027/02/15	8.21
5	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	13,000,000	111.53 1,586,628,852	114.67 1,631,298,178	2.500000 2046/05/15	7.63
6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,000,000	100.71 991,862,577	101.87 1,003,336,312	1.500000 2026/08/15	4.69
7	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,600,000	145.43 891,249,570	148.38 909,296,766	4.375000 2041/05/15	4.25

8	Toronto-Dominion Bank/The	アメリカ	社債券	7,500,000	100.48 824,697,309	100.67 826,256,686	2.125000 2021/04/07	3.86
9	HSBC Bank PLC	アメリカ	社債券	7,000,000	101.96 781,092,736	101.11 774,566,331	4.125000 2020/08/12	3.62
10	National Australia Bank Ltd/New York	アメリカ	社債券	6,000,000	102.42 672,469,236	102.15 670,755,562	2.800000 2022/01/10	3.14
11	RABOBANK NEDERLAND	アメリカ	社債券	5,500,000	103.34 621,985,346	102.53 617,134,315	4.500000 2021/01/11	2.89
12	Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The	アメリカ	社債券	5,500,000	101.67 611,958,276	101.78 612,626,346	2.850000 2021/09/08	2.87
13	Sumitomo Mitsui Banking Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	103.26 564,987,090	103.52 566,415,151	3.200000 2022/07/18	2.65
14	Total Capital International SA	アメリカ	社債券	5,000,000	102.73 562,087,195	103.16 564,461,826	2.700000 2023/01/25	2.64
15	Chevron Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	101.96 557,896,026	101.81 557,097,187	2.355000 2022/12/05	2.61
16	Royal Bank of Canada	アメリカ	社債券	5,000,000	100.28 548,709,377	100.38 549,261,999	2.100000 2020/10/14	2.57
17	Microsoft Corp	アメリカ	社債券	5,000,000	99.92 546,739,637	100.25 548,567,118	1.550000 2021/08/08	2.57
18	Sumitomo Mitsui Banking Corp	アメリカ	社債券	4,000,000	107.14 469,012,602	107.44 470,312,631	3.950000 2023/07/19	2.20
19	COMMONWEALTH BK AUSTR NY	アメリカ	社債券	4,000,000	100.62 440,460,127	100.51 439,969,880	2.400000 2020/11/02	2.06
20	Temasek Financial I Ltd	アメリカ	特殊債券	3,000,000	102.20 335,532,077	102.47 336,415,177	2.375000 2023/01/23	1.57
21	Total Capital SA	アメリカ	社債券	3,000,000	103.17 338,726,339	102.39 336,139,413	4.125000 2021/01/28	1.57
22	United Overseas Bank Ltd	アメリカ	社債券	3,000,000	100.14 328,779,152	100.04 328,450,862	2.500000 2020/03/18	1.54
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	1,500,000	111.93 183,738,988	112.94 185,393,570	2.875000 2028/08/15	0.87

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	58.52%
特殊債券	1.57%
社債券	36.77%

合計	96.87%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2020年3月	売建	1,500,000	165,423,450	164,115,000	△0.77%

(注1)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2)　為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3)　為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		16,882,994,624	11.49
	内　カナダ	16,882,994,624	11.49
地方債証券		61,200,258,039	41.64
	内　カナダ	61,200,258,039	41.64
特殊債券		10,146,138,492	6.90
	内　カナダ	10,146,138,492	6.90
社債券		55,449,649,097	37.73
	内　カナダ	55,449,649,097	37.73
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		3,280,027,889	2.23
純資産総額		146,959,068,141	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)

為替予約取引(売建)		816,600,000	△0.56
	内 日本	816,600,000	△0.56

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2020年2月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	BRITISH COLUMBIA	カナダ	地方債証券	89,400,000	119.19 8,703,847,754	117.72 8,596,578,553	9.500000 2022/06/09	5.85
2	Province of Quebec Canada	カナダ	地方債証券	92,000,000	102.68 7,716,175,644	104.89 7,882,397,712	2.500000 2026/09/01	5.36
3	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	83,000,000	106.77 7,238,882,648	107.90 7,315,015,760	3.500000 2024/06/02	4.98
4	Province of Alberta Canada	カナダ	地方債証券	78,000,000	100.35 6,393,657,192	102.54 6,533,119,257	2.200000 2026/06/01	4.45
5	Ontario Electricity Financial Corp	カナダ	社債券	68,681,000	115.70 6,490,781,036	113.77 6,382,735,054	10.125000 2021/10/15	4.34
6	Ontario Electricity Financial Corp	カナダ	社債券	60,274,000	118.82 5,850,165,942	117.68 5,793,647,832	8.900000 2022/08/18	3.94
7	Province of Quebec Canada	カナダ	地方債証券	66,000,000	105.06 5,663,766,345	104.84 5,651,960,318	4.250000 2021/12/01	3.85
8	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	65,000,000	101.90 5,410,311,672	104.02 5,522,895,300	2.400000 2026/06/02	3.76
9	Toronto-Dominion Bank/The	カナダ	社債券	65,000,000	101.13 5,369,353,236	101.63 5,395,846,144	2.621000 2021/12/22	3.67
10	Toronto-Dominion Bank/The	カナダ	社債券	62,000,000	99.60 5,044,105,926	99.98 5,063,451,017	1.680000 2021/06/08	3.45

11	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	60,000,000	99.61 4,881,833,904	102.10 5,004,010,848	1.500000 2026/06/01	3.41
12	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	43,000,000	123.16 4,325,674,784	134.06 4,708,508,944	2.750000 2048/12/01	3.20
13	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	50,000,000	105.62 4,313,847,520	108.46 4,429,710,600	2.650000 2028/12/15	3.01
14	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	50,000,000	105.31 4,301,064,600	107.84 4,404,471,480	2.900000 2028/06/02	3.00
15	Apple Inc	カナダ	社債券	50,000,000	101.36 4,139,909,960	102.92 4,203,497,840	2.513000 2024/08/19	2.86
16	Province of Saskatchewan Canada	カナダ	地方債証券	40,683,000	117.01 3,888,426,982	115.42 3,835,591,482	9.600000 2022/02/04	2.61
17	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	40,000,000	101.60 3,319,605,888	102.71 3,355,806,464	2.000000 2023/09/01	2.28
18	Royal Bank of Canada	カナダ	社債券	40,000,000	99.20 3,241,127,744	99.81 3,261,024,992	1.583000 2021/09/13	2.22
19	HYDRO QUEBEC	カナダ	社債券	30,835,000	120.39 3,032,322,213	119.00 2,997,364,006	9.625000 2022/07/15	2.04
20	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	35,000,000	100.52 2,873,865,876	101.81 2,910,601,456	2.542000 2023/01/31	1.98
21	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	35,000,000	100.42 2,871,007,076	100.59 2,875,781,272	2.449000 2021/01/29	1.96
22	Royal Bank of Canada	カナダ	社債券	35,000,000	99.69 2,850,052,072	100.45 2,871,778,952	1.968000 2022/03/02	1.95
23	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	32,000,000	103.34 2,701,111,859	106.38 2,780,570,163	2.000000 2028/06/01	1.89
24	HSBC Bank Canada	カナダ	社債券	30,000,000	99.88 2,447,680,056	100.00 2,450,449,008	1.816000 2020/07/07	1.67
25	PSP Capital Inc	カナダ	特殊債券	25,000,000	105.46 2,153,636,140	107.21 2,189,371,140	3.000000 2025/11/05	1.49
26	PSP Capital Inc	カナダ	特殊債券	25,000,000	105.82 2,161,007,760	106.89 2,182,693,800	3.290000 2024/04/04	1.49
27	Province of Alberta Canada	カナダ	地方債証券	25,000,000	101.49 2,072,568,740	103.36 2,110,631,620	2.350000 2025/06/01	1.44
28	Toronto-Dominion Bank/The	カナダ	社債券	25,000,000	99.08 2,023,274,860	100.46 2,051,393,200	1.909000 2023/07/18	1.40

29	BRITISH COLUMBIA	カナダ	地方債証券	22,430,000	112.19 2,055,504,848	110.05 2,016,371,568	9.950000 2021/05/15	1.37
30	ONTARIO PROVINCE	カナダ	地方債証券	20,000,000	103.42 1,689,501,792	103.72 1,694,386,256	3.150000 2022/06/02	1.15

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	11.49%
地方債証券	41.64%
特殊債券	6.90%
社債券	37.73%
合計	97.77%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル売/円買 2020年3月	売建	10,000,000	829,961,000	816,600,000	△0.56%

(注1)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2)　為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3)　為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		1,262,803,610	12.50
	内　オーストラリア	1,262,803,610	12.50
地方債証券		570,651,101	5.65
	内　オーストラリア	570,651,101	5.65
特殊債券		6,324,425,154	62.62
	内　オーストラリア	6,324,425,154	62.62
社債券		1,741,521,792	17.24
	内　オーストラリア	1,741,521,792	17.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		200,490,753	1.99
純資産総額		10,099,892,410	100.00

（注1）　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

（注2）　投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

（2）投資資産（2020年2月28日現在）

①　投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	10,000,000	112.93 812,468,778	113.92 819,605,226	3.250000 2026/07/21	8.11
2	EUROPEAN INVESTMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	9,500,000	116.40 795,546,691	116.37 795,348,496	4.750000 2024/08/07	7.87
3	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	オーストラリア	特殊債券	8,000,000	116.40 669,934,056	116.16 668,547,052	5.000000 2024/03/19	6.62
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	8,000,000	113.18 651,379,291	113.27 651,914,524	3.250000 2025/04/21	6.45
5	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,000,000	119.42 515,474,199	121.29 523,544,788	3.250000 2029/04/21	5.18
6	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	7,000,000	103.05 518,964,369	102.66 516,980,263	2.700000 2021/08/18	5.12
7	University of Sydney	オーストラリア	社債券	6,000,000	112.51 485,651,113	112.93 487,451,052	3.750000 2025/08/28	4.83
8	South Australia GOV.FIN.AUTH.	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	112.54 404,824,365	114.33 411,248,607	3.000000 2028/05/24	4.07

9	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY	オーストラリア	地方債証券	5,000,000	113.29 407,525,712	113.05 406,648,044	4.000000 2024/05/22	4.03
10	LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	110.63 397,950,498	109.53 393,993,798	5.500000 2022/03/29	3.90
11	NORDIC INVESTMENT BK.	オーストラリア	特殊債券	5,000,000	109.60 394,259,976	108.64 390,806,856	5.000000 2022/04/19	3.87
12	Commonwealth Bank of Australia	オーストラリア	社債券	5,000,000	104.53 376,008,798	104.10 374,447,700	3.250000 2022/01/17	3.71
13	Australian National University	オーストラリア	社債券	4,040,000	113.84 330,870,562	114.08 331,573,905	3.980000 2025/11/18	3.28
14	Airservices Australia	オーストラリア	特殊債券	4,400,000	103.97 329,124,636	102.64 324,914,707	4.750000 2020/11/19	3.22
15	TREASURY CORP VICTORIA	オーストラリア	特殊債券	3,500,000	111.51 280,773,546	115.32 290,376,817	3.000000 2028/10/20	2.88
16	LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	115.20 248,635,431	115.34 248,928,946	4.750000 2024/04/08	2.46
17	WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	111.57 240,801,165	112.78 243,401,796	3.000000 2026/10/21	2.41
18	ASIAN DEVELOPMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	109.30 235,902,051	108.27 233,676,946	5.000000 2022/03/09	2.31
19	LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	104.51 225,562,114	104.54 225,624,702	2.700000 2022/09/05	2.23
20	ASIAN DEVELOPMENT BANK	オーストラリア	特殊債券	3,000,000	101.74 219,586,059	101.70 219,497,572	2.800000 2021/01/19	2.17
21	Airservices Australia	オーストラリア	特殊債券	2,860,000	104.59 215,210,768	104.51 215,029,710	2.750000 2023/05/15	2.13
22	University Of Melbourne	オーストラリア	社債券	2,400,000	105.31 181,836,119	104.32 180,130,278	4.250000 2021/06/30	1.78
23	QUEENSLAND TREASURY CORP.	オーストラリア	特殊債券	2,000,000	121.85 175,320,657	121.20 174,388,315	5.750000 2024/07/22	1.73
24	AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY	オーストラリア	地方債証券	2,000,000	112.27 161,545,586	113.98 164,003,056	3.000000 2028/04/18	1.62
25	Toronto-Dominion Bank/The	オーストラリア	社債券	1,800,000	101.28 131,161,151	102.35 132,545,421	2.050000 2024/07/10	1.31
26	Westpac Banking Corp	オーストラリア	社債券	1,400,000	106.10 106,865,718	106.06 106,824,425	3.200000 2023/03/06	1.06
27	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	900,000	130.42 84,444,970	134.90 87,344,296	3.000000 2047/03/21	0.86

28	Macquarie University	オーストラリア	社債券	1,000,000	114.14 82,116,632	114.75 82,556,905	3.500000 2028/09/07	0.82
29	COUNCIL OF EUROPE	オーストラリア	特殊債券	1,065,000	104.83 80,321,254	103.01 78,927,607	6.000000 2020/10/08	0.78
30	INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT	オーストラリア	特殊債券	1,000,000	102.23 73,550,017	101.65 73,127,729	2.800000 2021/01/13	0.72

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	12.50%
地方債証券	5.65%
特殊債券	62.62%
社債券	17.24%
合計	98.01%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		758,141,493	47.89
	内　ユーロ	758,141,493	47.89
社債券		766,984,533	48.45
	内　ユーロ	766,984,533	48.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		57,885,583	3.66
純資産総額		1,583,011,609	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2020年2月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数または額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,700,000	134.04 274,176,913	130.70 267,339,008	4.500000 2026/03/28	16.89
2	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,900,000	110.75 253,201,528	109.66 250,709,821	0.750000 2028/11/25	15.84
3	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,000,000	107.61 129,485,977	106.19 127,770,214	0.500000 2026/05/25	8.07
4	Cooperatieve Rabobank UA	ユーロ	社債券	900,000	109.92 119,039,915	108.09 117,051,747	2.375000 2023/05/22	7.39
5	PROCTER & GAMBLE CO.	ユーロ	社債券	900,000	106.90 115,769,617	105.61 114,372,702	2.000000 2022/08/16	7.23
6	Banque Federative du Credit Mutuel SA	ユーロ	社債券	800,000	112.76 108,542,115	110.65 106,513,039	2.625000 2024/03/18	6.73
7	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	600,000	134.59 97,164,656	129.29 93,342,812	8.500000 2023/04/25	5.90
8	CIF Euromortgage SA	ユーロ	社債券	700,000	111.26 93,715,202	108.60 91,468,106	4.125000 2022/01/19	5.78
9	Svenska Handelsbanken AB	ユーロ	社債券	700,000	110.06 92,696,934	107.69 90,707,563	4.375000 2021/10/20	5.73
10	Total Capital International SA	ユーロ	社債券	500,000	105.51 63,477,824	104.22 62,699,955	2.125000 2021/11/19	3.96
11	Westpac Banking Corp	ユーロ	社債券	500,000	102.84 61,870,348	102.89 61,901,632	0.625000 2024/11/22	3.91
12	Pohjola Bank PLC	ユーロ	社債券	500,000	103.63 62,346,214	102.26 61,521,420	2.000000 2021/03/03	3.89
13	HSBC France SA	ユーロ	社債券	500,000	101.52 61,076,838	100.97 60,748,364	0.250000 2024/05/17	3.84
14	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	150,000	106.93 19,299,087	105.16 18,979,637	2.000000 2022/01/04	1.20

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	47.89%
社債券	48.45%
合計	96.34%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		1,641,178,584	35.36
	内　イギリス	1,641,178,584	35.36
特殊債券		888,294,788	19.14
	内　イギリス	888,294,788	19.14
社債券		1,808,012,232	38.95
	内　イギリス	1,808,012,232	38.95
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		303,889,250	6.55
純資産総額		4,641,374,854	100.00

(注1)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2)　投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（2020年2月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,700,000	132.00 689,193,234	129.97 678,608,573	4.250000 2027/12/07	14.62
2	Svenska Handelsbanken AB	イギリス	社債券	3,000,000	102.28 432,986,157	101.55 429,891,615	3.000000 2020/11/20	9.26
3	BNP Paribas SA	イギリス	社債券	3,000,000	100.55 425,696,414	100.69 426,267,910	1.125000 2022/08/16	9.18
4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,600,000	179.74 405,809,782	178.09 402,084,478	4.250000 2046/12/07	8.66
5	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	イギリス	特殊債券	2,200,000	100.68 312,568,527	100.96 313,440,869	1.125000 2021/12/07	6.75
6	RABOBANK NEDERLAND	イギリス	社債券	2,000,000	109.14 308,031,841	107.94 304,628,268	4.000000 2022/09/19	6.56
7	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	イギリス	特殊債券	2,000,000	102.10 288,166,375	103.45 291,973,523	1.375000 2024/12/09	6.29
8	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	イギリス	特殊債券	2,000,000	100.54 283,763,743	100.23 282,880,394	1.625000 2020/06/05	6.09
9	Total Capital International SA	イギリス	社債券	1,500,000	101.57 214,996,607	101.18 214,162,647	2.250000 2020/12/17	4.61
10	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,200,000	112.09 189,817,785	109.60 185,601,418	8.000000 2021/06/07	4.00
11	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,250,000	106.51 187,879,145	105.09 185,372,679	3.750000 2021/09/07	3.99
12	Dexia Credit Local SA	イギリス	社債券	1,200,000	100.23 169,723,156	100.21 169,701,143	0.875000 2021/09/07	3.66
13	Metropolitan Life Global Funding I	イギリス	社債券	1,000,000	104.81 147,905,857	104.46 147,409,150	2.625000 2022/12/05	3.18
14	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	750,000	109.02 115,383,883	107.35 113,619,655	4.000000 2022/03/07	2.45
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	500,000	108.67 76,677,057	107.56 75,891,780	1.500000 2026/07/22	1.64
16	Banque Federative du Credit Mutuel SA	イギリス	社債券	500,000	102.39 72,242,675	102.40 72,251,142	1.750000 2024/12/19	1.56
17	RABOBANK NEDERLAND	イギリス	社債券	300,000	104.66 44,305,717	103.23 43,700,355	4.625000 2021/01/13	0.94

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	35.36%
特殊債券	19.14%
社債券	38.95%
合計	93.45%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド

(1) 投資状況（2020年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
国債証券		38,231,635,074	77.48
	内　ユーロ	19,163,303,833	38.84
	内　ノルウェー	2,615,641,691	5.30
	内　スウェーデン	483,443,149	0.98
	内　デンマーク	9,492,568,372	19.24
	内　ポーランド	6,476,678,029	13.13
特殊債券		8,043,704,931	16.30
	内　ノルウェー	2,487,554,600	5.04
	内　スウェーデン	5,556,150,331	11.26
社債券		2,056,151,935	4.17
	内　ノルウェー	821,785,175	1.67
	内　スウェーデン	1,234,366,760	2.50
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,012,793,286	2.05
純資産総額		49,344,285,226	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,358,564,000	4.78
	内　日本	2,358,564,000	4.78
為替予約取引（売建）		2,637,936,787	△5.35
	内　日本	2,637,936,787	△5.35

(注1)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2)　投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3)　為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（2020年2月28日現在）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資比率 (%)
1	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	35,000,000	113.88 4,795,967,232	113.67 4,787,039,488	2.750000 2024/10/31	9.70
2	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	30,000,000	129.48 4,673,998,848	129.56 4,676,597,760	5.400000 2025/03/13	9.48
3	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	150,000,000	105.27 4,394,788,365	107.59 4,491,678,510	2.750000 2028/04/25	9.10
4	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	188,000,000	137.17 4,151,891,828	137.03 4,147,684,576	7.000000 2024/11/10	8.41
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	26,000,000	111.99 3,503,561,984	112.12 3,507,534,950	1.950000 2026/04/30	7.11
6	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	180,000,000	107.23 3,107,699,280	108.95 3,157,544,880	0.500000 2027/11/15	6.40
7	EUROPEAN INVESTMENT BANK	スウェーデン	特殊債券	200,000,000	104.49 2,365,834,720	105.77 2,394,813,920	1.250000 2025/05/12	4.85
8	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	71,000,000	100.46 1,985,078,555	100.45 1,984,999,518	1.750000 2021/07/25	4.02
9	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	113,000,000	108.19 1,968,446,214	108.51 1,974,231,588	1.500000 2023/11/15	4.00
10	EUROPEAN INVESTMENT BANK	スウェーデン	特殊債券	150,000,000	108.26 1,838,288,760	110.23 1,871,705,400	1.750000 2026/11/12	3.79

11	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	12,000,000	101.79 1,469,713,612	101.79 1,469,814,681	0.400000 2022/04/30	2.98
12	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	11,000,000	107.50 1,422,863,411	109.52 1,449,638,220	0.800000 2028/06/22	2.94
13	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	10,000,000	115.97 1,395,399,168	115.81 1,393,510,144	3.400000 2024/03/18	2.82
14	Sveriges Sakerstallda Obligationer AB	スウェーデン	社債券	100,000,000	107.40 1,215,847,240	109.04 1,234,366,760	2.000000 2026/06/17	2.50
15	Kommuninvest I Sverige AB	スウェーデン	特殊債券	102,500,000	103.10 1,196,350,521	104.00 1,206,816,427	1.000000 2024/10/02	2.45
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	9,000,000	110.77 1,199,538,662	111.22 1,204,411,622	1.750000 2024/11/25	2.44
17	KOMMUNALBANKEN	ノルウェー	特殊債券	100,000,000	99.86 1,163,427,250	102.65 1,195,895,800	2.000000 2027/11/29	2.42
18	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	90,000,000	106.86 1,120,469,040	107.47 1,126,896,345	3.000000 2024/03/14	2.28
19	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	85,000,000	102.19 1,011,985,987	102.77 1,017,709,632	2.000000 2023/05/24	2.06
20	Cooperatieve Rabobank UA	ノルウェー	社債券	50,000,000	99.49 579,564,200	101.01 588,424,025	1.750000 2024/07/10	1.19
21	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	ノルウェー	特殊債券	50,000,000	99.68 580,641,825	100.99 588,307,525	1.625000 2024/04/03	1.19
22	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	39,800,000	106.82 481,294,092	107.30 483,443,149	1.500000 2023/11/13	0.98
23	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	2,500,000	122.79 369,379,392	133.35 401,122,816	1.700000 2050/06/22	0.81
24	KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU	ノルウェー	特殊債券	30,000,000	100.45 351,072,750	100.64 351,764,760	1.670000 2023/05/24	0.71
25	EUROPEAN INVESTMENT BANK	ノルウェー	特殊債券	30,000,000	99.76 348,689,160	100.59 351,586,515	1.500000 2022/05/12	0.71
26	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	25,000,000	102.32 298,021,562	103.13 300,369,037	1.750000 2025/03/13	0.61
27	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	2,000,000	114.04 274,433,075	113.71 273,634,150	3.900000 2023/03/20	0.55
28	Nordea Bank Abp	ノルウェー	社債券	20,000,000	98.87 230,383,410	100.15 233,361,150	1.990000 2023/08/14	0.47

29	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	12,000,000	107.66 208,014,576	110.30 213,107,328	0.500000 2029/11/15	0.43
30	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	10,000,000	103.35 120,413,235	105.29 122,673,335	1.750000 2029/09/06	0.25

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	77.48%
特殊債券	16.30%
社債券	4.17%
合計	97.95%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	ノルウェー・クローネ 買/円売 2020年3月	買建	202,800,000	2,420,977,016	2,358,564,000	4.78%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2020年3月	売建	212,552,855	2,420,977,016	2,403,972,787	△4.87%
		ノルウェー・クローネ 売/円買 2020年3月	売建	20,100,000	235,869,480	233,964,000	△0.47%

(注1)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2)　為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3)　為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

（参考情報）運用実績

●ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）

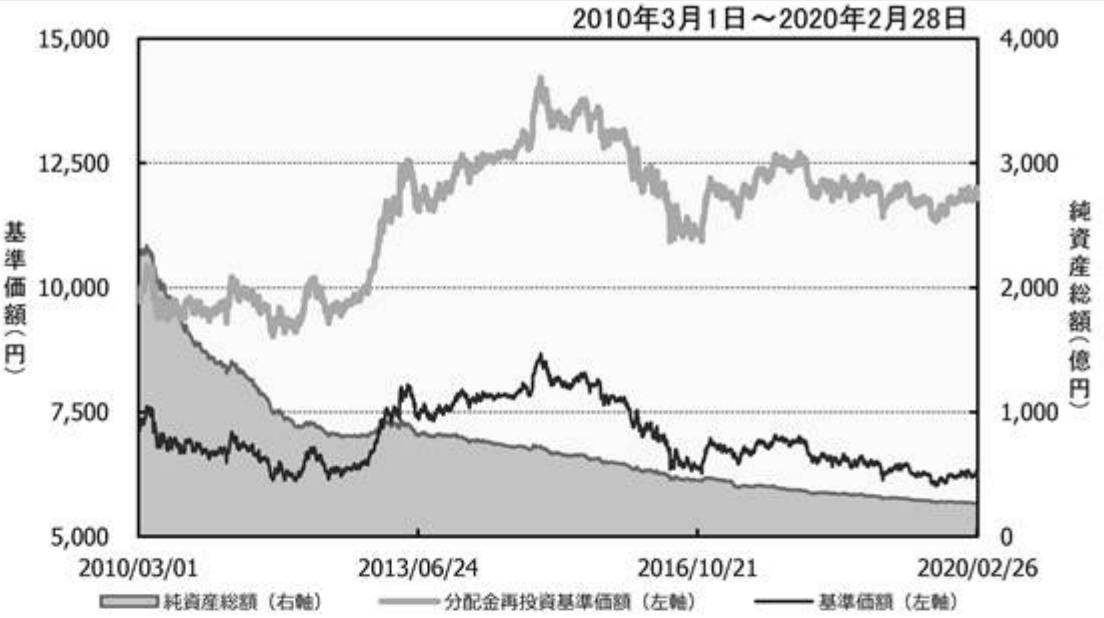
2020年2月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	6,201円
純資産総額	265億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−0.2%
3カ月間	−0.0%
6カ月間	2.9%
1年間	−1.4%
3年間	−0.3%
5年間	−12.4%
設定来	18.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　120円　　設定来分配金合計額：　5,195円

決算期	第159期 19年3月	第160期 19年4月	第161期 19年5月	第162期 19年6月	第163期 19年7月	第164期 19年8月	第165期 19年9月	第166期 19年10月	第167期 19年11月	第168期 19年12月	第169期 20年1月	第170期 20年2月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	165	96.4%
コール・ローン、その他		3.6%
合計	165	100.0%

債券種別構成	比率
国債	43.8%
事業債	23.6%
州債等	12.8%
政府機関債	9.9%
国際機関債	6.4%
合計	96.4%

通貨別構成	比率
米ドル	16.5%
カナダ・ドル	16.4%
豪ドル	16.3%
ユーロ	16.7%
英ポンド	16.3%
北欧・東欧通貨	16.7%
デンマーク・クローネ	5.4%
ノルウェー・クローネ	4.7%
ポーランド・ズロチ	3.7%
スウェーデン・クローネ	2.8%
合計（除く日本円）	98.9%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.8
最終利回り(%)	0.8
修正デュレーション	4.5
残存年数	5.1

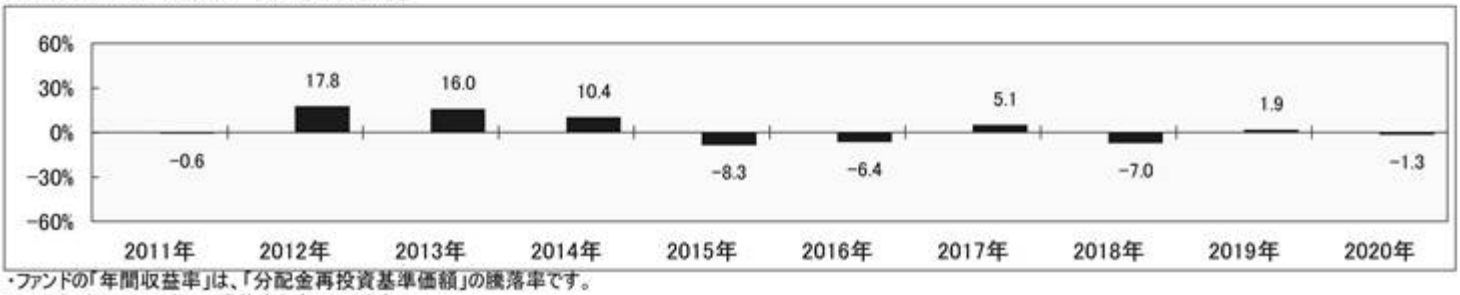
格付別構成	比率
AAA	54.7%
AA	41.5%
A	3.8%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
SPANISH GOVERNMENT BOND	2024/10/31	2.7%
IRISH TREASURY	2025/03/13	2.6%
Poland Government Bond	2028/04/25	2.5%
United Kingdom Gilt	2027/12/07	2.4%
United States Treasury Note/Bond	2020/09/30	2.4%
DANISH GOVERNMENT BOND	2024/11/10	2.3%
SPANISH GOVERNMENT BOND	2026/04/30	2.0%
DANISH GOVERNMENT BOND	2027/11/15	1.8%
United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	1.6%
Svenska Handelsbanken AB	2020/11/20	1.5%
合計		21.9%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2020年は2月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

【ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）】

(1) 【投資状況】 (2020年2月28日現在)

投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		41,474,768	99.52
	内 日本	41,474,768	99.52
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		200,886	0.48
純資産総額		41,675,654	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】 (2020年2月28日現在)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ･ヨーロッパ債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,329,452	1.5711 11,516,023	1.5680 11,492,580	27.58
2	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,274,381	1.6673 7,126,675	1.6565 7,080,512	16.99
3	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,898,667	1.8251 7,115,457	1.7802 6,940,406	16.65
4	ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,861,912	1.1896 6,973,910	1.1738 6,880,712	16.51
5	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	2,550,761	2.7190 6,935,687	2.6500 6,759,516	16.22
6	ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,325,174	1.7481 2,316,668	1.7515 2,321,042	5.57

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.52%
合計	99.52%

(注)　投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4計算期間末 (2010年8月20日)	72,312,740	72,380,763	1.0631	1.0641
第5計算期間末 (2011年2月21日)	51,471,523	51,519,337	1.0765	1.0775
第6計算期間末 (2011年8月22日)	53,070,704	53,120,599	1.0636	1.0646
第7計算期間末 (2012年2月20日)	50,467,236	50,513,920	1.0810	1.0820
第8計算期間末 (2012年8月20日)	41,297,113	41,335,477	1.0764	1.0774
第9計算期間末 (2013年2月20日)	51,542,889	51,582,967	1.2861	1.2871
第10計算期間末 (2013年8月20日)	45,386,476	45,421,749	1.2867	1.2877
第11計算期間末 (2014年2月20日)	54,254,821	54,294,401	1.3707	1.3717
第12計算期間末 (2014年8月20日)	65,511,675	65,558,298	1.4051	1.4061
第13計算期間末 (2015年2月20日)	69,015,255	69,061,816	1.4822	1.4832
第14計算期間末 (2015年8月20日)	131,788,358	131,876,833	1.4895	1.4905
第15計算期間末 (2016年2月22日)	109,270,360	109,352,687	1.3273	1.3283
第16計算期間末 (2016年8月22日)	57,130,727	57,177,627	1.2181	1.2191
第17計算期間末 (2017年2月20日)	62,682,830	62,730,992	1.3015	1.3025
第18計算期間末 (2017年8月21日)	62,361,315	62,408,099	1.3330	1.3340
第19計算期間末 (2018年2月20日)	49,455,578	49,492,910	1.3247	1.3257
第20計算期間末 (2018年8月20日)	49,560,288	49,598,621	1.2929	1.2939

第21計算期間末 (2019年2月20日)	47,204,261	47,240,521	1.3018	1.3028
2019年2月末日	47,196,447	－	1.3087	－
3月末日	46,823,333	－	1.3073	－
4月末日	43,442,465	－	1.3045	－
5月末日	42,500,367	－	1.2756	－
6月末日	40,185,378	－	1.2869	－
7月末日	39,348,045	－	1.2775	－
第22計算期間末 (2019年8月20日)	38,624,313	38,655,114	1.2540	1.2550
8月末日	38,583,244	－	1.2518	－
9月末日	38,742,793	－	1.2630	－
10月末日	39,460,982	－	1.2911	－
11月末日	39,404,582	－	1.2890	－
12月末日	42,043,901	－	1.3061	－
2020年1月末日	41,598,284	－	1.2918	－
第23計算期間末 (2020年2月20日)	42,170,974	42,203,316	1.3039	1.3049
2月末日	41,675,654	－	1.2877	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4計算期間	0.0010
第5計算期間	0.0010
第6計算期間	0.0010
第7計算期間	0.0010
第8計算期間	0.0010
第9計算期間	0.0010
第10計算期間	0.0010
第11計算期間	0.0010
第12計算期間	0.0010
第13計算期間	0.0010
第14計算期間	0.0010
第15計算期間	0.0010
第16計算期間	0.0010
第17計算期間	0.0010
第18計算期間	0.0010
第19計算期間	0.0010
第20計算期間	0.0010

第21計算期間	0.0010
第22計算期間	0.0010
第23計算期間	0.0010

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第4計算期間	△4.7
第5計算期間	1.4
第6計算期間	△1.1
第7計算期間	1.7
第8計算期間	△0.3
第9計算期間	19.6
第10計算期間	0.1
第11計算期間	6.6
第12計算期間	2.6
第13計算期間	5.6
第14計算期間	0.6
第15計算期間	△10.8
第16計算期間	△8.2
第17計算期間	6.9
第18計算期間	2.5
第19計算期間	△0.5
第20計算期間	△2.3
第21計算期間	0.8
第22計算期間	△3.6
第23計算期間	4.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第4計算期間	22,552,363	245,795,446
第5計算期間	19,729,044	39,938,527
第6計算期間	34,304,855	32,223,200
第7計算期間	4,079,130	7,289,887
第8計算期間	2,141,349	10,461,494
第9計算期間	9,937,312	8,223,731
第10計算期間	5,178,351	9,983,286
第11計算期間	16,207,380	11,899,828
第12計算期間	10,054,635	3,012,550

第13計算期間	3,969,009	4,030,630
第14計算期間	43,251,753	1,337,296
第15計算期間	1,487,787	7,636,347
第16計算期間	787,566	36,214,230
第17計算期間	9,142,534	7,880,306
第18計算期間	6,550,510	7,929,258
第19計算期間	1,773,321	11,225,421
第20計算期間	2,770,791	1,769,693
第21計算期間	2,686,729	4,759,119
第22計算期間	722,502	6,181,400
第23計算期間	1,812,584	271,626

（参考）マザーファンド

ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

—

ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

（参考情報）運用実績

●ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）

2020年2月28日現在　　※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,877円
純資産総額	41百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	−0.2%
3カ月間	−0.0%
6カ月間	2.9%
1年間	−1.5%
3年間	−0.3%
5年間	−12.6%
設定来	31.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において運用管理費用（信託報酬）は控除しています。

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　20円　　設定来分配金合計額：　230円

決算期	第12期 14年8月	第13期 15年2月	第14期 15年8月	第15期 16年2月	第16期 16年8月	第17期 17年2月	第18期 17年8月	第19期 18年2月	第20期 18年8月	第21期 19年2月	第22期 19年8月	第23期 20年2月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	165	96.4%
コール・ローン、その他		3.6%
合計	165	100.0%

債券種別構成	比率
国債	43.8%
事業債	23.7%
州債等	12.9%
政府機関債	9.8%
国際機関債	6.3%
合計	96.4%

通貨別構成	比率
米ドル	16.9%
カナダ・ドル	16.6%
豪ドル	16.2%
ユーロ	16.5%
英ポンド	16.3%
北欧・東欧通貨	16.5%
デンマーク・クローネ	5.3%
ノルウェー・クローネ	4.7%
ポーランド・ズロチ	3.7%
スウェーデン・クローネ	2.8%
合計（除く日本円）	98.9%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.8
最終利回り(%)	0.8
修正デュレーション	4.5
残存年数	5.1

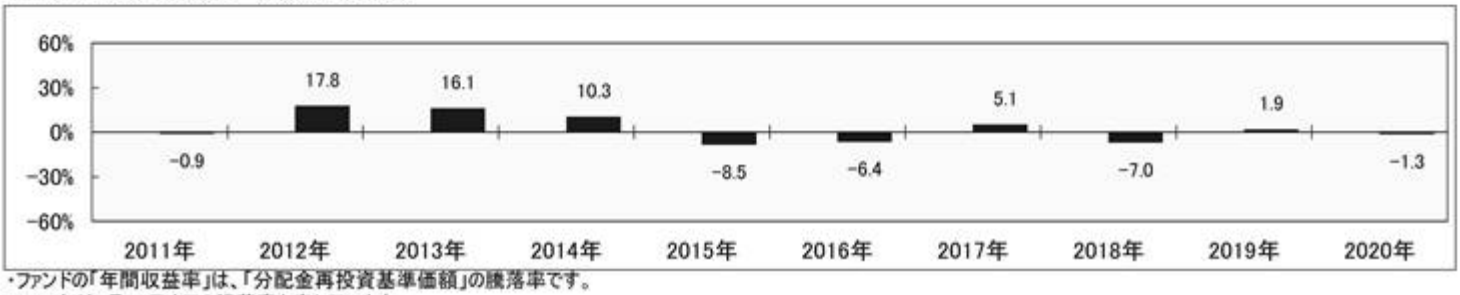
格付別構成	比率
AAA	54.7%
AA	41.5%
A	3.8%
BBB	−
BB	−
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
SPANISH GOVERNMENT BOND	2024/10/31	2.7%
IRISH TREASURY	2025/03/13	2.6%
Poland Government Bond	2028/04/25	2.5%
United States Treasury Note/Bond	2020/09/30	2.5%
United Kingdom Gilt	2027/12/07	2.4%
DANISH GOVERNMENT BOND	2024/11/10	2.3%
SPANISH GOVERNMENT BOND	2026/04/30	2.0%
DANISH GOVERNMENT BOND	2027/11/15	1.8%
United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	1.6%
United States Treasury Note/Bond	2022/04/30	1.5%
合計		21.8%

※格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。
※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2020年は2月28日までの騰落率を表しています。

委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２　【管理及び運営】

１　【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、シカゴ商品取引所における米国債先物取引またはロンドン証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受付けは行ないません。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込みの受付けを中止することができます。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

２　【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

＜一部解約＞

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、シカゴ商品取引所における米国債先物取引またはロンドン証券取引所のいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受付けは行ないません。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
　電話番号（コールセンター）　0120-106212
　（営業日の9:00～17:00）
・委託会社のホームページ
　アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

「毎月分配型」または「年2回決算型」の受益者が当該ファンドの一部解約金の手取金をもって他のファンドの受益権の取得申込みをする場合において、当該他のファンドの受益権の取得申込みの受付けが中止された場合、委託会社は、当該一部解約請求の申込みの受付けを中止することができます。（なお、他のファンドとは、受益者が「毎月分配型」の受益者である場合、「年2回決算型」を、また「年2回決算型」の受益者である場合、「毎月分配型」をいいます。）

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数

と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3　【資産管理等の概要】

(1)　【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・公社債等：原則として、次のいずれかの価額で評価します。

1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
2. 価格情報会社の提供する価額

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2)　【保管】

該当事項はありません。

(3)　【信託期間】

無期限とします。ただし、(5)①により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)　【計算期間】

＜ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）＞

毎月21日から翌月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2005年12月16日から2006年1月5日までとし、第13計算期間は、2006年12月6日から2007年1月20日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

＜ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）＞

毎年2月21日から8月20日まで、および8月21日から翌年2月20日までとします。ただし、第1計算期間は、2008年10月31日から2009年2月20日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

＜ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）＞

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行ないません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

③ 反対者の買取請求権

前①の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前②の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前①の3.または前②の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

④ 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年2月および8月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
   ・委託会社のホームページ
   アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。
   https://www.daiwa-am.co.jp/
2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥ 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

＜ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）＞

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2. から前4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2. から前4. までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1. から7. までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当

する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3. において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2. から前5. までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1. から前6. までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1. から前7. までの規定にしたがいます。

③　反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

④　運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

⑤　公告

（ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）と同規定）

⑥　関係法人との契約の更改

（ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）と同規定）

4　【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

① 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

② 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「２　換金（解約）手続等」をご参照下さい。

第３　【ファンドの経理状況】

【ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2019年8月21日から2020年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	前　期 2019年8月20日現在	当　期 2020年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	208,386,495	202,351,829
親投資信託受益証券	27,769,772,692	26,830,255,424
未収入金	26,360,809	101,087,906
流動資産合計	28,004,519,996	27,133,695,159
資産合計	28,004,519,996	27,133,695,159
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	45,797,722	42,939,886
未払解約金	23,987,177	97,431,680
未払受託者報酬	1,209,518	1,256,028
未払委託者報酬	29,028,621	30,144,888
その他未払費用	1,057,103	1,112,642
流動負債合計	101,080,141	172,885,124
負債合計	101,080,141	172,885,124
純資産の部		
元本等		
元本	※1 45,797,722,602	※1 42,939,886,382
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 △ 17,894,282,747	※2 △ 15,979,076,347
（分配準備積立金）	174,961,027	194,601,303
元本等合計	27,903,439,855	26,960,810,035
純資産合計	27,903,439,855	26,960,810,035
負債純資産合計	28,004,519,996	27,133,695,159

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前　期 自　2019年2月21日 至　2019年8月20日	当　期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
営業収益		
受取利息	―	216
有価証券売買等損益	△ 848,998,070	1,289,021,897
営業収益合計	△ 848,998,070	1,289,022,113
営業費用		
支払利息	52,291	31,834
受託者報酬	7,928,690	7,601,760
委託者報酬	190,289,622	182,443,627
その他費用	1,058,566	1,112,756
営業費用合計	199,329,169	191,189,977
営業利益又は営業損失（△）	△ 1,048,327,239	1,097,832,136
経常利益又は経常損失（△）	△ 1,048,327,239	1,097,832,136
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 1,048,327,239	1,097,832,136
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 3,852,266	△ 2,040,052
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 17,720,655,231	△ 17,894,282,747
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,180,587,544	1,109,463,222
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,180,587,544	1,109,463,222
剰余金減少額又は欠損金増加額	28,959,758	28,588,537
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	28,959,758	28,588,537
分配金	※1 280,780,329	※1 265,540,473
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△ 17,894,282,747	△ 15,979,076,347

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	当　期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	前　期 2019年8月20日現在	当　期 2020年2月20日現在
1.　※1　期首元本額	48,944,418,747円	45,797,722,602円
期中追加設定元本額	78,841,092円	75,309,744円
期中一部解約元本額	3,225,537,237円	2,933,145,964円
2.　特定期間末日における受益権の総数	45,797,722,602口	42,939,886,382口
3.　※2　元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は17,894,282,747円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,979,076,347円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	前　期 自　2019年2月21日 至　2019年8月20日	当　期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日

※1　分配金の計算過程	（自2019年2月21日　至2019年3月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（65,689,679円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（59,111,358円）及び分配準備積立金（176,260,213円）より分配対象額は301,061,250円（1万口当たり62.97円）であり、うち47,812,590円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年3月21日　至2019年4月22日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（45,599,916円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,558,862円）及び分配準備積立金（192,093,030円）より分配対象額は296,251,808円（1万口当たり62.60円）であり、うち47,321,237円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2019年8月21日　至2019年9月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（61,367,989円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（56,566,954円）及び分配準備積立金（173,739,627円）より分配対象額は291,674,570円（1万口当たり64.12円）であり、うち45,490,684円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年9月21日　至2019年10月21日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（64,820,621円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（56,274,930円）及び分配準備積立金（188,393,553円）より分配対象額は309,489,104円（1万口当たり68.46円）であり、うち45,209,559円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

		（自2019年4月23日　至2019年5月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（36,592,762円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（58,249,045円）及び分配準備積立金（189,144,191円）より分配対象額は283,985,998円（1万口当たり60.39円）であり、うち47,028,466円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年5月21日　至2019年6月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（39,519,069円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,786,021円）及び分配準備積立金（177,076,155円）より分配対象額は274,381,245円（1万口当たり58.87円）であり、うち46,611,230円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2019年10月22日　至2019年11月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（31,084,466円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（55,429,923円）及び分配準備積立金（204,598,584円）より分配対象額は291,112,973円（1万口当たり65.45円）であり、うち44,481,367円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年11月21日　至2019年12月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（55,565,465円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（54,725,649円）及び分配準備積立金（188,501,963円）より分配対象額は298,793,077円（1万口当たり68.11円）であり、うち43,866,454円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

	（自2019年6月21日　至2019年7月22日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（66,040,738円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,347,210円）及び分配準備積立金（168,463,580円）より分配対象額は291,851,528円（1万口当たり63.16円）であり、うち46,209,084円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2019年7月23日　至2019年8月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（34,191,250円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（56,893,935円）及び分配準備積立金（186,567,499円）より分配対象額は277,652,684円（1万口当たり60.63円）であり、うち45,797,722円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	（自2019年12月21日　至2020年1月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（55,830,745円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（54,391,618円）及び分配準備積立金（198,716,061円）より分配対象額は308,938,424円（1万口当たり70.93円）であり、うち43,552,523円（1万口当たり10円）を分配金額としております。 （自2020年1月21日　至2020年2月20日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（29,576,976円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（53,695,062円）及び分配準備積立金（207,964,213円）より分配対象額は291,236,251円（1万口当たり67.82円）であり、うち42,939,886円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	当　期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	当　期 2020年2月20日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	前　期 2019年8月20日現在	当　期 2020年2月20日現在

種　類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△620,611,561	△10,751,239
合計	△620,611,561	△10,751,239

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前　期 2019年8月20日現在	当　期 2020年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

当　期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前　期 2019年8月20日現在	当　期 2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	0.6093円 (6,093円)	0.6279円 (6,279円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	2,689,165,668	4,483,645,918	
	ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド	857,481,559	1,499,049,261	
	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	1,637,154,519	4,451,586,852	
	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	2,463,742,490	4,496,576,418	
	ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド	4,744,366,474	7,454,348,603	

	ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド	3,736,276,685	4,445,048,372	
親投資信託受益証券　合計			26,830,255,424	
合計			26,830,255,424	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド」受益証券及び「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	351,416,430	282,685,618
コール・ローン	6,262,173	210,537,044
国債証券	16,432,474,692	12,753,809,592
特殊債券	543,147,120	339,445,173
社債券	13,958,814,518	7,981,126,790
派生商品評価勘定	5,500	―
未収利息	159,385,831	107,006,229
前払費用	9,816,317	4,229,416
差入委託証拠金	141,078,528	148,110,506

流動資産合計	31,602,401,109	21,826,950,368
資産合計	31,602,401,109	21,826,950,368
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	418,000	―
未払解約金	75,293,805	125,721,260
流動負債合計	75,711,805	125,721,260
負債合計	75,711,805	125,721,260
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	19,963,321,192	13,016,143,706
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	11,563,368,112	8,685,085,402
元本等合計	31,526,689,304	21,701,229,108
純資産合計	31,526,689,304	21,701,229,108
負債純資産合計	31,602,401,109	21,826,950,368

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1．※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	21,873,526,314円	19,963,321,192円
期中追加設定元本額	99,128,683円	9,729,459円
期中一部解約元本額	2,009,333,805円	6,956,906,945円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）	136,456,380円	136,347,557円
常陽３分法ファンド	103,305,627円	94,010,297円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	21,085,723円	17,418,450円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	2,974,660,282円	2,689,165,668円
ダイワ・グローバル債券ファンド（年2回決算型）	75,032,732円	45,997,472円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	4,129,435円	4,274,381円
ダイワ・グローバル債券ファンド（毎月分配型）	16,648,651,013円	10,028,929,881円

計	19,963,321,192円	13,016,143,706円
2.　期末日における受益権の総数	19,963,321,192口	13,016,143,706口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1.　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年2月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,025,394,024	△84,949,748
特殊債券	21,106,035	△1,759,337
社債券	189,801,837	△21,515,432
合計	1,236,301,896	△108,224,517

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年3月6日から2019年8月20日まで、及び2019年9月6日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2019年8月20日 現在				2020年2月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	191,519,500	－	191,932,000	△412,500	－	－	－	－
アメリカ・ドル	191,519,500	－	191,932,000	△412,500	－	－	－	－
合計	191,519,500	－	191,932,000	△412,500	－	－	－	－

（注）　1.　時価の算定方法

(1)　期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5792円 (15,792円)	1.6673円 (16,673円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	20,000,000.000	20,117,800.000	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20410515	5,600,000.000	7,996,184.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	17,500,000.000	17,624,250.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	13,000,000.000	14,246,050.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	9,000,000.000	9,009,090.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	15,000,000.000	15,751,050.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	1,500,000.000	1,659,015.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20200930	28,000,000.000	28,206,640.000	

	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 114,610,079.000 (12,753,809,592)	
国債証券　合計				12,753,809,592 [12,753,809,592]	
特殊債券	アメリカ・ドル	2.375% Temasek Financial I Ltd 20230123	アメリカ・ドル 3,000,000.000	アメリカ・ドル 3,050,370.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 3,050,370.000 (339,445,173)	
特殊債券　合計				339,445,173 [339,445,173]	
社債券	アメリカ・ドル	2.125% Toronto-Dominion Bank/The 20210407	アメリカ・ドル 7,500,000.000	アメリカ・ドル 7,541,625.000	
		4.125% HSBC Bank PLC 20200812	7,000,000.000	7,079,870.000	
		2.5% United Overseas Bank Ltd 20200318	3,000,000.000	3,001,410.000	
		4.125% Total Capital SA 20210128	3,000,000.000	3,068,310.000	
		1.55% Microsoft Corp 20210808	5,000,000.000	5,001,150.000	
		2.7% Total Capital International SA 20230125	5,000,000.000	5,147,800.000	
		2.355% Chevron Corp 20221205	5,000,000.000	5,088,750.000	
		2.8% National Australia Bank Ltd/New York 20220110	6,000,000.000	6,119,460.000	
		2.4% COMMONWEALTH BK AUSTR NY 20201102	4,000,000.000	4,018,880.000	
		2.1% Royal Bank of Canada 20201014	5,000,000.000	5,012,550.000	
		4.5% RABOBANK NEDERLAND 20210111	5,500,000.000	5,637,720.000	
		3.2% Sumitomo Mitsui Banking Corp 20220718	5,000,000.000	5,153,400.000	
		3.95% Sumitomo Mitsui Banking Corp 20230719	4,000,000.000	4,262,640.000	
		2.85% Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd/The 20210908	5,500,000.000	5,587,560.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル	

			71,721,125.000 (7,981,126,790)	
社債券　合計			7,981,126,790 [7,981,126,790]	
合計			21,074,381,555 [21,074,381,555]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 特殊債券 社債券	8銘柄 1銘柄 14銘柄	100%	100%

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在 金　額（円）	2020年2月20日現在 金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,637,177,300	1,824,250,237
コール・ローン	548,272,710	448,792,761
国債証券	21,016,272,472	17,126,265,014
地方債証券	63,265,996,808	62,857,029,291
特殊債券	11,996,806,452	10,385,256,631
社債券	57,784,259,051	57,461,663,378
未収入金	―	1,691,828,204
未収利息	1,404,269,152	1,211,127,300
前払費用	3,557,053	―

差入委託証拠金	82,631,700	87,358,416
流動資産合計	157,739,242,698	153,093,571,232
資産合計	157,739,242,698	153,093,571,232
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	12,782,000
未払金	－	868,602,970
未払解約金	27,592,673	534,932,375
流動負債合計	27,592,673	1,416,317,345
負債合計	27,592,673	1,416,317,345
純資産の部		
元本等		
元本 ※1	91,524,775,041	83,105,885,556
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	66,186,874,984	68,571,368,331
元本等合計	157,711,650,025	151,677,253,887
純資産合計	157,711,650,025	151,677,253,887
負債純資産合計	157,739,242,698	153,093,571,232

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1．※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	103,773,325,351円	91,524,775,041円
期中追加設定元本額	86,583,287円	4,737,368,482円
期中一部解約元本額	12,335,133,597円	13,156,257,967円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	122,422,590円	124,974,910円
常陽３分法ファンド	93,013,732円	86,231,682円
ダイワ高格付カナダドル債オープン（年1回決算型）	1,668,327,753円	1,462,230,714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）	73,717,184円	59,513,843円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	18,938,914円	15,997,317円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	2,695,259,036円	2,463,742,490円

ダイワ・グローバル債券ファンド（年2回決算型）	44,833,435円	62,693,334円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	3,727,889円	3,898,667円
ダイワ高格付カナダドル債オープン（毎月分配型）	76,771,030,704円	65,055,097,608円
ダイワ・グローバル債券ファンド（毎月分配型）	10,033,503,804円	13,771,504,991円
計	91,524,775,041円	83,105,885,556円
2. 期末日における受益権の総数	91,524,775,041口	83,105,885,556口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年2月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	700,608,164	372,016,584
地方債証券	646,655,611	217,067,723
特殊債券	348,635,137	144,774,180
社債券	6,594,107	△75,400,093
合計	1,702,493,019	658,458,394

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年5月11日から2019年8月20日まで、及び2019年11月12日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2019年8月20日 現在				2020年2月20日 現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								

売 建	－	－	－	－	829,118,000	－	841,900,000	△12,782,000
カナダ･ドル	－	－	－	－	829,118,000	－	841,900,000	△12,782,000
合計	－	－	－	－	829,118,000	－	841,900,000	△12,782,000

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7232円 (17,232円)	1.8251円 (18,251円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	12,000,000.000	12,554,520.000	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	43,000,000.000	55,925,800.000	

		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	60,000,000.000	60,494,400.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	32,000,000.000	33,584,000.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	40,000,000.000	40,792,800.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 203,351,520.000 (17,126,265,014)	
国債証券　合計				17,126,265,014 [17,126,265,014]	
地方債証券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		9.6% Province of Nova Scotia Canada 20220130	3,430,000.000	3,945,151.700	
		9.375% Province of Quebec Canada 20230116	15,000,000.000	18,252,450.000	
		4.25% Province of Quebec Canada 20211201	66,000,000.000	69,014,880.000	
		2.5% Province of Quebec Canada 20260901	92,000,000.000	95,897,120.000	
		9.5% ONTARIO PROVINCE 20250602	7,822,000.000	10,873,440.420	
		3.15% ONTARIO PROVINCE 20220602	20,000,000.000	20,676,800.000	
		3.5% ONTARIO PROVINCE 20240602	83,000,000.000	89,117,100.000	
		2.4% ONTARIO PROVINCE 20260602	65,000,000.000	67,243,150.000	
		2.9% ONTARIO PROVINCE 20280602	50,000,000.000	53,757,000.000	
		9.6% Province of Saskatchewan Canada 20220204	40,683,000.000	46,904,651.190	
		8.75% PROVINCE OF SASKATCHEWAN 20250530	2,000,000.000	2,697,400.000	
		9.95% BRITISH COLUMBIA 20210515	22,430,000.000	24,680,850.500	
		9% BRITISH COLUMBIA 20240823	11,860,000.000	15,594,595.400	
		9.5% BRITISH COLUMBIA 20220609	89,400,000.000	105,062,880.000	

		3.25% BRITISH COLUMBIA 20211218	10,000,000.000	10,287,900.000	
		2.2% Province of Alberta Canada 20260601	78,000,000.000	79,513,200.000	
		3.3% Province of Alberta Canada 20461201	6,000,000.000	7,145,940.000	
		2.35% Province of Alberta Canada 20250601	25,000,000.000	25,678,750.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 746,343,259.210 (62,857,029,291)	
地方債証券　合計				62,857,029,291 [62,857,029,291]	
特殊債券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		3.29% PSP Capital Inc 20240404	25,000,000.000	26,590,750.000	
		3% PSP Capital Inc 20251105	25,000,000.000	26,657,500.000	
		3% CPPIB Capital Inc 20280615	15,000,000.000	16,243,800.000	
		2.65% CANADA HOUSING TRUST 20281215	50,000,000.000	53,819,000.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 123,311,050.000 (10,385,256,631)	
特殊債券　合計				10,385,256,631 [10,385,256,631]	
社債券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.621% Toronto-Dominion Bank/The 20211222	65,000,000.000	65,915,850.000	
		1.68% Toronto-Dominion Bank/The 20210608	62,000,000.000	61,893,980.000	
		1.909% Toronto-Dominion Bank/The 20230718	25,000,000.000	25,009,500.000	
		2.542% HSBC Bank Canada 20230131	35,000,000.000	35,511,000.000	
		2.17% HSBC Bank Canada 20220629	10,000,000.000	10,044,900.000	
		2.908% HSBC Bank Canada 20210929	20,000,000.000	20,311,600.000	
		2.449% HSBC Bank Canada 20210129	35,000,000.000	35,177,800.000	

		1.816% HSBC Bank Canada 20200707	30,000,000.000	29,994,300.000	
		2.513% Apple Inc 20240819	50,000,000.000	51,231,000.000	
		2.47% Canadian Imperial Bank of Commerce/Canad 20221205	20,000,000.000	20,300,600.000	
		10.5% HYDRO QUEBEC 20211015	14,660,000.000	16,753,741.200	
		9.625% HYDRO QUEBEC 20220715	30,835,000.000	36,601,761.700	
		10.125% Ontario Electricity Financial Corp 20211015	68,681,000.000	78,075,187.180	
		8.9% Ontario Electricity Financial Corp 20220818	60,274,000.000	70,777,949.980	
		9% Ontario Electricity Financial Corp 20250526	5,400,000.000	7,322,886.000	
		2.89% Bank of Montreal 20230620	10,000,000.000	10,309,000.000	
		1.59% Royal Bank of Canada 20200323	20,000,000.000	19,996,400.000	
		1.968% Royal Bank of Canada 20220302	35,000,000.000	35,060,200.000	
		2.333% Royal Bank of Canada 20231205	12,000,000.000	12,159,240.000	
		1.583% Royal Bank of Canada 20210913	40,000,000.000	39,833,600.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 682,280,496.060 (57,461,663,378)	
社債券　合計				57,461,663,378 [57,461,663,378]	
合計				147,830,214,314 [147,830,214,314]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
カナダ・ドル	国債証券　5銘柄 地方債証券　18銘柄 特殊債券　4銘柄 社債券　20銘柄	100%	100%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	67,533,950	60,626,375
コール・ローン	26,117,624	19,693,452
国債証券	1,212,304,870	1,288,578,667
地方債証券	574,348,577	584,951,910
特殊債券	6,977,159,973	6,500,869,475
社債券	1,752,334,603	1,789,517,152
未収利息	85,582,240	87,496,150
前払費用	140,556	4,964,576
差入委託証拠金	37,264,817	38,422,206
流動資産合計	10,732,787,210	10,375,119,963
資産合計	10,732,787,210	10,375,119,963
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,731,262	1,314,586
流動負債合計	3,731,262	1,314,586
負債合計	3,731,262	1,314,586
純資産の部		
元本等		
元本　※1	4,091,835,400	3,815,151,998
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,637,220,548	6,558,653,379
元本等合計	10,729,055,948	10,373,805,377
純資産合計	10,729,055,948	10,373,805,377

負債純資産合計	10,732,787,210	10,375,119,963

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1.　※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	4,578,759,517円	4,091,835,400円
期中追加設定元本額	16,013,064円	29,186,793円
期中一部解約元本額	502,937,181円	305,870,195円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	79,444,966円	82,566,916円
常陽３分法ファンド	60,044,035円	56,724,079円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	12,300,893円	10,564,391円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	1,760,178,044円	1,637,154,519円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	2,432,788円	2,549,400円
ダイワ高格付豪ドル債オープン（毎月分配型）	2,177,434,674円	2,025,592,693円
計	4,091,835,400円	3,815,151,998円
2.　期末日における受益権の総数	4,091,835,400口	3,815,151,998口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3．　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ　金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1．　金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．　金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年2月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	59,033,160	△4,116,659
地方債証券	26,478,588	△2,946,045
特殊債券	190,700,539	△26,910,507
社債券	64,821,256	△8,390,163
合計	341,033,543	△42,363,374

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年4月16日から2019年8月20日まで、及び2019年10月16日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6221円 (26,221円)	2.7191円 (27,191円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	オーストラリア・ドル	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	オーストラリア・ドル 6,000,000.000	オーストラリア・ドル 7,174,980.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	8,000,000.000	8,993,440.000	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	900,000.000	1,169,829.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 17,338,249.000 (1,288,578,667)	
国債証券　合計				1,288,578,667 [1,288,578,667]	
地方債証券	オーストラリア・ドル	4% AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 20240522	オーストラリア・ドル 5,000,000.000	オーストラリア・ドル 5,617,800.000	
		3% AUSTRALIAN CAPITAL TERRITORY 20280418	2,000,000.000	2,252,920.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 7,870,720.000 (584,951,910)	
地方債証券　合計				584,951,910 [584,951,910]	
特殊債券	オーストラリア・ドル	4.75% LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK 20240408	オーストラリア・ドル 3,000,000.000	オーストラリア・ドル 3,441,930.000	

		5.5% LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK 20220329	5,000,000.000	5,468,600.000	
		2.7% LANDWIRTSCHAFT RENTENBANK 20220905	3,000,000.000	3,126,900.000	
		5% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20240319	8,000,000.000	9,250,960.000	
		4.75% Airservices Australia 20201119	4,400,000.000	4,517,172.000	
		2.75% Airservices Australia 20230515	2,860,000.000	2,978,432.600	
		3% WESTERN AUSTRALIAN TREASURY CORP. 20261021	3,000,000.000	3,350,790.000	
		3% South Australia GOV.FIN.AUTH. 20280524	5,000,000.000	5,649,050.000	
		3% TREASURY CORP VICTORIA 20281020	3,500,000.000	3,989,650.000	
		5.75% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20240722	2,000,000.000	2,410,520.000	
		3.25% QUEENSLAND TREASURY CORP. 20260721	10,000,000.000	11,286,700.000	
		2.8% INTL. BK. RECON&DEVELOPMENT 20210113	1,000,000.000	1,015,870.000	
		4.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20240807	9,500,000.000	10,997,200.000	
		5% NORDIC INVESTMENT BK. 20220419	5,000,000.000	5,422,200.000	
		6% COUNCIL OF EUROPE 20201008	1,065,000.000	1,097,908.500	
		5% ASIAN DEVELOPMENT BANK 20220309	3,000,000.000	3,243,360.000	
		2.8% ASIAN DEVELOPMENT BANK 20210119	3,000,000.000	3,049,020.000	
		2.7% INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 20210818	7,000,000.000	7,175,070.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 87,471,333.100 (6,500,869,475)	
特殊債券　合計				6,500,869,475 [6,500,869,475]	
社債券	オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	

		2.05% Toronto-Dominion Bank/The 20240710	1,800,000.000	1,830,726.000	
		3.75% University of Sydney 20250828	6,000,000.000	6,726,780.000	
		3.98% Australian National University 20251118	4,040,000.000	4,570,734.800	
		3.2% Bank of Nova Scotia/Australia 20230907	600,000.000	636,462.000	
		4.25% University Of Melbourne 20210630	2,400,000.000	2,501,640.000	
		3.5% Macquarie University 20280907	1,000,000.000	1,134,780.000	
		3.25% Commonwealth Bank of Australia 20220117	5,000,000.000	5,197,450.000	
		3.2% Westpac Banking Corp 20230306	1,400,000.000	1,479,968.000	
	オーストラリア・ドル　小計			オーストラリア・ドル 24,078,540.800 (1,789,517,152)	
社債券　合計				1,789,517,152 [1,789,517,152]	
合計				10,163,917,204 [10,163,917,204]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
オーストラリア・ドル	国債証券 地方債証券 特殊債券 社債券	3銘柄 2銘柄 18銘柄 8銘柄	100%	100%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	15,137,615	13,703,073
コール・ローン	2,691,239	14,228,937
国債証券	769,342,701	755,712,543
社債券	815,115,238	767,172,330
派生商品評価勘定	80	―
未収入金	12,287,717	―
未収利息	16,362,323	22,365,372
前払費用	684,078	525,489
差入委託証拠金	11,680,476	11,828,603
流動資産合計	1,643,301,467	1,585,536,347
資産合計	1,643,301,467	1,585,536,347
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,217,943	―
流動負債合計	2,217,943	―
負債合計	2,217,943	―
純資産の部		
元本等		
元本　※1	947,194,251	906,941,379
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	693,889,273	678,594,968
元本等合計	1,641,083,524	1,585,536,347
純資産合計	1,641,083,524	1,585,536,347
負債純資産合計	1,643,301,467	1,585,536,347

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2.　デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3.　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1.　※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	1,021,203,108円	947,194,251円
期中追加設定元本額	200,463円	2,913,654円
期中一部解約元本額	74,209,320円	43,166,526円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	40,933,664円	42,647,553円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	6,244,687円	5,487,706円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	898,774,352円	857,481,559円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	1,241,548円	1,324,561円
計	947,194,251円	906,941,379円
2.　期末日における受益権の総数	947,194,251口	906,941,379口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4.　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	28,328,048	△17,422,804
社債券	2,797,676	△11,168,566
合計	31,125,724	△28,591,370

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年3月6日から2019年8月20日まで、及び2019年9月6日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種　類	2019年8月20日 現在				2020年2月20日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	11,820,080	－	11,820,000	80	－	－	－	－
ユーロ	11,820,080	－	11,820,000	80	－	－	－	－

合計	11,820,080	－	11,820,000	80	－	－	－	－

（注） 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7326円 (17,326円)	1.7482円 (17,482円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	150,000.000	157,578.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	600,000.000	776,364.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	1,000,000.000	1,058,330.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	1,900,000.000	2,071,684.000	

		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,700,000.000	2,218,466.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 6,282,422.000 (755,712,543)	
国債証券　合計				755,712,543 [755,712,543]	
社債券	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		2.625% Banque Federative du Credit Mutuel SA 20240318	800,000.000	885,880.000	
		2.375% Cooperatieve Rabobank UA 20230522	900,000.000	973,449.000	
		4.375% Svenska Handelsbanken AB 20211020	700,000.000	754,215.000	
		2.125% Total Capital International SA 20211119	500,000.000	521,035.000	
		4.125% CIF Euromortgage SA 20220119	700,000.000	760,571.000	
		2% PROCTER & GAMBLE CO. 20220816	900,000.000	950,895.000	
		0.25% HSBC France SA 20240517	500,000.000	505,565.000	
		2% Pohjola Bank PLC 20210303	500,000.000	511,640.000	
		0.625% Westpac Banking Corp 20241122	500,000.000	514,440.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 6,377,690.000 (767,172,330)	
社債券　合計				767,172,330 [767,172,330]	
合計				1,522,884,873 [1,522,884,873]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
ユーロ	国債証券　5銘柄 社債券　9銘柄	100%	100%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	45,205,559	168,557,968
コール・ローン	18,894,644	100,113,032
国債証券	1,745,242,069	1,654,031,609
特殊債券	778,522,628	902,776,261
社債券	2,117,430,723	1,841,394,480
未収利息	45,553,667	32,481,879
前払費用	441,525	365,936
差入委託証拠金	29,527,468	32,868,643
流動資産合計	4,780,818,283	4,732,589,808
資産合計	4,780,818,283	4,732,589,808
負債の部		
流動負債		
未払解約金	－	26,828,570
流動負債合計	－	26,828,570
負債合計	－	26,828,570
純資産の部		
元本等		
元本　※1	4,477,344,421	3,955,502,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	303,473,862	750,258,239
元本等合計	4,780,818,283	4,705,761,238
純資産合計	4,780,818,283	4,705,761,238
負債純資産合計	4,780,818,283	4,732,589,808

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1.　※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	4,728,889,848円	4,477,344,421円
期中追加設定元本額	1,711,591円	15,203,211円
期中一部解約元本額	253,257,018円	537,044,633円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）	190,472,097円	189,039,194円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	29,646,547円	24,326,229円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	4,251,298,112円	3,736,276,685円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	5,927,665円	5,860,891円
計	4,477,344,421円	3,955,502,999円
2.　期末日における受益権の総数	4,477,344,421口	3,955,502,999口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年2月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	58,014,399	△42,700,805
特殊債券	△667,343	1,290,928
社債券	6,425,373	△9,367,860
合計	63,772,429	△50,777,737

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年4月6日から2019年8月20日まで、及び2019年10月8日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0678円 (10,678円)	1.1897円 (11,897円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	500,000.000	533,225.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,200,000.000	1,315,032.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,600,000.000	2,773,760.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	3,700,000.000	4,763,047.000	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	750,000.000	803,617.500	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	1,250,000.000	1,312,025.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 11,500,706.500 (1,654,031,609)	
国債証券　合計				1,654,031,609 [1,654,031,609]	
特殊債券	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
		1.625% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20200605	2,000,000.000	2,005,000.000	
		1.125% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20211207	2,200,000.000	2,216,126.000	
		1.375% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20241209	2,000,000.000	2,056,000.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 6,277,126.000 (902,776,261)	
特殊債券　合計				902,776,261 [902,776,261]	

社債券	イギリス・ポンド	1.75% Banque Federative du Credit Mutuel SA 20241219	イギリス・ポンド 500,000.000	イギリス・ポンド 511,600.000	
		3% Svenska Handelsbanken AB 20201120	3,000,000.000	3,046,560.000	
		2.625% Metropolitan Life Global Funding I 20221205	1,000,000.000	1,042,780.000	
		1.125% BNP Paribas SA 20220816	3,000,000.000	3,018,480.000	
		0.875% Dexia Credit Local SA 20210907	1,200,000.000	1,200,516.000	
		2.25% Total Capital International SA 20201217	1,500,000.000	1,517,280.000	
		4.625% RABOBANK NEDERLAND 20210113	300,000.000	309,870.000	
		4% RABOBANK NEDERLAND 20220919	2,000,000.000	2,156,380.000	
	イギリス・ポンド　小計			イギリス・ポンド 12,803,466.000 (1,841,394,480)	
社債券　合計				1,841,394,480 [1,841,394,480]	
合計				4,398,202,350 [4,398,202,350]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
イギリス・ポンド	国債証券 特殊債券 社債券	6銘柄 3銘柄 8銘柄	100%	100%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
	金　額（円）	金　額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	55,845,596	47,148,175
コール・ローン	70,716,676	55,782,531
国債証券	40,133,207,749	38,200,252,168
特殊債券	7,732,050,399	8,342,282,724
社債券	2,724,033,470	2,084,338,975
派生商品評価勘定	10,033,569	37,301,767
未収利息	645,806,483	596,454,218
前払費用	55,534,040	48,215,534
差入委託証拠金	122,164,095	123,713,330
流動資産合計	51,549,392,077	49,535,489,422
資産合計	51,549,392,077	49,535,489,422
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	―	27,964,561
未払解約金	41,646,321	―
流動負債合計	41,646,321	27,964,561
負債合計	41,646,321	27,964,561
純資産の部		
元本等		
元本　※1	33,187,550,993	31,509,110,856
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,320,194,763	17,998,414,005
元本等合計	51,507,745,756	49,507,524,861
純資産合計	51,507,745,756	49,507,524,861
負債純資産合計	51,549,392,077	49,535,489,422

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1．※1　期首	2019年2月21日	2019年8月21日
期首元本額	35,071,783,037円	33,187,550,993円

期中追加設定元本額	168,598,216円	22,752,947円
期中一部解約元本額	2,052,830,260円	1,701,193,084円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ世界債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）	225,371,153円	236,356,341円
ダイワ世界債券ファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	34,356,932円	30,383,484円
ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）	4,971,393,938円	4,744,366,474円
ダイワ・グローバル債券ファンド（年2回決算型）	124,354,074円	119,270,490円
ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）	6,854,434円	7,326,199円
ダイワ・グローバル債券ファンド（毎月分配型）	27,825,220,462円	26,371,407,868円
計	33,187,550,993円	31,509,110,856円
2. 期末日における受益権の総数	33,187,550,993口	31,509,110,856口

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	2020年2月20日現在
1．金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年8月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年2月20日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	264,764,418	40,362,591
特殊債券	101,261,203	66,096,452
社債券	22,353,220	25,997,211
合計	388,378,841	132,456,254

（注）　「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（2019年7月6日から2019年8月20日まで、及び2020年1月7日から2020年2月20日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

	2019年8月20日 現在	2020年2月20日 現在

種　類	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	2,408,031,597	－	2,405,848,431	2,183,166	7,254,451,762	－	7,267,259,129	△12,807,367
スウェーデン･クローナ	2,408,031,597	－	2,405,848,431	2,183,166	4,818,823,762	－	4,833,659,129	△14,835,367
ノルウェー･クローネ	－	－	－	－	2,435,628,000	－	2,433,600,000	2,028,000
買　建	2,408,031,597	－	2,415,882,000	7,850,403	7,254,451,762	－	7,276,596,335	22,144,573
スウェーデン･クローナ	－	－	－	－	2,435,628,000	－	2,424,624,335	△11,003,665
ノルウェー･クローネ	2,408,031,597	－	2,415,882,000	7,850,403	4,818,823,762	－	4,851,972,000	33,148,238
合計	4,816,063,194	－	4,821,730,431	10,033,569	14,508,903,524	－	14,543,855,464	9,337,206

（注）　1．　時価の算定方法

(1)　期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②　期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・　期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

・　期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)　期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2．　換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．　契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年8月20日現在	2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5520円 (15,520円)	1.5712円 (15,712円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	通　貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	スウェーデン・クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	スウェーデン・クローナ 39,800,000.000	スウェーデン・クローナ 42,571,672.000	
	スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 42,571,672.000 (484,891,344)	
	デンマーク・クローネ	7% DANISH GOVERNMENT BOND 20241110	デンマーク・クローネ 188,000,000.000	デンマーク・クローネ 256,727,160.000	
		1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	113,000,000.000	122,189,160.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	180,000,000.000	194,270,400.000	
		0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	12,000,000.000	13,070,760.000	
	デンマーク・クローネ　小計			デンマーク・クローネ 586,257,480.000 (9,438,745,428)	
	ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	ノルウェー・クローネ 4,000,000.000	ノルウェー・クローネ 4,118,360.000	
		2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	85,000,000.000	86,826,650.000	
		3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	90,000,000.000	95,935,500.000	

		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	25,000,000.000	25,507,250.000	
		1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	10,000,000.000	10,309,900.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 222,697,660.000 (2,674,598,897)	
	ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
		1.75% Poland Government Bond 20210725	71,000,000.000	71,346,480.000	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	150,000,000.000	156,909,000.000	
	ポーランド・ズロチ　小計			ポーランド・ズロチ 228,255,480.000 (6,432,239,426)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	11,000,000.000	11,990,110.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	2,500,000.000	3,251,675.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	9,000,000.000	9,992,610.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	30,000,000.000	38,881,200.000	
		3.9% IRISH TREASURY 20230320	2,000,000.000	2,273,360.000	
		3.4% IRISH TREASURY 20240318	10,000,000.000	11,588,000.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	26,000,000.000	29,253,120.000	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	12,000,000.000	12,225,240.000	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	35,000,000.000	39,907,700.000	
	ユーロ　小計			ユーロ 159,363,015.000 (19,169,777,073)	
国債証券　合計				38,200,252,168 [38,200,252,168]	
特殊債券	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		1% Kommuninvest I Sverige AB 20210915	7,200,000.000	7,311,960.000	

		1% Kommuninvest I Sverige AB 20241002	102,500,000.000	106,204,350.000	
		1.25% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20250512	200,000,000.000	210,594,000.000	
		1.75% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20261112	150,000,000.000	164,410,500.000	
	スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 488,520,810.000 (5,564,252,026)	
	ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
		1.625% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20240403	50,000,000.000	50,071,500.000	
		1.67% KFW-KREDIT WIEDERAUFBAU 20230524	30,000,000.000	30,054,300.000	
		2% KOMMUNALBANKEN 20271129	100,000,000.000	101,093,000.000	
		1.5% EUROPEAN INVESTMENT BANK 20220512	50,000,000.000	50,091,000.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 231,309,800.000 (2,778,030,698)	
特殊債券　合計				8,342,282,724 [8,342,282,724]	
社債券	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		2% Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 20260617	100,000,000.000	109,082,000.000	
	スウェーデン・クローナ　小計			スウェーデン・クローナ 109,082,000.000 (1,242,443,980)	
	ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
		1.75% Cooperatieve Rabobank UA 20240710	50,000,000.000	50,171,500.000	
		1.99% Nordea Bank Abp 20230814	20,000,000.000	19,928,000.000	
	ノルウェー・クローネ　小計			ノルウェー・クローネ 70,099,500.000 (841,894,995)	
社債券　合計				2,084,338,975 [2,084,338,975]	

合計		48,626,873,867 [48,626,873,867]	

（注）1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。
2．合計欄における［　］内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄 特殊債券 4銘柄 社債券 1銘柄	100%	15.0%
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	100%	19.4%
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄 特殊債券 4銘柄 社債券 2銘柄	100%	12.9%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	13.2%
ユーロ	国債証券 9銘柄	100%	39.5%

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期計算期間（2019年8月21日から2020年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第22期 2019年8月20日現在	第23期 2020年2月20日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	500,890	507,158
親投資信託受益証券	38,442,861	41,973,427
流動資産合計	38,943,751	42,480,585
資産合計	38,943,751	42,480,585
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,801	32,342
未払受託者報酬	11,433	10,996
未払委託者報酬	275,584	264,730
その他未払費用	1,620	1,543
流動負債合計	319,438	309,611
負債合計	319,438	309,611
純資産の部		
元本等		
元本	※1 30,801,883	※1 32,342,841
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,822,430	9,828,133
（分配準備積立金）	4,501,517	4,909,856
元本等合計	38,624,313	42,170,974
純資産合計	38,624,313	42,170,974
負債純資産合計	38,943,751	42,480,585

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第22期 自　2019年2月21日 至　2019年8月20日	第23期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	△ 1,170,022	1,869,542
営業収益合計	△ 1,170,022	1,869,542
営業費用		
支払利息	5	－
受託者報酬	11,433	10,996
委託者報酬	275,584	264,730
その他費用	1,620	1,543
営業費用合計	288,642	277,269
営業利益又は営業損失（△）	△ 1,458,664	1,592,273
経常利益又は経常損失（△）	△ 1,458,664	1,592,273
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 1,458,664	1,592,273
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 25,191	4,003
期首剰余金又は期首欠損金（△）	10,943,480	7,822,430
剰余金増加額又は欠損金減少額	208,482	518,756
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	208,482	518,756
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,865,258	68,981
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,865,258	68,981
分配金	※1 30,801	※1 32,342
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,822,430	9,828,133

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第23期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	第22期 2019年8月20日現在	第23期 2020年2月20日現在
1.　※1　期首元本額	36,260,781円	30,801,883円
期中追加設定元本額	722,502円	1,812,584円
期中一部解約元本額	6,181,400円	271,626円
2.　計算期間末日における受益権の総数	30,801,883口	32,342,841口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第22期 自　2019年2月21日 至　2019年8月20日	第23期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日

※1　　分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（302,439円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（11,750,012円）及び分配準備積立金（4,229,879円）より分配対象額は16,282,330円（1万口当たり5,286.15円）であり、うち30,801円（1万口当たり10円）を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（480,347円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,604,943円）及び分配準備積立金（4,461,851円）より分配対象額は17,547,141円（1万口当たり5,425.36円）であり、うち32,342円（1万口当たり10円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第23期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
1.　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2.　金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3.　金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第23期 2020年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第22期 2019年8月20日現在	第23期 2020年2月20日現在
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△1,180,242	1,861,273
合計	△1,180,242	1,861,273

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第22期 2019年8月20日現在	第23期 2020年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第23期 自　2019年8月21日 至　2020年2月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第22期 2019年8月20日現在	第23期 2020年2月20日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2540円 (12,540円)	1.3039円 (13,039円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ高格付米ドル債マザーファンド	4,274,381	7,126,675	
	ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド	1,324,561	2,315,597	
	ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド	2,549,400	6,932,073	
	ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド	3,898,667	7,115,457	
	ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド	7,326,199	11,510,923	
	ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド	5,860,891	6,972,702	
親投資信託受益証券　合計			41,973,427	
合計			41,973,427	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド」受益証券、「ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド」受益証券及び「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ高格付米ドル債マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド」の状況

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」に記載のとおりであります。

２　【ファンドの現況】

ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）

【純資産額計算書】

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	26,568,812,184円
Ⅱ	負債総額	35,205,838円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,533,606,346円
Ⅳ	発行済数量	42,787,329,927口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.6201円

(参考) ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	21,451,405,669円
Ⅱ	負債総額	70,183,401円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,381,222,268円
Ⅳ	発行済数量	12,907,191,970口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6565円

(参考) ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	147,751,895,190円
Ⅱ	負債総額	792,827,049円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,959,068,141円
Ⅳ	発行済数量	82,552,014,579口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7802円

(参考) ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	10,103,284,467円
Ⅱ	負債総額	3,392,057円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,099,892,410円
Ⅳ	発行済数量	3,811,302,308口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6500円

(参考) ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	1,587,828,951円
Ⅱ	負債総額	4,817,342円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,583,011,609円
Ⅳ	発行済数量	903,788,085口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7515円

(参考) ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	4,642,784,335円
Ⅱ	負債総額	1,409,481円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,641,374,854円
Ⅳ	発行済数量	3,954,171,637口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1738円

(参考) ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	49,441,487,642円
Ⅱ	負債総額	97,202,416円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	49,344,285,226円
Ⅳ	発行済数量	31,469,895,366口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5680円

ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）

純資産額計算書

2020年2月28日

Ⅰ	資産総額	41,688,410円
Ⅱ	負債総額	12,756円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	41,675,654円
Ⅳ	発行済数量	32,363,596口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2877円

(参考）ダイワ高格付米ドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

(参考）ダイワ高格付カナダドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

(参考）ダイワ高格付豪ドル債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

(参考）ダイワ高格付ユーロ債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ高格付英ポンド債マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・ヨーロッパ債券マザーファンド

前記「ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）」の記載と同じ。

第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簡の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第二部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

2020年2月末日現在

資本金の額　　151億7,427万2,500円

発行可能株式総数　799万9,980株

発行済株式総数　　260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ハ．運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ニ．運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2　【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2020年2月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	61	108,088
追加型株式投資信託	695	15,402,833
株式投資信託　　合計	756	15,510,921
単位型公社債投資信託	31	107,612
追加型公社債投資信託	14	1,458,225
公社債投資信託　合計	45	1,565,837
総合計	801	17,076,758

３　【委託会社等の経理状況】

１．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第２条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

　また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年８月６日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

２．当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第60期事業年度（2018年４月１日から2019年３月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

　また、第61期事業年度に係る中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

３．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1)　【貸借対照表】

（単位:百万円）

		前事業年度 （2018年３月31日）		当事業年度 （2019年３月31日）
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,709		28,489
有価証券		0		554
前払費用		201		214
未収委託者報酬		12,368		11,468
未収収益		82		98
その他		47		56
流動資産計		41,410		40,882
固定資産				
有形固定資産	※1	213	※1	206
建物		12		10
器具備品		200		195
無形固定資産		2,614		2,821
ソフトウェア		2,456		2,804
ソフトウェア仮勘定		158		17
投資その他の資産		15,066		12,799

投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

（単位:百万円）

	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	※2 4,476	※2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145

賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374
役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

（単位:百万円）

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	△106	△15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△11,532	△11,532	△11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△47	△47	△47
当期変動額合計	△47	△47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,669	△12,669	△12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△798	△798	△798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	４～20年

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員･参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（会計方針の変更）

（税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用）

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年２月16日）を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

（未適用の会計基準等）

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年３月30日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年３月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。
ステップ２：契約における履行義務を識別する。
ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年２月16日）等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
建物	29百万円	31百万円
器具備品	235百万円	264百万円

※２　関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
未払金	4,406百万円	3,788百万円

３　保証債務

前事業年度（2018年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2017年６月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 ３月31日	2017年 ６月27日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2018年６月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　12,669百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,857円
④ 基準日　2018年３月31日
⑤ 効力発生日　2018年６月26日

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年６月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 ３月31日	2018年 ６月26日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年６月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　11,868百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,550円
④ 基準日　2019年３月31日
⑤ 効力発生日　2019年６月24日

（金融商品関係）

１．金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（２）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）参照のこと）。

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,709	28,709	―
（２）未収委託者報酬	12,368	12,368	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,631	7,631	―
資産計	48,709	48,709	―
（１）未払手数料	(5,202)	(5,202)	―
（２）その他未払金	(4,476)	(4,476)	―
（３）未払費用（*2）	(3,286)	(3,286)	―
負債計	(12,965)	(12,965)	―

（*1）負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
（*2）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,489	28,489	―
（２）未収委託者報酬	11,468	11,468	―
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,380	8,380	―
資産計	48,338	48,338	―
（１）未払手数料	(4,610)	(4,610)	―
（２）その他未払金	(3,882)	(3,882)	―
（３）未払費用（*2）	(2,805)	(2,805)	―
負債計	(11,298)	(11,298)	―

（*1）負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
（*2）未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（３）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
（１）その他有価証券		
非上場株式	970	666
（２）子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	5,129	1,836
（３）長期差入保証金	1,072	1,070

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2018年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

（有価証券関係）

１．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（2018年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（2019年３月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額　1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

前事業年度（2018年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	134	55	79
（２）その他			

証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,299	3,522	△223
小計	3,299	3,522	△223
合計	7,631	7,318	312

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　970百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2019年３月31日）

	貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	87	55	32
（２）その他			
証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	売却額（百万円）	売却益の合計額（百万円）	売却損の合計額（百万円）
（１）株式	389	86	-
（２）その他			
証券投資信託	3,517	128	40

合計	3,907	215	40

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

２．確定給付制度

（１）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	△166	△171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

（２）退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,350	2,389

（３）退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2018年３月31日）	当事業年度 （2019年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	719	731
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	△200	△164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△159
その他有価証券評価差額金	△164	△85
繰延税金負債合計	△323	△244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2018年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2019年３月31日）
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］
当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］
１.サービスごとの情報
単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２.地域ごとの情報
（１）営業収益
内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産
本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３.主要な顧客ごとの情報
営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）
該当事項はありません。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]
該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注）	1,701	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証（注１）	1,719	－	－
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資（注２）	3,293	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(注２) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）		当事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）	
１株当たり純資産額	15,760.66円	１株当たり純資産額	15,389.06円
１株当たり当期純利益	4,857.40円	１株当たり当期純利益	4,550.81円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注２）「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の１株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

（注３）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）	当事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
当期純利益（百万円）	12,670	11,870
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

（１）中間貸借対照表

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2019年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金		19,529
有価証券		724
未収委託者報酬		11,175
その他		383
流動資産合計		31,812
固定資産		
有形固定資産	※１	211
無形固定資産		
ソフトウエア		2,380
その他		403
無形固定資産合計		2,784
投資その他の資産		
投資有価証券		7,928
関係会社株式		2,664
繰延税金資産		1,205
その他		1,280
投資その他の資産合計		13,078
固定資産合計		16,073
資産合計		47,886

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （2019年９月30日）
負債の部		
流動負債		
未払金		6,021
未払費用		3,486
未払法人税等		754
賞与引当金		506
その他	※２	474
流動負債合計		11,243
固定負債		
退職給付引当金		2,483
役員退職慰労引当金		128
その他		7
固定負債合計		2,619
負債合計		13,862
純資産の部		
株主資本		
資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495
利益剰余金		
利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		6,968
利益剰余金合計		7,343
株主資本合計		34,013
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		10
評価・換算差額等合計		10
純資産合計		34,023
負債・純資産合計		47,886

（２）中間損益計算書

（単位:百万円）

		当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		35,076
その他営業収益		309
営業収益合計		35,385
営業費用		
支払手数料		15,895
その他営業費用		6,272
営業費用合計		22,167
一般管理費	※１	5,954
営業利益		7,263
営業外収益	※２	968
営業外費用	※３	148
経常利益		8,083
特別利益		―
特別損失		―
税引前中間純利益		8,083
法人税、住民税及び事業税		2,313
法人税等調整額		△15
中間純利益		5,785

(３)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当中間期変動額						

剰余金の配当	-	-	-	△11,868	△11,868	△11,868
中間純利益	-	-	-	5,785	5,785	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△6,083	△6,083	△6,083
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,968	7,343	34,013

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
中間純利益	-	-	5,785
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△35	△35	△35
当中間期変動額合計	△35	△35	△6,118
当中間期末残高	10	10	34,023

注記事項
（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法
（１）子会社及び関連会社株式
移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券
時価のあるもの
中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの
移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　　10～18年

器具備品　　４～20年

（２）無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

（２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（中間貸借対照表関係）

※１　減価償却累計額

	当中間会計期間 （2019年９月30日現在）
有形固定資産	310百万円

※２　消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

３　保証債務

当中間会計期間（2019年９月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,639百万円に対して保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

※１　減価償却実施額

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
有形固定資産	14百万円
無形固定資産	472百万円

※２　営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
受取配当金	901百万円

※３　営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 （自　2019年４月　１日 至　2019年９月30日）
有価証券償還損	71百万円
為替差損	68百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項　（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 （百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

2019年６月21日 定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年３月31日	2019年６月24日

（金融商品関係）
当中間会計期間（2019年９月30日）

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（(注２)参照のこと）。

（単位：百万円）

	中間貸借対照表計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	19,529	19,529	－
（２）未収委託者報酬	11,175	11,175	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	7,986	7,986	－
資産合計	38,691	38,691	－
（１）未払金	(5,965)	(5,965)	－
（２）未払費用(*2)	(2,867)	(2,867)	－
負債合計	(8,833)	(8,833)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産
（１）現金・預金及び（２）未収委託者報酬
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（３）有価証券及び投資有価証券
これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負　債
（１）未払金及び（２）未払費用
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	666
子会社株式	1,836
関連会社株式	827
差入保証金	1,068

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（有価証券関係）

当中間会計期間（2019年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額　1,836百万円）及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　827百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

２．その他有価証券

	中間貸借対照表計上額（百万円）	取得原価（百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	66	55	11
（２）その他			
証券投資信託	3,971	3,628	343
小計	4,038	3,683	354
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	3,947	4,292	△344
小計	3,947	4,292	△344
合計	7,986	7,975	10

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

１.サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３.主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

［報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

［報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報］

当中間会計期間（自　2019年４月１日　至　2019年９月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）	
１株当たり純資産額	13,043.35円
１株当たり中間純利益	2,217.93円

（注１）　潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注２）　１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 （自　2019年４月１日 至　2019年９月30日）	
中間純利益(百万円)	5,785
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,785
普通株主に帰属しない金額(百万円)	―
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4　【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

①　自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

②　運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③　通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④　委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤　上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5　【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

① 2020年2月17日付で、Daiwa Capital Management Silicon Valley Inc.への出資を行い、当該会社を子会社といたしました。

② 2020年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

ｂ．訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

第２　【その他の関係法人の概況】

１　【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

①　名称　三井住友信託銀行株式会社

②　資本金の額　342,037百万円（2019年3月末日現在）

③　事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

① 名　称	② 資本金の額 単位：百万円 （2019年3月末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注）

（注）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２　【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３　【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

＊再信託受託会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および資産管理サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

第３　【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2019年9月3日	臨時報告書
2019年11月13日	有価証券届出書、有価証券報告書
2019年12月4日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2019年５月24日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年3月27日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）の2019年8月21日から2020年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ世界債券ファンド（毎月分配型）の2020年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年3月27日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林　英之　　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）の2019年8月21日から2020年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ダイワ世界債券ファンド（年2回決算型）の2020年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注) １．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) ２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月22日

大和証券投資信託委託株式会社
　取締役会　御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井　康治　印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の2019年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年４月１日から2019年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

(注)１．　上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。