

【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】	2021年11月30日提出
【計算期間】	第12計算期間 (自 2021年3月9日 至 2021年9月7日)
【ファンド名】	ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり) ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)
【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、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

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。

商品分類表

〈ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）〉

〈ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）〉

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 〈ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）〉

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	年1回	グローバル (含む日本)		
一般 大型株 中小型株	年2回	日本		
債券	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (フルヘッジ)
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア		
その他資産 (投資信託証券) (債券 一般)	日々	オセアニア	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ()	その他 ()	中南米		
資産配分固定型 資産配分変更型		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〈ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）〉

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 (含む日本)		
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		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ()
	年6回 (隔月)	欧州		
	年6回 (隔月)	アジア		
	年12回 (毎月)	オセアニア		
不動産投信 その他資産 (投資信託証券) (債券 一般)	年12回 (毎月)	中南米		
資産複合 ()	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産配分固定型 資産配分変更型	その他 ()	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

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行なわれないファンド
	追加型	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
投資対象地域	国内	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国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	海外	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海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	内外	目論見書等において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
投資対象資産	株式	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株式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
	不動産投信（リート）	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不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるもの
	その他資産	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株式、債券、不動産投信（リート）以外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	資産複合	目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMF
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRF
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託
補足分類	インデックス型	目論見書等において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	特殊型	目論見書等において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのもの
		大型株	目論見書等において、主として大型株に投資する旨の記載があるもの
		中小型株	目論見書等において、主として中小型株に投資する旨の記載があるもの
	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
		公債	目論見書等において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。）に主として投資する旨の記載があるもの
		社債	目論見書等において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるもの
		その他債券	目論見書等において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるもの
		格付等クレジットによる属性	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
	不動産投信	目論見書等において、主として不動産投信（リート）に投資する旨の記載があるもの	
	その他資産	目論見書等において、主として株式、債券、不動産投信（リート）以外に投資する旨の記載があるもの	
	資産複合	目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分固定型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの	
	資産複合 資産配分変更型	目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないもの	
	決算頻度	年1回	目論見書等において、年1回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	
年4回		目論見書等において、年4回決算する旨の記載があるもの	
年6回（隔月）		目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの	
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	
日々		目論見書等において、日々決算する旨の記載があるもの	
その他		上記属性にあてはまらないすべてのもの	

投資対象地域	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
	日本	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	北米	目論見書等において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	欧州	目論見書等において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アジア	目論見書等において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	オセアニア	目論見書等において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中南米	目論見書等において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	アフリカ	目論見書等において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	中近東(中東)	目論見書等において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるもの
	エマージング	目論見書等において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるもの
投資形態	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
	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
為替ヘッジ	あり	目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの
	なし	目論見書等において、為替のヘッジを行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
対象インデックス	日経225	目論見書等において、日経225に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	TOPIX	目論見書等において、TOPIXに連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
	その他の指数	目論見書等において、上記以外の指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるもの
特殊型	ブル・ベア型	目論見書等において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行なうとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動(一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。)をめざす旨の記載があるもの
	条件付運用型	目論見書等において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるもの
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書等において、ロング・ショート戦略により収益の追求をめざす旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求をめざす旨の記載があるもの
	その他型	目論見書等において、特殊型のうち上記に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるもの

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、各ファンドについて1兆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 米ドル建ての複数種別の債券等に投資します。

※米ドル以外の通貨建資産に投資する場合があります。この場合、原則として実質的に米ドル建てとなるよう為替取引を行いません。

投資する債券等の例



- 資産担保証券：不動産ローンや自動車ローン等の債権を担保として発行された証券。
住宅ローンを担保としたRMBS、商業用不動産ローンを担保としたCMBS、自動車ローン・リース債権などを担保としたABSなどがあります。
- 優先証券：債券と株式の性質を併せ持ち、法的弁済順位が普通株式より優先される証券。
- バンクローン：銀行などの金融機関が、主に格付けが投資適格未満の事業会社等に対して行なう貸付の債権。

※劣後債、転換社債、債券ETFほか、上記以外にも投資する場合があります。

2 利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせにより、トータルリターンを最大化をめざします。



3 運用は、グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLCが行ないます。

〈グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLCについて〉

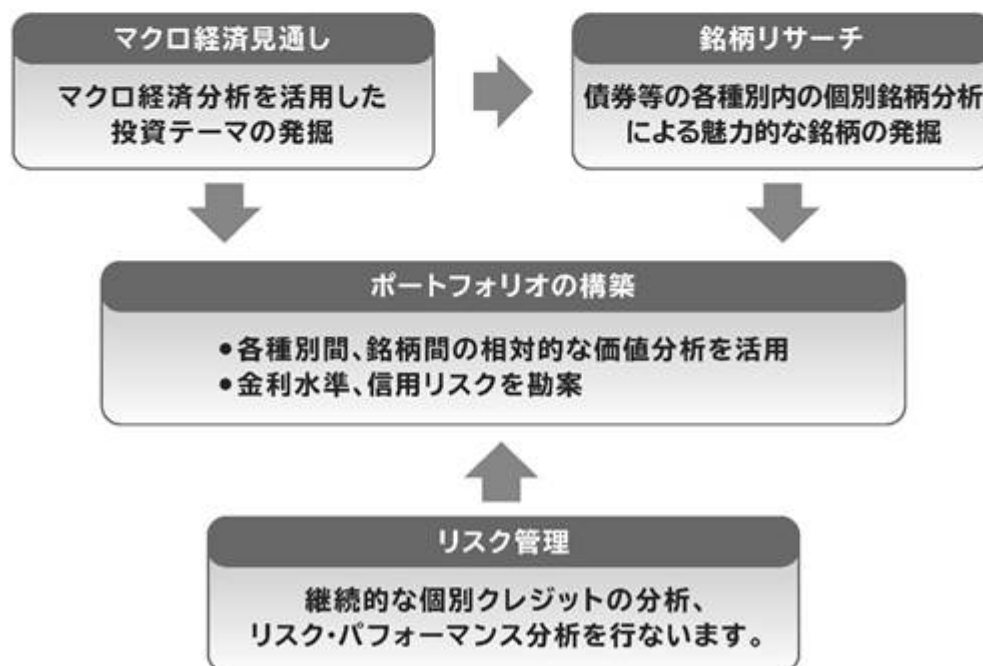
- グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLCは2,568億米ドル（約28.5兆円）の資産を運用する運用会社であり、米国サンタモニカを本拠地としています。
- 同社は、米国の金融グループであるグッゲンハイム・パートナーズの運用会社として設立されました。
- グッゲンハイム・パートナーズは、世界6カ国において各種金融サービスを提供し、運用業務、証券業務、保険関連業務を行なう会社を有します。

（2021年6月末現在）

●運用にあたっては、以下の点に留意します。

- マクロ経済分析を活用した投資テーマの発掘および債券等の各種別内の個別銘柄分析による魅力的な銘柄の発掘につとめます。
- 各種別間、銘柄間の相対的な価値の分析を活用し、投資対象の評価を行なうことでポートフォリオを構築します。
- 投資対象の徹底的な分析を重視することで、特定インデックスの債券等の種別や銘柄にとらわれない運用を行ないます。

運用プロセス



4

「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」の2つのファンドがあります。

為替ヘッジあり

- 為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。
※ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。
※為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

為替ヘッジなし

- 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
※基準価額は、為替変動の影響を直接受けます。

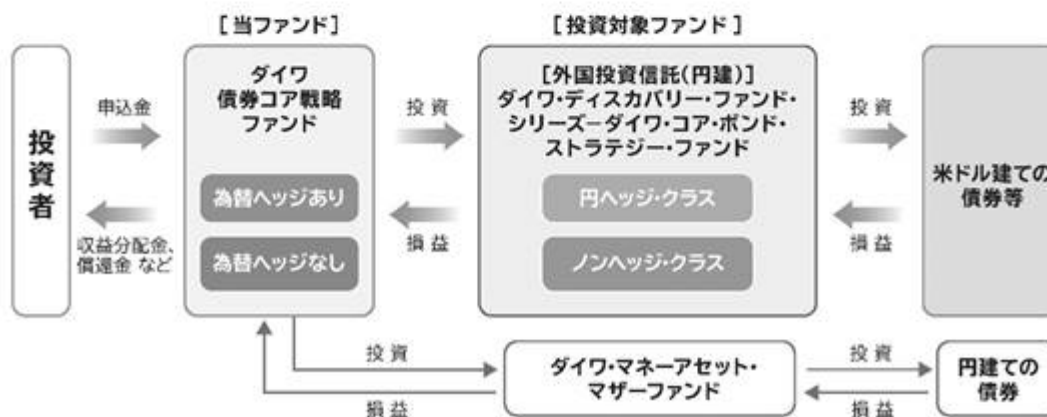
スイッチング(乗換え)について

◆「為替ヘッジあり」と「為替ヘッジなし」との間でスイッチング(乗換え)を行なうことができます。



ファンドの仕組み

- ◆ 当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- ◆ 外国投資信託の受益証券を通じて、米ドル建ての債券等に投資します。



※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

- 当ファンドは、通常の状態では、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。

- 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1～4の運用が行なわれないことがあります。

5 毎年3月7日および9月7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〉

- 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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益(評価益を含みます。)等を中心に分配する場合があります。なお、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。

<投資対象ファンドの概要>

1. ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド (円ヘッジ・クラス)
2. ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド (ノンヘッジ・クラス)

形態 / 表示通貨	ケイマン籍の外国投資信託 / 円建
運用の基本方針	米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、トータルリターンの最大化をめざします。
主要投資対象	米ドル建ての複数種別の債券等(国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等)

運用方針	<p>1. 主として米ドル建ての複数種別の債券等に投資し、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。</p> <p>2. 運用にあたっては、以下の点に留意します。</p> <p>(a) マクロ経済分析を活用した投資テーマの発掘および債券等の各種別内の個別銘柄分析による魅力的な銘柄の発掘につとめます。</p> <p>(b) 各種別間、銘柄間の相対的な価値の分析を活用し、投資対象の評価を行なうことでポートフォリオを構築します。</p> <p>(c) 投資対象の徹底的な分析を重視することで、特定インデックスの債券等の種別や銘柄にとらわれない運用を行ないます。</p> <p>米ドル以外の通貨建資産に投資する場合があります。この場合、原則として実質的に米ドル建てとなるよう為替取引を行ないます。</p> <p>3. (円ヘッジ・クラス) 為替変動リスクを低減するため、対円で為替ヘッジを行ないます。 (ノンヘッジ・クラス) 為替変動リスクを回避するための対円での為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>4. 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。</p>
設定日	2015年9月9日
決算日	9月30日
申込手数料	かかりません。
管理報酬等	<p>(円ヘッジ・クラス) 純資産総額に対して年率0.645%程度 (ノンヘッジ・クラス) 純資産総額に対して年率0.615%程度</p> <p>ただし、この他に「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額10,000米ドルがかかります。また、監査費用、弁護士費用、有価証券売買委託手数料等、ファンドの運営に必要な各種経費がかかります。</p>
運用会社	グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLC

3. ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

形態 / 表示通貨	国内籍の証券投資信託 / 円建
運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券

投資態度	<p>円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。</p> <p>円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。</p> <p>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。</p>
設定日	2012年3月22日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用 （信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和アセットマネジメント株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

(2) 【ファンドの沿革】

2015年9月8日

信託契約締結、当初設定、運用開始

2019年12月3日

信託期間終了日を2025年9月5日に変更（当初は2020年9月4日）

(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	<p>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。</p> <p>受益権の募集の取扱い</p> <p>一部解約請求に関する事務</p> <p>収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務</p> <p>など</p>
------	---

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、次の業務を行いません。 受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 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	みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社： 株式会社日本カストディ銀行	信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行いません。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行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。 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 など
損益 投資		
投資対象	投資対象ファンドの受益証券 など	

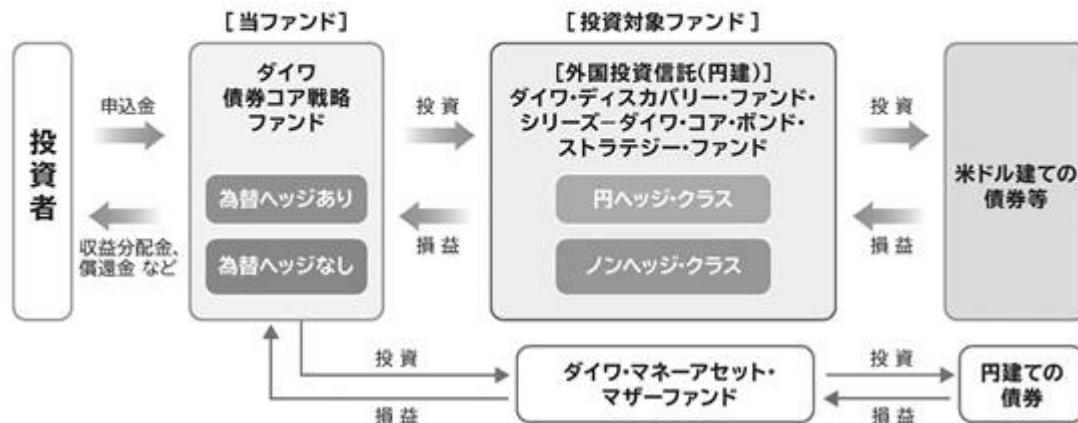
(注)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 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收受します。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。

ファンドの仕組み

- ◆当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- ◆外国投資信託の受益証券を通じて、米ドル建ての債券等に投資します。



< 委託会社の概況（2021年9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 大和証券投資信託委託株式会社として設立
- 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)
- 2020年 4月 1日 大和アセットマネジメント株式会社に商号変更

・大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
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	株 2,608,525	% 100.00

2【投資方針】

(1)【投資方針】

< 為替ヘッジあり >

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）」（以下「コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

投資態度

- イ. 主として、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。
- ロ. 当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ハ. コア・ボンド・ファンド（円ヘッジ・クラス）では、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いません。
- ニ. 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。

<為替ヘッジなし>

主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」（以下「コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

投資態度

- イ. 主として、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）の受益証券を通じて、米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざします。
- ロ. 当ファンドは、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ハ. コア・ボンド・ファンド（ノンヘッジ・クラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ. 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。

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

1. 為替ヘッジあり

投資先ファンドの名称	ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）
選定の方針	米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざして運用を行なうファンドである。為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行なう。

2. 為替ヘッジなし

投資先ファンドの名称	ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）
選定の方針	米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、利子収入と値上がり益の適切と考えられる組み合わせによりトータルリターンの最大化をめざして運用を行なうファンドである。為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行なわない。

くわしくは「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>」をご参照下さい。

(2)【投資対象】

<為替ヘッジあり>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）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．約束手形

ハ．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

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5. までに掲げる有価証券（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. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）」の受益証券（円建）

3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 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。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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

<為替ヘッジなし>

（<為替ヘッジあり>と同規定）

委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3. から5.までに掲げる有価証券（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. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 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。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

（<為替ヘッジあり>と同規定）

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

1. 為替ヘッジあり

投資先ファンドの名称	ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（円ヘッジ・クラス）
運用の基本方針	米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、トータルリターンの最大化をめざします。
主要な投資対象	米ドル建ての複数種別の債券等（国債、政府機関債、地方債、投資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、バンクローン、MBS、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等）

委託会社等の名称	運用会社： グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメン トLLC
----------	--

2. 為替ヘッジなし

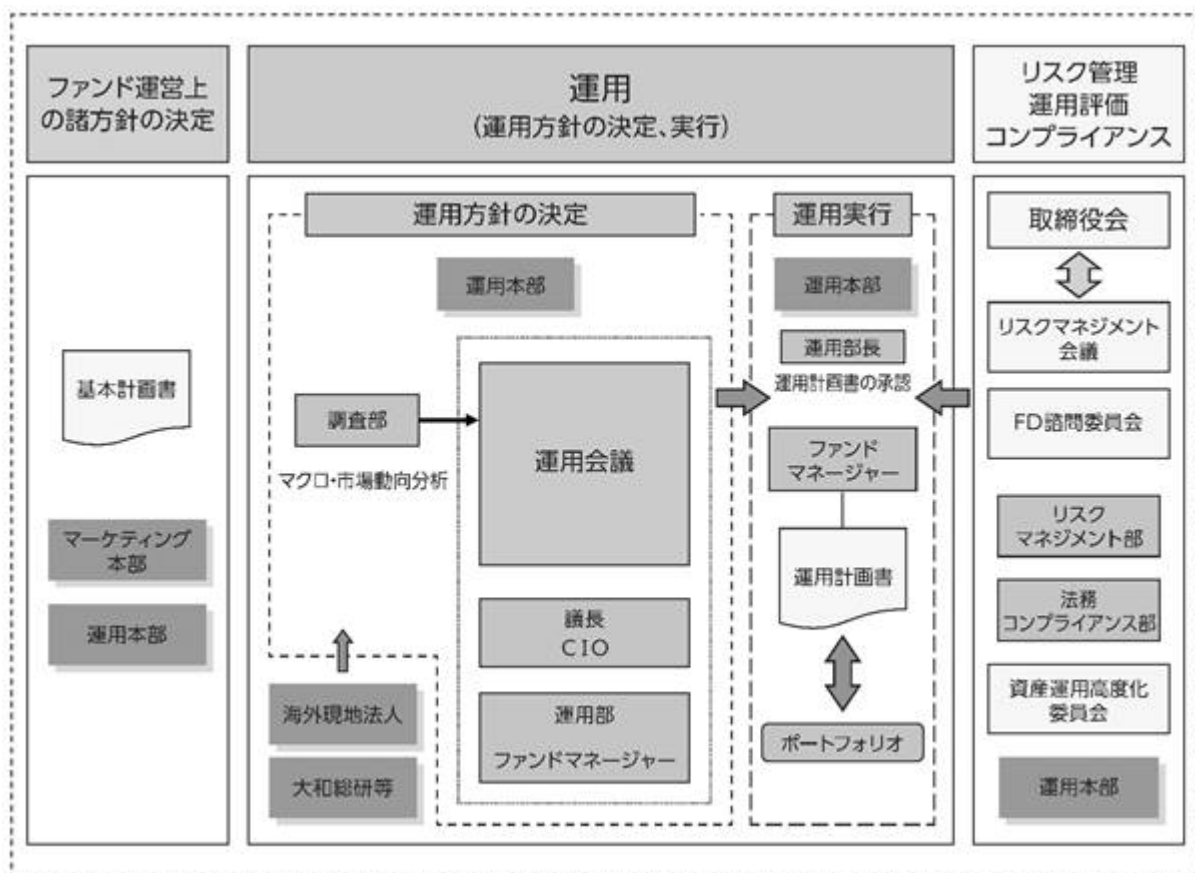
投資先ファンドの名称	ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）
運用の基本方針	米ドル建ての複数種別の債券等に投資することで、トータルリ ターンの最大化をめざします。
主要な投資対象	米ドル建ての複数種別の債券等（国債、政府機関債、地方債、投 資適格社債、ハイ・イールド社債、新興国債券、資産担保証券、 バンクローン、MBS、優先証券、劣後債、転換社債、債券ETF等）
委託会社等の名称	運用会社： グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメン トLLC

くわしくは「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>」を
ご参照下さい。

(3) 【運用体制】

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。



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商品担当役員の決裁により決定します。

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。

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）（3名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・基本的な運用方針の決定
- ・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決定します。

ホ．運用チームリーダー

ファンドの基本的な運用方針を策定します。

ヘ．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。

リスクマネジメント会議、FD諮問委員会および資産運用高度化委員会

次のとおり各会議体等において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体等の事務局となる部署の人員は40～50名程度です。

イ．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。

ロ．FD諮問委員会

取締役会の諮問委員会として、ファンド組成・運用に関わる会議体等に対する牽制に資する事項について、取締役会に意見を述べます。

ハ．資産運用高度化委員会

資産運用高度化への取組みについて報告・検討し、必要事項を審議・決定します。

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2021年9月30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】

<各ファンド共通>

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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益(評価益を含みます。)等を中心に分配する場合があります。なお、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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>

株式(信託約款)

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券(信託約款)

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

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がたい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

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> 投資対象ファンドについて

1. ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド
(円ヘッジ・クラス)
2. ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド
(ノンヘッジ・クラス)

「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>」をご参照下さい。

3. ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

下記以外の項目(「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用(信託報酬)」等)については、「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>」をご参照下さい。

<p>主な投資制限</p>	<p>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せん。)の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)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。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
<p>償還条項</p>	<p>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。</p>

3【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、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、よろしくごお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

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。

ハイ・イールド社債は、投資適格社債に比べ、一般に債務不履行が生じるリスクが高いと考えられます。また、投資適格社債に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向があります。

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。

その他の価格変動

- ・資産担保証券の価格は、一般に金利が上昇した場合に下落します。また、担保となるローンは、一般に金利が低下すると借り換えが増加し、ローンの期限前償還が増加することにより、資産担保証券の価格は影響を受けます。
- ・優先証券は、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、優先証券の価格が大きく下落する可能性があります。
- ・バンクローンの価格は、債務者である事業会社等の信用状況により変動します。特に、債務者が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合に価格が下落します。また、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより、価格の変動性が大きくなる傾向があります。

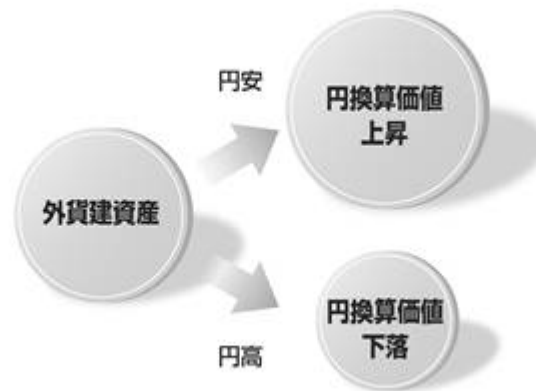
その他の価格変動は、上記に限定されるものではありません。

組入資産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。

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。

「為替ヘッジあり」においては、為替変動リスクの低減のために、為替ヘッジを行ないます。ただし、影響をすべて排除できるわけではありません。また、為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が組入資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

「為替ヘッジなし」においては、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。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。

米ドル以外の通貨建資産については、原則として実質的に米ドル建てとなるよう為替取引を行ないませんが、影響をすべて排除できるわけではありません。

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。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる面がある場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

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。

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(投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等)による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等)が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

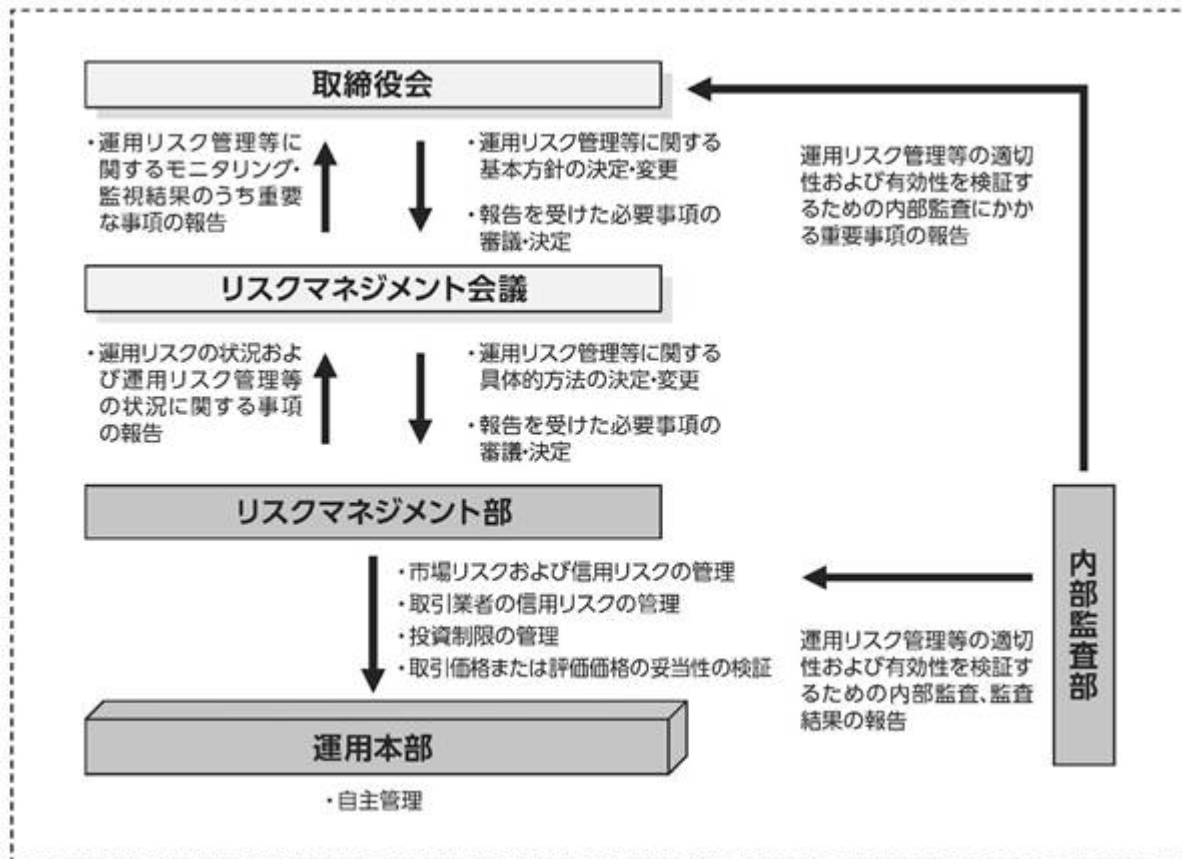
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(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

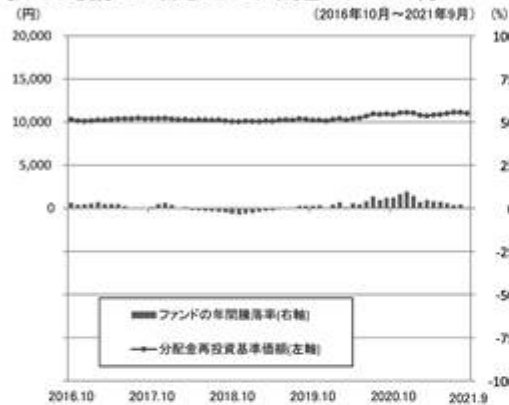
当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

参考情報

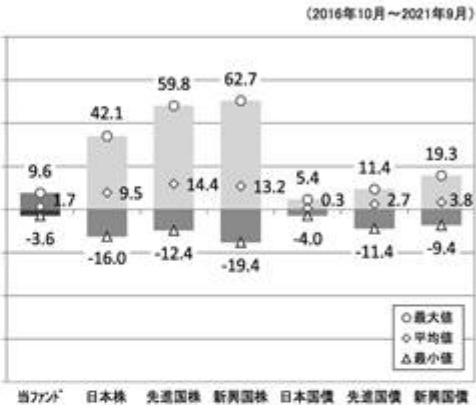
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

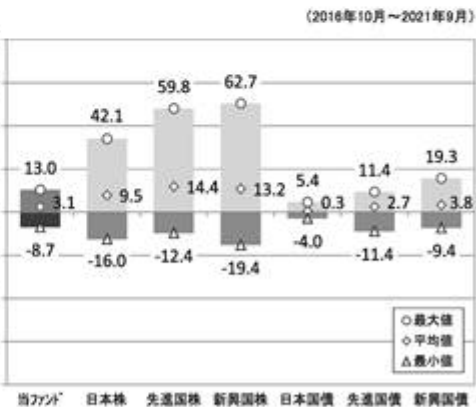
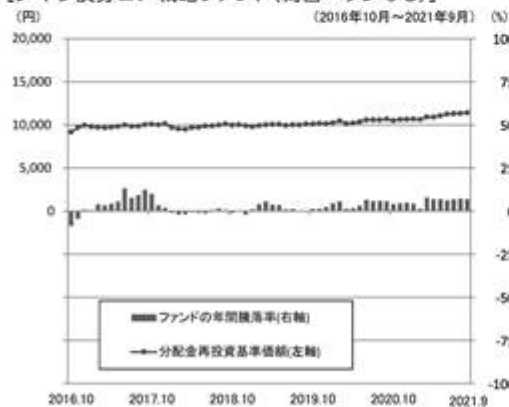
[ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)]



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



[ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)]



※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・インデックスー エマージング・マーケット 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、知的財産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・インデックスー エマージング・マーケット 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】

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、3.3%（税抜3.0%）となっています。
 具体的な手数料の料率等については、販売会社にお問合わせ下さい。
 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。
 「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。

<スイッチング（乗換え）について>

- ・「為替ヘッジあり」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「為替ヘッジなし」の受益権の取得申込みを行なうこと、および「為替ヘッジなし」の受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって「為替ヘッジあり」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。



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】

換金手数料
ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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1.2375%（税抜1.125%）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。

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。

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、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.75% （税抜）	年率0.025% （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。

前 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。

当ファンドの信託報酬等のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬等がかかります。当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬等を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、「為替ヘッジあり」については年率1.8825%（税込）程度、「為替ヘッジなし」については年率1.8525%（税込）程度です。（ただし、この他に「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額10,000米ドルがかかりますので、純資産総額によっては上回る場合があります。）

（注）投資対象ファンドの信託報酬等については、「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「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

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】

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。

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。

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。

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、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。

<投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各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。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

(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。

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。

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

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。

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。

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。

個別元本について、詳しくは販売会社にお問合わせ下さい。

<注2> 収益分配金の課税について

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。

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、2021年9月30日現在のもので、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】

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）】

(1)【投資状況】（2021年9月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	2,530,292,463	98.87
内 ケイマン諸島	2,530,292,463	98.87
親投資信託受益証券	997	0.00
内 日本	997	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	28,842,652	1.13
純資産総額	2,559,136,112	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】（2021年9月30日現在）

【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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	23,969,501.27	106.65 2,556,371,280	105.56 2,530,292,463	98.87
2	ダイワ・マネーアセット・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	999	0.9984 997	0.9983 997	0.00

(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
投資信託受益証券	98.87%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.87%

(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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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1計算期間末 (2016年3月7日)	3,500,167,507	3,546,688,689	0.9781	0.9911
第2計算期間末 (2016年9月7日)	5,866,743,939	5,935,914,686	1.0178	1.0298
第3計算期間末 (2017年3月7日)	8,784,842,995	8,865,051,860	0.9857	0.9947
第4計算期間末 (2017年9月7日)	10,571,131,113	10,666,039,675	1.0024	1.0114
第5計算期間末 (2018年3月7日)	9,624,794,282	9,654,221,264	0.9812	0.9842
第6計算期間末 (2018年9月7日)	8,146,984,731	8,176,287,148	0.9731	0.9766
第7計算期間末 (2019年3月7日)	6,149,764,285	6,149,764,285	0.9587	0.9587
第8計算期間末 (2019年9月9日)	5,304,963,281	5,304,963,281	0.9878	0.9878
第9計算期間末 (2020年3月9日)	4,544,655,659	4,544,655,659	1.0145	1.0145
第10計算期間末 (2020年9月7日)	3,222,667,329	3,233,549,229	1.0365	1.0400
2020年9月末日	3,171,035,821	-	1.0390	-
10月末日	3,082,542,169	-	1.0312	-
11月末日	3,078,824,440	-	1.0503	-
12月末日	3,129,252,208	-	1.0545	-

2021年1月末日	3,024,274,535	-	1.0499	-
2月末日	2,884,291,711	-	1.0251	-
第11計算期間末 (2021年3月8日)	2,823,820,856	2,834,914,751	1.0182	1.0222
3月末日	2,793,181,350	-	1.0126	-
4月末日	2,802,574,648	-	1.0233	-
5月末日	2,773,292,549	-	1.0277	-
6月末日	2,736,933,670	-	1.0395	-
7月末日	2,695,603,140	-	1.0516	-
8月末日	2,650,793,608	-	1.0519	-
第12計算期間末 (2021年9月7日)	2,609,396,666	2,633,201,429	1.0414	1.0509
9月末日	2,559,136,112	-	1.0300	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0130
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0090
第4計算期間	0.0090
第5計算期間	0.0030
第6計算期間	0.0035
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0035
第11計算期間	0.0040
第12計算期間	0.0095

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.9
第2計算期間	5.3
第3計算期間	2.3
第4計算期間	2.6
第5計算期間	1.8
第6計算期間	0.5
第7計算期間	1.5
第8計算期間	3.0

第9計算期間	2.7
第10計算期間	2.5
第11計算期間	1.4
第12計算期間	3.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,095,155,807	61,309,356
第2計算期間	2,489,519,247	303,842,776
第3計算期間	4,531,648,102	1,383,780,914
第4計算期間	4,195,914,706	2,562,614,980
第5計算期間	561,504,505	1,297,906,247
第6計算期間	60,371,859	1,497,246,649
第7計算期間	458,579,742	2,416,005,550
第8計算期間	305,025,227	1,349,271,633
第9計算期間	45,537,261	936,368,967
第10計算期間	8,976,733	1,379,477,821
第11計算期間	92,009,588	427,650,106
第12計算期間	82,289,486	349,998,689

(注) 当初設定数量は1,544,706,029口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

(1) 投資状況 (2021年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	693,483,591	100.00
純資産総額	693,483,591	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 (2021年9月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

該当事項はありません。

□．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

●ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)

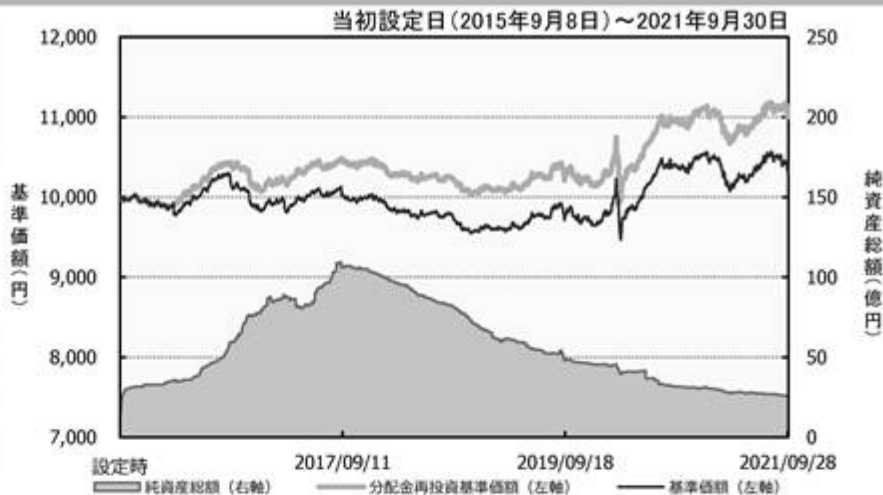
2021年9月30日現在

※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	10,300円
純資産総額	25億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.2%
3カ月間	-0.0%
6カ月間	2.6%
1年間	0.4%
3年間	8.2%
5年間	5.5%
設定来	10.0%



※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実質的な運用管理費用(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: 135円 設定来分配金合計額: 665円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期
	16年3月	16年9月	17年3月	17年9月	18年3月	18年9月	19年3月	19年9月	20年3月	20年9月	21年3月	21年9月
分配金	130円	120円	90円	90円	30円	35円	0円	0円	0円	35円	40円	95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。

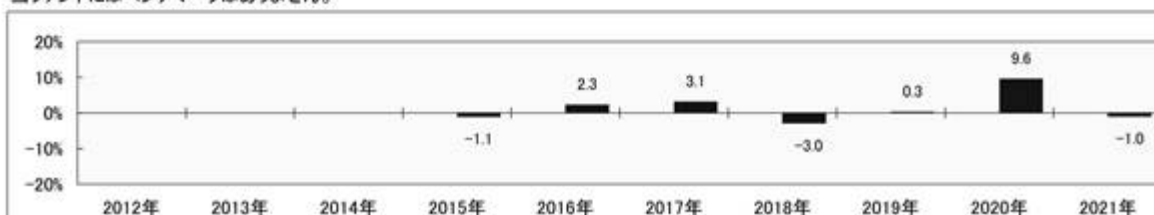
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ググンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLC	ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(円ヘッジ・クラス)	98.9%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.0%
合計		98.9%

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。
 ・2015年は設定日(9月8日)から年末、2021年は9月30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。

【ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)】

(1) 【投資状況】 (2021年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	548,572,028	98.56
内 ケイマン諸島	548,572,028	98.56
親投資信託受益証券	997	0.00
内 日本	997	0.00
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,000,584	1.44
純資産総額	556,573,609	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】 (2021年9月30日現在)

【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	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	5,350,408.45	101.43 542,713,331	102.52 548,572,028	98.56
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファ ンド	日本	親投資 信託受 益証券	999	0.9984 997	0.9983 997	0.00

(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
投資信託受益証券	98.56%
親投資信託受益証券	0.00%
合計	98.56%

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【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1計算期間末 (2016年3月7日)	1,939,979,861	1,967,243,188	0.9250	0.9380
第2計算期間末 (2016年9月7日)	1,937,466,409	1,959,639,026	0.8738	0.8838
第3計算期間末 (2017年3月7日)	1,589,593,221	1,609,748,474	0.9464	0.9584
第4計算期間末 (2017年9月7日)	2,086,211,440	2,104,179,193	0.9289	0.9369
第5計算期間末 (2018年3月7日)	1,606,121,685	1,619,654,750	0.8901	0.8976
第6計算期間末 (2018年9月7日)	1,193,518,792	1,210,932,211	0.9253	0.9388
第7計算期間末 (2019年3月7日)	958,553,934	966,846,845	0.9247	0.9327
第8計算期間末 (2019年9月9日)	834,243,105	838,774,304	0.9206	0.9256
第9計算期間末 (2020年3月9日)	687,878,300	693,008,558	0.9386	0.9456
第10計算期間末 (2020年9月7日)	581,350,373	587,668,058	0.9662	0.9767
2020年9月末日	576,839,245	-	0.9632	-
10月末日	557,912,497	-	0.9476	-
11月末日	560,795,956	-	0.9593	-
12月末日	537,004,326	-	0.9604	-
2021年1月末日	533,411,229	-	0.9631	-
2月末日	537,638,750	-	0.9585	-
第11計算期間末 (2021年3月8日)	541,318,715	544,113,480	0.9685	0.9735
3月末日	543,094,828	-	0.9818	-

4月末日	538,971,416	-	0.9800	-
5月末日	542,127,202	-	0.9941	-
6月末日	550,185,689	-	1.0104	-
7月末日	547,390,845	-	1.0144	-
8月末日	559,401,825	-	1.0176	-
第12計算期間末 (2021年9月7日)	550,155,381	555,631,931	1.0046	1.0146
9月末日	556,573,609	-	1.0145	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0130
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0120
第4計算期間	0.0080
第5計算期間	0.0075
第6計算期間	0.0135
第7計算期間	0.0080
第8計算期間	0.0050
第9計算期間	0.0070
第10計算期間	0.0105
第11計算期間	0.0050
第12計算期間	0.0100

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	6.2
第2計算期間	4.5
第3計算期間	9.7
第4計算期間	1.0
第5計算期間	3.4
第6計算期間	5.5
第7計算期間	0.8
第8計算期間	0.1
第9計算期間	2.7
第10計算期間	4.1
第11計算期間	0.8
第12計算期間	4.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	893,624,546	16,872,238
第2計算期間	321,078,931	200,996,226
第3計算期間	524,592,394	1,062,249,649
第4計算期間	957,262,064	390,897,369
第5計算期間	97,124,187	538,684,620
第6計算期間	66,365,485	580,891,309
第7計算期間	251,726,565	504,995,509
第8計算期間	110,740,865	241,115,011
第9計算期間	18,606,703	191,952,394
第10計算期間	16,522,061	147,731,817
第11計算期間	20,471,739	63,203,063
第12計算期間	11,374,256	22,672,218

(注) 当初設定数量は1,220,426,710口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

●ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)

2021年9月30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	10,145円
純資産総額	5.5億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.7%
3カ月間	1.4%
6カ月間	4.4%
1年間	6.9%
3年間	13.0%
5年間	27.8%
設定来	14.0%



※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実質的な運用管理費用(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: 150円 設定来分配金合計額: 1,095円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8期	第9期	第10期	第11期	第12期
	16年3月	16年9月	17年3月	17年9月	18年3月	18年9月	19年3月	19年9月	20年3月	20年9月	21年3月	21年9月
分配金	130円	100円	120円	80円	75円	135円	80円	50円	70円	105円	50円	100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。

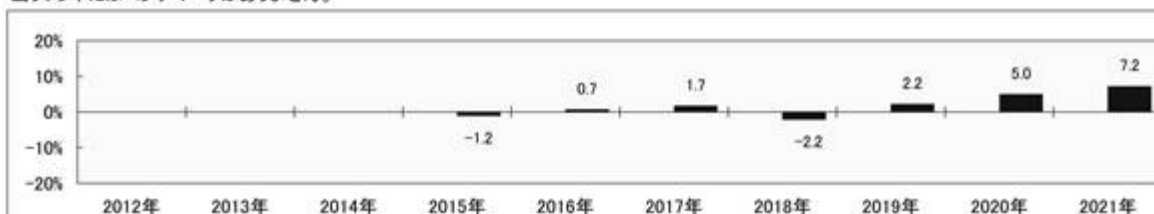
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
グッゲンハイム・パートナーズ・インベストメント・マネジメントLLC	ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(ノンヘッジ・クラス)	98.6%
大和アセットマネジメント	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.0%
合計		98.6%

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。

・2015年は設定日(9月8日)から年末、2021年は9月30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、次のイ・およびロ・に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日（当ファンドの運営および受益者に与える影響が軽微であるとして委託会社が定める日に限り除きます。）

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時までには受け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。

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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受け付けた取得申込みを取消することができるものとします。

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せん。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せん。

2【換金（解約）手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までには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、次のイ・およびロ・に掲げる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け付けを行いません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号（コールセンター） 0120-106212（営業日の9:00～17:00）

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

「為替ヘッジあり」または「為替ヘッジなし」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け付けが中止された場合、当該一部解約請求の申込みの受け付けを中止することがあります。（なお、他のファンドとは、受益者が「為替ヘッジあり」の受益者である場合、「為替ヘッジなし」を、また「為替ヘッジなし」の受益者である場合、「為替ヘッジあり」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（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約請求の受け付けを中止することができます。

一部解約請求の受け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請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、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請求を受け付けたものとして、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6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の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

- ・組入外国投資信託の受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・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

- ・本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
 2. 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。)
 3. 価格情報会社の提供する価額

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、販売会社または下記にお問合わせ下さい。

大和アセットマネジメント株式会社

電話番号(コールセンター) 0120-106212(営業日の9:00~17:00)

ホームページ <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2015年9月8日から2025年9月5日までとします。ただし、(5)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。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

毎年3月8日から9月7日まで、および9月8日から翌年3月7日までとします。ただし、最終計算期間は、2025年3月8日から2025年9月5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、最終計算期間の終了日には適用しません。

(5)【その他】

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、当ファンドが主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、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。
3. 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發します。
4. 前3.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4.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。
5. 前3.の書面決議は議決権を行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。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、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3.から前5.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。
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、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。
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。

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っ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送します。
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、これを行行使することができます。なお、信託約款にかかる知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。

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。

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っ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。

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。

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。

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。

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、)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、)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。

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】

【ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）】

(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12期計算期間（2021年3月9日から2021年9月7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】

ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	71,615,488	74,920,990
投資信託受益証券	2,791,662,762	2,576,419,911
親投資信託受益証券	997	997
未収入金	-	10,000,000
流動資産合計	2,863,279,247	2,661,341,898
資産合計	2,863,279,247	2,661,341,898
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	11,093,895	23,804,763
未払解約金	9,252,136	10,962,656
未払受託者報酬	421,858	379,165
未払委託者報酬	18,564,019	16,684,971
その他未払費用	126,483	113,677
流動負債合計	39,458,391	51,945,232
負債合計	39,458,391	51,945,232
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,773,473,807	1 2,505,764,604
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	50,347,049	103,632,062
(分配準備積立金)	100,163,550	99,379,854
元本等合計	2,823,820,856	2,609,396,666
純資産合計	2,823,820,856	2,609,396,666
負債純資産合計	2,863,279,247	2,661,341,898

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 2020年9月8日 至 2021年3月8日	第12期 自 2021年3月9日 至 2021年9月7日
営業収益		
受取配当金	31,468,602	29,667,171
受取利息	256	161
有価証券売買等損益	50,816,474	75,089,978
営業収益合計	19,347,616	104,757,310
営業費用		
支払利息	11,407	10,451
受託者報酬	421,858	379,165
委託者報酬	18,564,019	16,684,971
その他費用	126,483	113,788
営業費用合計	19,123,767	17,188,375
営業利益又は営業損失()	38,471,383	87,568,935
経常利益又は経常損失()	38,471,383	87,568,935
当期純利益又は当期純損失()	38,471,383	87,568,935
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,767,597	5,540,454
期首剰余金又は期首欠損金()	113,553,004	50,347,049
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,845,886	1,395,339
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,845,886	1,395,339
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,718,966	6,334,044
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	15,718,966	6,334,044
分配金	1 11,093,895	1 23,804,763
期末剰余金又は期末欠損金()	50,347,049	103,632,062

(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12期	
	自 2021年3月9日	至 2021年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間末日</p> <p>2021年3月7日が休日のため、前計算期間末日を2021年3月8日としております。このため、当計算期間は183日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第11期	第12期
	2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首元本額	3,109,114,325円	2,773,473,807円
期中追加設定元本額	92,009,588円	82,289,486円
期中一部解約元本額	427,650,106円	349,998,689円

2.	計算期間末日における受益 権の総数	2,773,473,807口	2,505,764,604口
----	----------------------	----------------	----------------

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第11期	第12期
	自 2020年9月8日 至 2021年3月8日	自 2021年3月9日 至 2021年9月7日
1 分配金の計算過程	<p>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(11,973,639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(37,697,639円)及び分配準備積立金(99,283,806円)より分配対象額は148,955,084円(1万口当たり537.07円)であり、うち11,093,895円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>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(24,229,885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(11,153,616円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,753,532円)及び分配準備積立金(87,801,116円)より分配対象額は159,938,149円(1万口当たり638.28円)であり、うち23,804,763円(1万口当たり95円)を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第12期 自 2021年3月9日 至 2021年9月7日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>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、投資信託受益証券及び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。</p>

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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第12期 2021年9月7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11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7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）
投資信託受益証券	54,043,641	68,267,898
親投資信託受益証券	0	0
合計	54,043,641	68,267,898

(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11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7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12期 自 2021年3月9日 至 2021年9月7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11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0182円 (10,182円)	1.0414円 (10,414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
投資信託受益証券	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY HEDGED CLASS UNIT	24,157,484.800	2,576,419,911	
投資信託受益証券 合計			2,576,419,911	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	999	997	
親投資信託受益証券 合計			997	
合計			2,576,420,908	

投資信託受益証券及び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、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(円ヘッジ・クラス)」の受益証券(円建)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「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・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、同ファンドの状況及び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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド(円ヘッジ・クラス)」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(米ドル建て)

貸借対照表
2020年9月30日

資産

投資資産の評価額(簿価 \$359,966,873)	\$	368,055,624
現金		124
中央清算されるデリバティブ取引におけるブローカーへの預託金		13,361
外国為替先渡取引による評価益		886,065
ブローカーからの未収金 - 中央清算されるデリバティブ-スワップ取引の変動証拠金		12,422
未収:		
売却済投資資産の代金		6,013,383
受渡遅延の売却済投資資産の代金		38,407,323
発行済受益証券の代金		60,719
配当		2,828
利息		1,757,938
資産合計		415,209,787

負債

外国為替先渡取引による評価損		635,802
店頭スワップ取引による評価損		16,146
店頭デリバティブ取引におけるブローカーからの預託金		750,000
ブローカーに対する未払金 - 中央清算されるデリバティブ-スワップ取引の変動証拠金		1,893

買い現先取引の評価額(簿価 \$1,486,005)	1,486,166
未払:	
購入済投資資産の代金	13,355,455
受渡遅延の購入済投資資産の代金	60,635,234
償還済受益証券の代金	190,905
会計および管理会社報酬	253,081
運用会社報酬	241,648
専門家報酬	92,852
販売会社報酬	33,731
保管会社報酬	25,448
管理会社報酬	17,898
為替取引執行会社報酬	15,336
名義書換代理人報酬	5,494
代理人報酬	5,189
印刷費用	2,847
その他負債	2,444
負債合計	77,767,569

純資産 \$ 337,442,218

純資産

豪ドル・クラス	\$ 9,052,170
円ヘッジ・クラス	29,721,688
ノンヘッジ・クラス	264,277,790
NZドル・クラス	4,706,877
トルコ・リラ・クラス	14,245,269
米ドル・クラス	10,629,416
南アフリカ・ランド・クラス	4,809,008
	\$ 337,442,218

発行済み受益証券

豪ドル・クラス	112,530
円ヘッジ・クラス	29,607,360
ノンヘッジ・クラス	288,800,653
NZドル・クラス	63,170
トルコ・リラ・クラス	902,620
米ドル・クラス	92,525
南アフリカ・ランド・クラス	70,153

受益証券1口当り純資産額

豪ドル・クラス	\$ 80.440
円ヘッジ・クラス	\$ 1.004
ノンヘッジ・クラス	\$ 0.915
NZドル・クラス	\$ 74.510
トルコ・リラ・クラス	\$ 15.780
米ドル・クラス	\$ 114.880
南アフリカ・ランド・クラス	\$ 68.550

損益計算書

2020年9月30日に終了した年度

投資収益

受取利息(源泉徴収税 \$5,030 控除後)	\$ 7,964,918
配当収益((源泉徴収税 \$10,261 控除後)	19,901
投資収益合計	7,984,819

費用

管理会社報酬	1,302,713
販売会社報酬	303,243
会計および管理会社報酬	217,119
運用会社報酬	212,912
保管会社報酬	135,375

専門家報酬	96,757
代理人報酬	46,653
名義書換代理人報酬	44,473
為替取引執行会社報酬	28,795
印刷費用	13,398
支払利息	13,326
受託会社報酬	10,150
登録料	5,865
その他費用	68
費用合計	2,430,847
投資利益	5,553,972
実現損益および評価損益：	
実現損益：	
証券投資	8,904,266
先物取引	213,083
スワップ取引	2,867,505
外国為替換算調整および外国為替先渡取引	(2,740,419)
実現利益	9,244,435
評価損益の変動：	
証券投資	678,266
スワップ取引	1,435,824
外国為替換算調整および外国為替先渡取引	1,034,547
評価益の変動	3,148,637
実現・評価損益	12,393,072
運用による純資産の増減	\$ 17,947,044

投資明細表
2020年9月30日

元本	証券の明細	評価額
	債券* (105.5%)	
	オーストラリア (1.0%)	
	社債 (1.0%)	
	Macquarie Bank, Ltd. (a)	
USD 1,610,000	3.62% due 2030/6/3	\$ 1,711,665
	Newcrest Finance Pty, Ltd. (a),(b)	
USD 800,000	3.25% due 2030/5/13	872,638
	Transurban Finance Co. Pty, Ltd. (a),(b)	
USD 850,000	2.45% due 2031/3/16	865,877
	社債合計	3,450,180
	オーストラリア合計 (簿価 \$3,302,808)	3,450,180
	バルバドス (0.2%)	
	資産担保証券(0.2%)	
	Global SC Finance II SRL 2014-1A Class A1 (a)	
USD 575,000	3.19% due 2029/7/17	584,469
	資産担保証券合計	584,469
	バルバドス合計 (簿価 \$575,228)	584,469
	バミューダ (1.9%)	
	資産担保証券 (1.9%)	
	CAL Funding III, Ltd. 2018-2A Class A (a),(b)	
USD 1,800,000	4.34% due 2043/9/25	1,843,742
	CAL Funding IV, Ltd. 2020-1A Class A (a),(b)	
USD 3,500,000	2.22% due 2045/9/25	3,511,125
	Textainer Marine Containers VII, Ltd. 2020-1A Class A (a)	
USD 942,012	2.73% due 2045/8/21	962,806
	資産担保証券合計	6,317,673
	バミューダ合計 (簿価 \$6,253,028)	6,317,673
	カナダ (0.8%)	

バンクローン (0.2%)		
Bombardier Recreational Products, Inc.		
USD 750,000	6.00% due 2027/5/24	759,690
バンクローン合計		759,690
社債 (0.6%)		
1011778 BC ULC / New Red Finance, Inc. (a),(b)		
USD 950,000	4.00% due 2030/10/15	957,324
USD 100,000	5.75% due 2025/4/15	106,750
Brookfield Finance, Inc. (b)		
USD 530,000	3.50% due 2051/3/30	523,681
Manulife Financial Corp. (b)		
USD 390,000	2.48% due 2027/5/19	417,369
社債合計		2,005,124
カナダ合計 (簿価 \$2,699,076)		2,764,814
ケイマン諸島 (11.7%)		
資産担保証券 (11.5%)		
AIM Aviation Finance, Ltd., 2015-1A Class A1 (a),(b)		
USD 1,800,807	4.21% due 2040/2/15	1,505,391
Anchorage Credit Funding 4, Ltd. 2016-4A Class A (a),(b)		
USD 2,000,000	3.50% due 2035/2/15	2,011,293
BSPRT 2018-FL3 Issuer, Ltd. Class A (a),(b),(c)		
USD 338,210	1.20% due 2028/3/15	336,335
BXMT 2020-FL2, Ltd. Class AS (a),(c)		
USD 2,000,000	1.30% due 2037/2/16	1,961,283
BXMT 2020-FL2, Ltd. Class C (a),(c)		
USD 1,000,000	1.80% due 2037/2/16	969,650
Cerberus Loan Funding XVII, Ltd. 2016-3A Class A (a),(c)		
USD 1,000,000	2.81% due 2028/1/15	978,825
Crown Point CLO III, Ltd. 2015-3A Class A2R (a),(b),(c)		
USD 2,500,000	1.73% due 2027/12/31	2,460,145
Denali Capital CLO XI, Ltd. 2015-1A Class A1RR (a),(b),(c)		
USD 2,700,000	1.40% due 2028/10/20	2,682,472
FDF I, Ltd. 2015-1A Class A (a),(b)		
USD 1,000,000	4.40% due 2030/11/12	1,003,175
FDF II, Ltd. 2016-2A Class A (a),(b)		
USD 1,000,000	4.29% due 2031/5/12	1,001,039
FINS 2020-1 A1		
USD 1,750,000	0.00% due 2038/5/15	1,749,125
Fortress Credit Opportunities XI CLO, Ltd. 2018-11A Class A1T (a),(c)		
USD 1,000,000	1.58% due 2031/4/15	942,401
Goldentree Loan Management US CLO 1, Ltd. 2017-1A Class AR (a),(b),(c)		
USD 1,000,000	1.22% due 2029/4/20	995,570
Golub Capital Partners CLO 16, Ltd. 2013-16A Class A1R (a),(c)		
USD 250,000	1.94% due 2029/7/25	247,933
Golub Capital Partners CLO 16, Ltd. 2013-16A Class A2R (a),(c)		
USD 2,000,000	2.09% due 2029/7/25	1,961,359
Golub Capital Partners CLO 16, Ltd. 2013-16A Class BR (a),(c)		
USD 250,000	2.49% due 2029/7/25	246,305
Golub Capital Partners CLO 36M, Ltd. 2018-36A Class A (a),(b),(c)		
USD 1,000,000	1.55% due 2031/2/5	961,241
KDAC Aviation Finance, Ltd. 2017-1A Class A (a)		
USD 1,066,511	4.21% due 2042/12/15	936,797
LoanCore 2018-CRE1 Issuer, Ltd. Class AS (a),(b),(c)		
USD 1,000,000	1.65% due 2028/5/15	991,316
LoanCore 2019-CRE2 Issuer, Ltd. Class AS (a),(b),(c)		
USD 650,000	1.65% due 2036/5/15	636,415
Midocean Credit Clo VII 2017-7A Class A2R (a),(b),(c)		
USD 1,000,000	1.73% due 2029/7/15	998,343
Monroe Capital CLO 2014-1, Ltd. Class AR (a),(c)		
USD 459,842	1.61% due 2026/10/22	457,631
Monroe Capital CLO 2014-1, Ltd. Class BR (a),(c)		
USD 1,000,000	1.96% due 2026/10/22	971,484

	Monroe Capital CLO 2015-1, Ltd. Class BR (a),(c)	
USD 1,250,000	2.01% due 2027/5/22	1,235,625
	Palmer Square Loan Funding 2018-4, Ltd. Class A1 (a),(b),(c)	
USD 2,365,751	1.18% due 2026/11/15	2,357,607
	Putnam Structured Product Funding 2003-1, Ltd. Class A2 (a),(c)	
USD 106,497	1.18% due 2038/10/15	105,633
	Shackleton 2015-VIII CLO, Ltd. 2015-8A Class A1R (a),(b),(c)	
USD 2,813,226	1.19% due 2027/10/20	2,793,333
	THL Credit Lake Shore MM CLO I, Ltd. 2019-1A Class A (a),(b),(c)	
USD 2,500,000	1.98% due 2030/4/15	2,457,850
	Tralee CLO III, Ltd. 2014-3A Class BRR (a),(b),(c)	
USD 3,000,000	1.72% due 2027/10/20	2,903,099
	VENTURE XIII CLO, Ltd. 2013-13A Class SUB (a),(b),(c)	
USD 500,000	0.00% due 2029/9/10	50,793
	資産担保証券合計	38,909,468
	バンクローン (0.2%)	
	Globalfoundries, Inc.	
USD 598,485	5.00% due 2026/6/5	598,485
	バンクローン合計	598,485
	ケイマン諸島合計 (簿価 \$40,620,088)	39,507,953
	フランス (0.1%)	
	社債 (0.1%)	
	Altice France S.A. (a),(b)	
USD 200,000	5.13% due 2029/1/15	199,250
USD 200,000	7.38% due 2026/5/1	209,580
	社債合計	408,830
	フランス合計 (簿価 \$407,018)	408,830
	ドイツ (0.0%)	
	バンクローン (0.0%)	
	Vertical Midco GmbH	
USD 150,000	4.57% due 2027/7/30	149,036
	バンクローン合計	149,036
	ドイツ合計 (簿価 \$147,099)	149,036
	ガーンジー (0.3%)	
	社債 (0.3%)	
	Pershing Square Holdings, Ltd. (a),(b)	
USD 1,000,000	5.50% due 2022/7/15	1,055,910
	社債合計	1,055,910
	ガーンジー合計 (簿価 \$1,041,639)	1,055,910
	アイルランド (0.1%)	
	社債 (0.1%)	
	LCPR Senior Secured Financing DAC (a),(b)	
USD 200,000	6.75% due 2027/10/15	209,000
	社債合計	209,000
	アイルランド合計 (簿価 \$215,383)	209,000
	ルクセンブルク (0.3%)	
	バンクローン (0.2%)	
	Aston FinCo S.A.R.L.	
USD 249,373	4.40% due 2026/10/9	245,633
	Samsonite International S.A.	
USD 548,625	5.50% due 2025/4/25	536,967
	バンクローン合計	782,600
	社債 (0.1%)	
	Telenet Finance Luxembourg Notes S.A.R.L. (a),(b)	
USD 200,000	5.50% due 2028/3/1	210,000
	社債合計	210,000
	ルクセンブルク合計 (簿価 \$981,943)	992,600
	多国籍企業 (0.5%)	
	社債 (0.5%)	
	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc. (a),(b)	
USD 430,000	4.13% due 2026/8/15	435,913

	Delta Air Lines, Inc. / SkyMiles IP, Ltd. (a)	
USD 1,150,000	4.50% due 2025/10/20	1,180,880
	社債合計	1,616,793
	多国籍企業合計 (簿価 \$1,582,003)	1,616,793
	オランダ (0.1%)	
	社債 (0.1%)	
	Alcoa Nederland Holding B.V. (a),(b)	
USD 200,000	5.50% due 2027/12/15	208,440
	社債合計	208,440
	オランダ合計 (簿価 \$200,000)	208,440
	英国 (3.1%)	
	バンクローン (0.1%)	
	GVC Holdings PLC	
USD 488,747	2.47% due 2024/3/29	482,637
	バンクローン合計	482,637
	社債 (3.0%)	
	Anglo American Capital PLC (a),(b)	
USD 1,450,000	2.63% due 2030/9/10	1,446,056
USD 750,000	3.95% due 2050/9/10	766,445
USD 200,000	5.63% due 2030/4/1	245,484
	BAE Systems PLC (a),(b)	
USD 340,000	3.40% due 2030/4/15	379,988
	BP Capital Markets PLC (b),(c)	
USD 1,480,000	4.88% due 2068/12/22	1,583,600
	Ferguson Finance PLC (a),(b)	
USD 750,000	3.25% due 2030/6/2	815,178
	Prudential PLC	
USD 270,000	3.13% due 2030/4/14	299,838
	Rolls-Royce PLC (a),(b)	
USD 700,000	2.38% due 2020/10/14	698,250
	Royalty Pharma PLC (a),(b)	
USD 270,000	2.20% due 2030/9/2	269,514
USD 520,000	3.55% due 2050/9/2	504,276
	Standard Chartered PLC (a),(b),(c)	
USD 1,400,000	4.64% due 2031/4/1	1,611,514
	Virgin Media Finance PLC (a),(b)	
USD 200,000	5.00% due 2030/7/15	199,000
	Virgin Media Secured Finance PLC (a),(b)	
USD 400,000	4.50% due 2030/8/15	410,976
	Vmed O2 UK Financing I PLC (a),(b)	
GBP 650,000	4.00% due 2029/1/31	834,018
	社債合計	10,064,137
	英国合計 (簿価 \$10,319,569)	10,546,774
	米国 (85.4%)	
	資産担保証券 (19.8%)	
	AASET 2017-1 Trust Class A (a)	
USD 419,010	3.97% due 2042/5/16	378,813
	AASET 2018-2 US, Ltd. Class A (a)	
USD 2,608,633	4.45% due 2038/11/18	2,426,206
	ABPCI Direct Lending Fund CLO VII LP 2019-7A Class A1A (a),(c)	
USD 300,000	2.08% due 2031/10/20	297,764
	American Home Mortgage Investment Trust 2007-1 Class GIOP	
USD 3,506,243	2.08% due 2047/5/25	583,453
	Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC 2019-1A Class A2II (a),(b)	
USD 500,000	4.72% due 2049/6/7	433,630
	Arbys Funding LLC 2020-1A Class A2 (a),(b)	
USD 1,600,000	3.24% due 2050/7/30	1,645,296
	Asset Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust Series AEG 2006-HE1 Class M1 (b),(c)	
USD 1,000,000	0.55% due 2036/1/25	954,496
	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2006-HE9 Class 2A (b),(c)	
USD 547,641	0.29% due 2036/11/25	524,469

	Benchmark 2018-B6 Mortgage Trust Class XA (c)	
USD 23,439,898	0.59% due 2051/10/10	584,905
	BRAVO Residential Funding Trust 2019-NQM1 Class A1 (a),(b),(c)	
USD 607,899	2.67% due 2059/7/25	620,347
	BX Commercial Mortgage Trust 2019-XL Class F (a),(c)	
USD 949,298	2.15% due 2036/10/15	937,394
	Capital Automotive LLC 2017-1A Class A1 (a),(b)	
USD 825,975	3.87% due 2047/4/15	827,482
	Capital Automotive REIT 2014-1A Class A (a),(b)	
USD 3,353,953	3.66% due 2044/10/15	3,364,062
	Capmark Military Housing Trust 2007-AET2 Class A (a)	
USD 471,222	6.06% due 2052/10/10	563,553
	CARS-DB4 LP 2020-1A Class A5 (a)	
USD 600,000	3.48% due 2050/2/15	623,392
	CARS-DB4 LP 2020-1A Class A6 (a)	
USD 1,000,000	3.81% due 2050/2/15	1,039,491
	Cascade Funding Mortgage Trust 2018-RM2 Class A (a),(b),(c)	
USD 2,336,233	4.00% due 2068/10/25	2,423,378
	Castlelake Aircraft Securitization Trust 2017-1 Class A	
USD 613,832	3.97% due 2042/7/15	552,709
	Castlelake Aircraft Securitization Trust 2018-1 Class A (a)	
USD 1,571,167	4.13% due 2043/6/15	1,466,793
	CD 2016-CD1 Mortgage Trust Class XA (c)	
USD 959,698	1.53% due 2049/8/10	58,202
	CF Hippolyta LLC 2020-1 Class B1 (a),(b)	
USD 250,000	2.28% due 2060/7/15	254,367
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C2 Class XA (c)	
USD 966,513	1.90% due 2049/8/10	76,683
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-GC37 Class XA (c)	
USD 3,663,501	1.90% due 2049/4/10	268,449
	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-P5 Class XA (c)	
USD 1,920,778	1.65% due 2049/10/10	119,074
	Citigroup Mortgage Loan Trust Series 2005-OPT3 Asset Backed Pass-Through Certificates Class M3 (b),(c)	
USD 122,719	0.87% due 2035/5/25	122,567
	COMM 2015-CCRE26 Mortgage Trust Class XA (c)	
USD 6,023,396	1.08% due 2048/10/10	230,189
	CSMC 2018-RPL9 Trust Class A1 (a),(b),(c)	
USD 2,032,155	3.85% due 2057/9/25	2,182,472
	CSMC Series 2015-12R Class 2A1 (a),(c)	
USD 400,117	0.68% due 2037/11/30	398,425
	Falcon Aerospace, Ltd. 2017-1 Class A (a)	
USD 224,780	4.58% due 2042/2/15	202,467
	FirstKey Revolving Trust 2020-C2	
USD 2,147,709	0.00% due 2023/7/31	2,167,039
	FNMA-Aces 2017-M11 Class A2	
USD 1,600,000	2.98% due 2029/8/25	1,835,273
	FNMA-Aces 2020-M23 Class X1 (c)	
USD 4,097,713	1.61% due 2035/3/25	587,934
	Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates 2015-R1 Class B1 (a),(c)	
USD 1,989,481	4.66% due 2055/11/25	2,300,794
	Freddie Mac Military Housing Bonds Resecuritization Trust Certificates 2015-R1 Class XA1 (a),(c)	
USD 5,921,075	0.70% due 2055/11/25	424,899
	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K046 Class X1 (c)	
USD 19,815,805	0.49% due 2025/3/25	295,796
	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K-1513 Class A3	
USD 1,300,000	2.80% due 2034/8/25	1,503,789
	GE Business Loan Trust 2007-1 Class A (a),(c)	
USD 361,624	0.32% due 2035/4/15	361,624
	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. 2006-NELL Class A (a)	
USD 469,274	5.36% due 2051/5/10	528,876
	GMAC Commercial Mortgage Asset Corp. 2007-HCKM Class A (a)	
USD 946,198	6.11% due 2052/8/10	1,110,143

	GS Mortgage Securities Corp. Trust 2020-DUNE Class D (a),(c)	
USD 1,000,000	2.05% due 2036/12/15	884,681
	GS Mortgage Securities Corp. Trust 2020-UPTN Class D (a),(c)	
USD 1,000,000	3.25% due 2037/2/10	970,194
	Home Equity Loan Trust 2007-FRE1 Class 1AV1 (b),(c)	
USD 1,865,908	0.34% due 2037/4/25	1,750,805
	Homeward Opportunities Fund I Trust 2019-2 Class A1 (a),(b),(c)	
USD 617,440	2.70% due 2059/9/25	623,708
	InSite Issuer LLC 2020-1A Class B (a),(b)	
USD 2,000,000	2.49% due 2050/9/15	1,997,082
	Lehman XS Trust Series 2006-12N Class A32A (b),(c)	
USD 2,116,906	0.35% due 2046/8/25	2,005,848
	Lehman XS Trust Series 2007-2N Class 2A (b),(c)	
USD 698,379	0.33% due 2037/2/25	647,736
	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34 Class XA (c)	
USD 16,164,569	0.95% due 2052/11/15	721,392
	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-UB11 Class XA (b),(c)	
USD 2,312,541	1.72% due 2049/8/15	144,960
	Nassau 2019 CFO LLC Class A (a)	
USD 400,429	3.98% due 2034/8/15	407,562
	New Residential Advance Receivables Trust Advance Receivables Backed 2019-T4 Class AT4 (a),(b)	
USD 2,000,000	2.33% due 2051/10/15	2,014,356
	New Residential Advance Receivables Trust Advance Receivables Backed 2019-T5 Class AT5 (a),(b)	
USD 1,000,000	2.42% due 2051/10/15	995,860
	NewStar Clarendon Fund CLO LLC 2014-1A Class AR (a),(b),(c)	
USD 1,536,946	1.54% due 2027/1/25	1,523,788
	NXT Capital CLO 2017-1 LLC Class A (a),(c)	
USD 1,000,000	1.97% due 2029/4/20	971,869
	Oxford Finance Funding 2020-1 LLC Class A2 (a),(b)	
USD 500,000	3.10% due 2028/2/15	507,896
	Park Place Securities, Inc. Asset Backed Pass Through Certificates Series 2005-WHQ3 Class M4 (b),(c)	
USD 2,600,000	1.09% due 2035/6/25	2,580,823
	RALI Series 2006-QO2 Trust Class A1 (b),(c)	
USD 116,526	0.37% due 2046/2/25	32,873
	Raspro Trust 2005-1A Class B (a),(c)	
USD 443,606	2.89% due 2024/3/23	416,128
	Ready Capital Mortgage Financing 2019-FL3 LLC Class B (a),(c)	
USD 75,000	1.80% due 2034/3/25	72,389
	Sabey Data Center Issuer LLC 2020-1 Class A2 (a),(b)	
USD 500,000	3.81% due 2045/4/20	517,578
	Soundview Home Loan Trust 2006-OPT5 Class 1A1 (b),(c)	
USD 1,892,667	0.29% due 2036/7/25	1,834,227
	Starwood Mortgage Residential Trust 2019-1 Class A1 (a),(b),(c)	
USD 415,606	2.94% due 2049/6/25	422,285
	STORE Master Funding I LLC 2015-1A Class A1 (a),(b)	
USD 972,917	3.75% due 2045/4/20	988,379
	STORE Master Funding I LLC 2015-1A Class A2 (a),(b)	
USD 194,583	4.17% due 2045/4/20	201,726
	STORE Master Funding I-VII 2016-1A Class A1 (a),(b)	
USD 926,820	3.96% due 2046/10/20	945,396
	STORE Master Funding I-VII 2018-1A Class A2 (a),(b)	
USD 960,399	4.29% due 2048/10/20	1,017,038
	STORE Master Funding LLC 2013-2A Class A2 (a),(b)	
USD 376,695	5.33% due 2043/7/20	343,024
	TCP Waterman CLO, Ltd. 2016-1A Class A1ST (a),(c)	
USD 1,000,000	2.30% due 2028/12/15	984,044
	Textainer Marine Containers VIII, Ltd. 2020-2A Class A (a),(b)	
USD 1,750,000	2.10% due 2045/9/20	1,751,124
	UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2 Class XA (c)	
USD 5,537,716	1.23% due 2050/8/15	311,559
	Vantage Data Centers Issuer LLC 2018-1A Class A2 (a),(b)	
USD 146,250	4.07% due 2043/2/16	151,282

	VB-S1 Issuer LLC 2020-1A Class C2 (a),(b)	
USD 500,000	3.03% due 2050/6/15	521,140
	Wachovia Asset Securitization Issuance II LLC 2007-HE2 Trust Class A (a),(c)	
USD 545,557	0.30% due 2037/7/25	489,485
	Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates WMALT Series 2006-AR9 Trust Class 1A (b),(c)	
USD 808,552	1.85% due 2046/11/25	704,624
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1 Class A2	
USD 157,424	2.63% due 2048/5/15	157,367
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C37 Class XA (c)	
USD 10,062,078	1.11% due 2049/12/15	339,585
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5 Class XA (c)	
USD 3,963,571	1.65% due 2059/1/15	236,133
	Wendy's Funding LLC Class A23 (a),(b)	
USD 237,500	4.50% due 2045/6/15	242,464
	資産担保証券合計	66,705,105
	バンクローン (4.4%)	
	Alchemy Copyrights LLC	
USD 700,000	4.00% due 2027/8/16	700,000
	Alterra Mountain Co. (d)	
USD 497,436	0.00% due 2024/7/31	481,682
	Berlin Packaging LLC	
USD 298,473	3.16% due 2025/11/7	290,110
	BIFM CA Buyer, Inc. (d)	
USD 795,140	3.76% due 2026/6/1	784,971
	Cambrex Corp.	
USD 249,372	6.00% due 2026/12/4	250,619
	Charter NEX US, Inc.	
USD 199,219	3.75% due 2024/5/16	195,069
	CHG Healthcare Services, Inc.	
USD 463,097	4.00% due 2023/6/7	456,192
	CNT Holdings III Corp.	
USD 498,705	4.00% due 2023/1/22	498,498
	CPI Holdco LLC	
USD 338,300	4.40% due 2026/11/4	337,243
	Cushman & Wakefield U.S. Borrower LLC (d)	
USD 148,868	0.00% due 2025/8/21	144,110
	Delta Air Lines, Inc.	
USD 249,375	5.75% due 2023/4/29	249,375
	DiversiTech Holdings, Inc.	
USD 648,325	4.00% due 2024/6/3	639,411
	Elanco Animal Health, Inc.	
USD 97,661	1.91% due 2027/8/1	95,066
	Filtration Group Corp.	
USD 397,879	3.15% due 2025/3/31	391,041
	Graftech International, Ltd. (d)	
USD 846,721	4.50% due 2025/2/12	839,312
	Hamilton Holdco LLC	
USD 692,911	2.23% due 2027/1/2	679,053
	Illuminate Buyer LLC	
USD 350,000	4.15% due 2027/6/30	347,849
	Jane Street Group LLC	
USD 99,749	3.15% due 2025/1/31	99,219
	Jefferies Finance LLC (d)	
USD 350,000	0.00% due 2027/9/30	348,688
	Mileage Plus Holdings LLC	
USD 400,000	6.25% due 2027/6/21	407,196
	Navicure, Inc. (d)	
USD 500,000	0.00% due 2026/10/22	496,875
	Neustar, Inc.	
USD 119,167	4.50% due 2024/8/8	112,451
	Nielsen Finance LLC (d)	
USD 600,000	0.00% due 2023/10/4	589,500

	Omnitracs LLC		
USD 199,487	2.98% due 2025/3/21		193,377
	PQ Corporation		
USD 99,750	4.00% due 2027/2/7		99,513
	Project Ruby Ultimate Parent Corp.		
USD 398,972	4.50% due 2024/2/9		395,481
	ProQuest LLC		
USD 331,091	3.65% due 2026/10/23		328,070
	Recorded Books, Inc.		
USD 141,519	4.16% due 2025/8/29		140,811
	Siteone Landscape Supply LLC (d)		
USD 352,379	3.75% due 2024/10/29		350,617
	T-Mobile USA, Inc.		
USD 897,750	3.15% due 2027/4/1		898,150
	TransDigm, Inc. (d)		
USD 896,482	0.00% due 2025/12/9		849,166
	Upland Software, Inc.		
USD 149,622	3.90% due 2026/8/6		147,799
	US Foods, Inc.		
USD 790,000	4.25% due 2025/4/24		770,250
	USI, Inc.		
USD 250,000	4.22% due 2026/12/2		248,203
	USIC Holdings, Inc.		
USD 886,644	4.25% due 2023/12/8		874,634
	Xplornet Communications, Inc.		
USD 249,375	4.90% due 2027/6/10		245,636
	バンクローン合計		14,975,237
	社債 (36.8%)		
	Acadia Healthcare Co., Inc. (a),(b)		
USD 350,000	5.00% due 2029/4/15		354,813
	AES Corp. (b)		
USD 360,000	3.95% due 2030/7/15		397,786
USD 175,000	5.50% due 2025/4/15		180,437
	Alcon Finance Corp. (a),(b)		
USD 620,000	2.60% due 2030/5/27		656,319
	Alexandria Real Estate Equities, Inc. (b)		
USD 250,000	4.90% due 2030/12/15		314,692
	Alleghany Corp. (b)		
USD 2,310,000	3.63% due 2030/5/15		2,596,633
	Allison Transmission, Inc. (a),(b)		
USD 150,000	5.00% due 2024/10/1		151,509
	Altria Group, Inc. (b)		
USD 490,000	3.40% due 2030/5/6		534,749
USD 90,000	4.45% due 2050/5/6		100,151
	Amazon.com, Inc. (b)		
USD 340,000	2.70% due 2060/6/3		352,436
	American International Group, Inc. (b)		
USD 1,130,000	3.40% due 2030/6/30		1,251,321
USD 950,000	4.38% due 2050/6/30		1,111,354
	American Woodmark Corp. (a),(b)		
USD 75,000	4.88% due 2026/3/15		75,938
	AMN Healthcare, Inc. (a),(b)		
USD 200,000	4.63% due 2027/10/1		205,000
	Amsted Industries, Inc. (a),(b)		
USD 200,000	4.63% due 2030/5/15		206,500
	Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. (b)		
USD 535,000	3.50% due 2030/6/1		608,686
	Aon Corp. (b)		
USD 410,000	2.80% due 2030/5/15		444,218
	Aramark Services, Inc. (a),(b)		
USD 20,000	5.00% due 2028/2/1		20,150
USD 300,000	6.38% due 2025/5/1		312,503

	Ares Finance Co. II LLC (a),(b)	
USD 700,000	3.25% due 2030/6/15	729,839
	Arizona Public Service Co. (b)	
USD 280,000	3.35% due 2050/5/15	308,389
	Assurant, Inc. (b),(c)	
USD 172,000	1.48% due 2021/3/26	171,939
	AT&T, Inc. (b)	
USD 690,000	2.75% due 2031/6/1	727,990
	Avantor Funding, Inc. (a),(b)	
USD 200,000	4.63% due 2028/7/15	207,500
	Baker Hughes a GE Co. LLC / Baker Hughes Co-Obligor, Inc. (b)	
USD 90,000	4.49% due 2030/5/1	102,266
	Ball Corp. (b)	
USD 575,000	2.88% due 2030/8/15	568,531
	Bank of America Corp. (b),(c)	
USD 1,400,000	2.68% due 2041/6/19	1,429,514
	Bank of New York Mellon Corp. (b),(c)	
USD 230,000	4.70% due 2068/9/20	244,030
	BAT Capital Corp. (b)	
USD 1,700,000	3.98% due 2050/9/25	1,676,243
	Belrose Funding Trust (a),(b)	
USD 550,000	2.33% due 2030/8/15	543,542
	Bemis Co., Inc. (b)	
USD 240,000	2.63% due 2030/6/19	255,832
	Black Hills Corp. (b)	
USD 190,000	2.50% due 2030/6/15	196,478
	Blackstone Holdings Finance Co. LLC (a),(b)	
USD 1,700,000	2.80% due 2050/9/30	1,672,992
	Boeing Co. (b)	
USD 1,680,000	5.15% due 2030/5/1	1,888,334
USD 840,000	5.71% due 2040/5/1	990,295
USD 840,000	5.81% due 2050/5/1	1,016,215
	Boston Scientific Corp. (b)	
USD 450,000	2.65% due 2030/6/1	477,567
	Boxer Parent Co., Inc. (a),(b)	
USD 150,000	7.13% due 2025/10/2	160,209
	Broadcom, Inc. (b)	
USD 890,000	4.15% due 2030/11/15	999,776
USD 250,000	4.75% due 2029/4/15	291,264
	Brown & Brown, Inc. (b)	
USD 800,000	2.38% due 2031/3/15	804,920
	Bunge Ltd. Finance Corp. (b)	
USD 150,000	1.63% due 2025/8/17	656
	California Institute of Technology (b)	
USD 425,000	3.65% due 2019/9/1	464,645
	Carpenter Technology Corp. (b)	
USD 500,000	6.38% due 2028/7/15	523,312
	Carrier Global Corp. (a),(b)	
USD 440,000	2.70% due 2031/2/15	458,405
	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp. (a),(b)	
USD 50,000	4.25% due 2031/2/1	51,823
	CDW LLC / CDW Finance Corp. (b)	
USD 160,000	3.25% due 2029/2/15	159,400
	Centene Corp. (b)	
USD 600,000	3.00% due 2030/10/15	612,120
	Charles Schwab Corp. (b),(c)	
USD 700,000	5.38% due 2069/9/1	758,485
	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital (b)	
USD 1,050,000	2.80% due 2031/4/1	1,092,016
	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	
USD 1,300,000	3.52% due 2039/12/31	1,287,035
	Chevron USA, Inc. (b)	

USD 350,000	2.34% due 2050/8/12 Choice Hotels International, Inc. (b)	331,462
USD 530,000	3.70% due 2031/1/15 CIT Group, Inc. (b),(c)	557,746
USD 175,000	3.93% due 2024/6/19 Citigroup, Inc. (b),(c)	176,365
USD 1,000,000	2.57% due 2031/6/3 Citizens Financial Group, Inc. (b)	1,048,070
USD 1,930,000	3.25% due 2030/4/30 Clearway Energy Operating LLC (a),(b)	2,130,425
USD 50,000	4.75% due 2028/3/15 CNA Financial Corp. (b)	51,625
USD 250,000	2.05% due 2030/8/15 CNH Industrial Capital LLC (b)	249,556
USD 1,700,000	1.88% due 2026/1/15 Coca-Cola Co.	1,697,686
USD 300,000	2.75% due 2060/6/1 Constellation Brands, Inc. (b)	304,687
USD 600,000	2.88% due 2030/5/1	647,838
USD 210,000	3.75% due 2050/5/1 CoStar Group, Inc. (a),(b)	234,481
USD 1,140,000	2.80% due 2030/7/15 CSC Holdings LLC (a),(b)	1,181,247
USD 200,000	3.38% due 2031/2/15	193,650
USD 400,000	4.13% due 2030/12/1 CubeSmart LP (b)	407,700
USD 1,700,000	2.00% due 2031/2/15 Cushman & Wakefield US Borrower LLC (a),(b)	1,677,373
USD 450,000	6.75% due 2028/5/15 CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp. (b)	467,168
USD 850,000	2.15% due 2030/11/1 DaVita, Inc. (a),(b)	830,535
USD 525,000	3.75% due 2031/2/15	505,864
USD 640,000	4.63% due 2030/6/1 Delta Air Lines, Inc. (a)	655,552
USD 1,795,000	7.00% due 2025/5/1 Dollar General Corp. (b)	1,970,953
USD 150,000	3.50% due 2030/4/3 EnerSys (a),(b)	170,724
USD 50,000	4.38% due 2027/12/15 Equitable Holdings, Inc. (b),(c)	51,000
USD 950,000	4.95% due 2068/12/15 FedEx Corp. (b)	969,000
USD 850,000	4.25% due 2030/5/15 Fidelity National Financial, Inc. (b)	1,021,759
USD 960,000	2.45% due 2031/3/15	952,180
USD 680,000	3.40% due 2030/6/15 First American Financial Corp. (b)	735,473
USD 610,000	4.00% due 2030/5/15 Five Corners Funding Trust II (a),(b)	672,211
USD 1,260,000	2.85% due 2030/5/15 Florida Gas Transmission Co. LLC (a),(b)	1,353,571
USD 200,000	2.55% due 2030/7/1 Flowserve Corp. (b)	209,627
USD 860,000	3.50% due 2030/10/1 Fort Benning Family Communities LLC (a)	851,579
USD 449,000	5.81% due 2051/1/15 Fox Corp. (b)	570,588
USD 90,000	3.50% due 2030/4/8 Gartner, Inc. (a),(b)	101,712
USD 800,000	3.75% due 2030/10/1	809,240
USD 25,000	4.50% due 2028/7/1	26,281

	GATX Corp. (b)	
USD 570,000	4.00% due 2030/6/30	656,602
	Glenn Pool Oil & Gas Trust	
USD 50,004	6.00% due 2021/8/2	42,399
	Global Payments, Inc. (b)	
USD 350,000	2.90% due 2030/5/15	374,504
	GLP Capital LP / GLP Financing II, Inc. (b)	
USD 580,000	4.00% due 2031/1/15	603,797
USD 450,000	5.30% due 2029/1/15	501,152
	Graphic Packaging International LLC (a),(b)	
USD 225,000	3.50% due 2029/3/1	226,406
	Hanesbrands, Inc. (a),(b)	
USD 100,000	5.38% due 2025/5/15	105,500
	Health Care Service Corp. A Mutual Legal Reserve Co. (a),(b)	
USD 320,000	3.20% due 2050/6/1	332,007
	Healthcare Trust of America Holdings LP (b)	
USD 850,000	2.00% due 2031/3/15	835,394
	Hilton Domestic Operating Co., Inc. (a),(b)	
USD 250,000	5.38% due 2025/5/1	261,075
	Hologic, Inc. (a),(b)	
USD 850,000	3.25% due 2029/2/15	855,313
	Host Hotels & Resorts LP (b)	
USD 720,000	3.50% due 2030/9/15	689,191
	Howmet Aerospace, Inc. (b)	
USD 200,000	6.88% due 2025/5/1	221,000
	Hyatt Hotels Corp. (b)	
USD 390,000	5.38% due 2025/4/23	419,856
USD 350,000	5.75% due 2030/4/23	401,892
	Intercontinental Exchange, Inc. (b)	
USD 410,000	3.00% due 2050/6/15	427,466
	Iron Mountain, Inc. (a),(b)	
USD 175,000	4.50% due 2031/2/15	176,645
USD 425,000	5.25% due 2030/7/15	443,063
USD 200,000	5.63% due 2032/7/15	211,200
	Jaguar Holding Co. II / PPD Development LP (a),(b)	
USD 475,000	4.63% due 2025/6/15	489,250
	Jeffries Group LLC	
USD 640,000	2.75% due 2032/10/15	633,395
	Johns Hopkins University (b)	
USD 500,000	2.81% due 2060/1/1	529,964
	JPMorgan Chase & Co. (b),(c)	
USD 380,000	2.96% due 2031/5/13	407,704
USD 330,000	3.11% due 2041/4/22	357,964
USD 400,000	4.49% due 2031/3/24	488,137
	Kaiser Aluminum Corp. (a),(b)	
USD 100,000	6.50% due 2025/5/1	103,079
	Kemper Corp. (b)	
USD 1,700,000	2.40% due 2030/9/30	1,682,141
	KKR Group Finance Co. III LLC (a)	
USD 350,000	5.13% due 2044/6/1	437,075
	KKR Group Finance Co. VI LLC (a),(b)	
USD 700,000	3.75% due 2029/7/1	805,313
	KKR Group Finance Co. VIII LLC (a),(b)	
USD 460,000	3.50% due 2050/8/25	468,757
	Kraft Heinz Foods Co.	
USD 150,000	4.25% due 2031/3/1	164,573
USD 340,000	4.38% due 2046/6/1	349,326
USD 100,000	5.00% due 2042/6/4	109,512
USD 125,000	5.50% due 2050/6/1	143,257
	Level 3 Financing, Inc. (a),(b)	
USD 750,000	3.63% due 2029/1/15	740,625
USD 150,000	3.88% due 2029/11/15	162,359

USD 625,000	4.25% due 2028/7/1 Liberty Mutual Group, Inc. (a),(b)	634,575
USD 470,000	3.95% due 2060/5/15 Liberty Utilities Finance GP 1 (a),(b)	516,125
USD 850,000	2.05% due 2030/9/15 Lincoln National Corp. (b)	837,963
USD 700,000	3.40% due 2031/1/15	776,284
USD 260,000	4.38% due 2050/6/15 Loews Corp. (b)	302,256
USD 330,000	3.20% due 2030/5/15 Magellan Midstream Partners LP (b)	368,883
USD 330,000	3.25% due 2030/6/1 Markel Corp. (b),(c)	354,158
USD 1,120,000	6.00% due 2068/12/1 Marriott International, Inc. (c)	1,184,400
USD 330,000	0.85% due 2020/12/1	329,413
USD 570,000	3.50% due 2032/10/15	565,649
USD 560,000	4.63% due 2030/6/15	599,730
USD 440,000	5.75% due 2025/5/1 Masco Corp. (b)	491,049
USD 850,000	2.00% due 2030/10/1 Match Group Holdings II LLC (a),(b)	850,320
USD 200,000	4.63% due 2028/6/1 MetLife, Inc. (b),(c)	206,000
USD 1,700,000	3.85% due 2069/3/15 Midwest Connector Capital Co. LLC (a),(b)	1,696,175
USD 110,000	4.63% due 2029/4/1 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets, Ltd. (a),(b)	111,175
USD 500,000	6.50% due 2027/6/20 Minerals Technologies, Inc. (a),(b)	520,625
USD 225,000	5.00% due 2028/7/1 MSCI, Inc. (a),(b)	232,828
USD 425,000	3.88% due 2031/2/15 Nasdaq, Inc. (b)	442,935
USD 190,000	3.25% due 2050/4/28 Nationwide Mutual Insurance Co. (a),(b)	198,436
USD 1,670,000	4.35% due 2050/4/30 NCR Corp. (a),(b)	1,789,055
USD 400,000	5.00% due 2028/10/1 NetApp, Inc. (b)	400,320
USD 2,600,000	2.70% due 2030/6/22 New Enterprise Stone & Lime Co., Inc. (a),(b)	2,702,193
USD 150,000	6.25% due 2026/3/15 NFP Corp. (a),(b)	154,500
USD 350,000	6.88% due 2028/8/15	354,331
USD 350,000	7.00% due 2025/5/15 Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co. (a),(b)	371,000
USD 850,000	5.63% due 2028/10/1 Nucor Corp. (b)	879,155
USD 530,000	2.70% due 2030/6/1 NuStar Logistics LP (b)	569,064
USD 150,000	6.38% due 2030/10/1 OneAmerica Financial Partners, Inc. (a),(b)	155,625
USD 870,000	4.25% due 2050/10/15 Orlando Health Obligated Group	875,180
USD 1,000,000	2.89% due 2035/10/1 Oshkosh Corp. (b)	1,000,000
USD 70,000	3.10% due 2030/3/1 PartnerRe Finance B LLC (b),(c)	74,139
USD 220,000	4.50% due 2050/10/1 Performance Food Group, Inc. (a),(b)	220,890
USD 75,000	6.88% due 2025/5/1	79,875

	Post Holdings, Inc. (a),(b)	
USD 125,000	4.63% due 2030/4/15	128,594
	Presidio Holdings, Inc. (a),(b)	
USD 75,000	4.88% due 2027/2/1	75,750
	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance, Inc. (a),(b)	
USD 175,000	3.38% due 2027/8/31	167,868
	Prudential Financial, Inc. (b),(c)	
USD 230,000	3.70% due 2050/10/1	234,669
	Qorvo, Inc. (b)	
USD 150,000	3.38% due 2031/4/1	152,438
USD 290,000	4.38% due 2029/10/15	308,125
	QualityTech LP / QTS Finance Corp. (a),(b)	
USD 250,000	3.88% due 2028/10/1	251,650
	Quanta Services, Inc. (b)	
USD 1,140,000	2.90% due 2030/10/1	1,163,495
	Quest Diagnostics, Inc. (b)	
USD 330,000	2.80% due 2031/6/30	355,435
	Quicken Loans LLC / Quicken Loans Co-Issuer, Inc. (a),(b)	
USD 750,000	3.88% due 2031/3/1	740,625
	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance, Inc. (a),(b)	
USD 850,000	4.50% due 2026/9/15	849,822
	Reinsurance Group of America, Inc. (b)	
USD 1,360,000	3.15% due 2030/6/15	1,480,683
	Reliance Standard Life Global Funding II (a)	
USD 1,380,000	2.75% due 2025/5/7	1,456,967
	RELX Capital, Inc. (b)	
USD 630,000	3.00% due 2030/5/22	688,863
	Sabine Pass Liquefaction LLC (a),(b)	
USD 890,000	4.50% due 2030/5/15	2,542
	SBA Communications Corp. (a),(b)	
USD 75,000	3.88% due 2027/2/15	76,125
	SBA Tower Trust (a)	
USD 1,750,000	2.33% due 2028/1/15	1,777,144
	Service Corp. International (b)	
USD 150,000	3.38% due 2030/8/15	150,188
	Sirius XM Radio, Inc. (a),(b)	
USD 300,000	4.13% due 2030/7/1	305,625
	Six Flags Theme Parks, Inc. (a),(b)	
USD 150,000	7.00% due 2025/7/1	159,563
	Smithfield Foods, Inc. (a),(b)	
USD 490,000	3.00% due 2030/10/15	491,058
	Snap-on, Inc. (b)	
USD 300,000	3.10% due 2050/5/1	313,796
	Standard Industries, Inc. (a),(b)	
USD 200,000	3.38% due 2031/1/15	197,399
USD 175,000	4.38% due 2030/7/15	179,421
USD 100,000	5.00% due 2027/2/15	104,000
	Starbucks Corp. (b)	
USD 1,000,000	2.55% due 2030/11/15	1,061,754
	Steel Dynamics, Inc. (b)	
USD 100,000	3.25% due 2031/1/15	107,001
	Suburban Propane Partners LP / Suburban Energy Finance Corp. (b)	
USD 250,000	5.88% due 2027/3/1	256,875
	Switch, Ltd. (a),(b)	
USD 700,000	3.75% due 2028/9/15	707,000
	Sysco Corp. (b)	
USD 1,610,000	5.95% due 2030/4/1	2,040,559
	Tenet Healthcare Corp. (a),(b)	
USD 100,000	4.63% due 2028/6/15	101,440
	Textron, Inc. (b)	
USD 1,000,000	2.45% due 2031/3/15	993,684
USD 60,000	3.00% due 2030/6/1	63,195

	T-Mobile USA, Inc. (a),(b)	
USD 1,000,000	2.55% due 2031/2/15	1,034,610
USD 605,000	3.88% due 2030/4/15	686,445
	Trinity Industries, Inc. (b)	
USD 200,000	4.55% due 2024/10/1	203,009
	Universal Health Services, Inc. (a),(b)	
USD 800,000	2.65% due 2030/10/15	796,208
	University of Chicago (b)	
USD 150,000	2.76% due 2045/4/1	153,302
	US Foods, Inc. (a),(b)	
USD 350,000	6.25% due 2025/4/15	370,563
	Valero Energy Corp. (b)	
USD 850,000	2.15% due 2027/9/15	846,569
	Valvoline, Inc. (b)	
USD 130,000	4.38% due 2025/8/15	133,738
	Vertical US Newco, Inc. (a),(b)	
USD 200,000	5.25% due 2027/7/15	207,853
	VF Corp. (b)	
USD 700,000	2.95% due 2030/4/23	762,105
	ViacomCBS, Inc. (b)	
USD 530,000	4.75% due 2025/5/15	608,913
USD 1,085,000	4.95% due 2031/1/15	1,304,667
USD 510,000	4.95% due 2050/5/19	598,412
	W R Berkley Corp. (b)	
USD 140,000	4.00% due 2050/5/12	165,599
	Walgreens Boots Alliance, Inc. (b)	
USD 271,000	3.20% due 2030/4/15	284,035
USD 828,000	4.10% due 2050/4/15	827,344
	Wells Fargo & Co. (b),(c)	
USD 1,700,000	2.39% due 2028/6/2	1,773,575
USD 250,000	2.57% due 2031/2/11	262,453
	Weyerhaeuser Co. (b)	
USD 68,000	4.00% due 2030/4/15	80,401
	Williams Scotsman International, Inc. (a),(b)	
USD 150,000	4.63% due 2028/8/15	150,606
	Willis North America, Inc. (b)	
USD 250,000	2.95% due 2029/9/15	269,395
	WMG Acquisition Corp. (a),(b)	
USD 125,000	3.00% due 2031/2/15	121,531
USD 100,000	3.88% due 2030/7/15	103,120
	WRKCo, Inc. (b)	
USD 890,000	3.00% due 2033/6/15	968,137
	Yale-New Haven Health Services Corp. (b)	
USD 1,000,000	2.50% due 2050/7/1	977,385
	Zayo Group Holdings, Inc. (a),(b)	
USD 400,000	4.00% due 2027/3/1	393,690
	Zimmer Biomet Holdings, Inc. (b)	
USD 460,000	3.55% due 2030/3/20	515,066
	社債合計	124,154,968
	国債 (16.1%)	
	Federal Farm Credit Banks Funding Corp.	
USD 1,400,000	2.70% due 2045/1/30	1,592,956
USD 100,000	2.88% due 2040/10/1	116,084
	Federal Home Loan Mortgage Corp. (e)	
USD 1,500,000	0.00% due 2036/9/15	1,135,814
USD 250,000	0.00% due 2038/11/15	180,218
	FNMA Pool	
USD 1,000,000	2.00% due 2050/9/1	1,012,690
USD 1,000,000	2.32% due 2035/4/1	1,087,476
USD 2,000,000	2.43% due 2035/3/1	2,203,228
USD 360,241	2.56% due 2029/7/1	398,844
USD 1,750,000	2.90% due 2029/11/1	1,937,711

USD 500,000	2.99% due 2029/9/1	557,142
USD 500,000	3.01% due 2027/12/1	546,392
USD 500,000	3.05% due 2029/10/1	552,906
USD 500,000	3.11% due 2029/10/1	555,828
USD 906,754	3.19% due 2032/9/1	1,019,831
USD 1,666,838	3.24% due 2032/11/1	1,901,677
USD 1,775,000	3.59% due 2029/2/1	2,023,629
USD 1,500,000	3.60% due 2031/3/1	1,757,575
USD 500,000	3.89% due 2031/6/1	575,130
USD 728,268	3.99% due 2033/9/1	846,122
USD 200,000	4.04% due 2048/7/1	238,997
USD 2,000,000	4.17% due 2049/2/1	2,516,265
USD 974,261	4.27% due 2033/12/1	1,184,440
USD 690,596	4.27% due 2048/9/1	837,595
	FNMA Principal Strip (e),(f)	
USD 4,500,000	0.00% due 2037/7/15	3,352,280
	Tennessee Valley Authority	
USD 1,100,000	4.25% due 2065/9/15	1,673,313
USD 250,000	5.38% due 2056/4/1	427,784
	Tennessee Valley Authority Principal Strip (e)	
USD 450,000	0.00% due 2048/1/15	235,737
	U.S. Treasury Bond	
USD 3,000,000	1.38% due 2050/8/15	2,944,219
	U.S. Treasury Note	
USD 10,000,000	0.25% due 2025/8/31	9,992,187
USD 2,805,000	0.63% due 2030/8/15	2,790,975
	U.S. Treasury Strip Principal (e)	
USD 12,000,000	0.00% due 2050/2/15	7,711,349
	United States International Development Finance Corp.	
USD 500,000	1.79% due 2029/10/15	527,408
	国債合計	54,433,802
	地方債 (1.7%)	
	Cypress School District (e)	
USD 1,000,000	0.00% due 2048/8/1	396,480
	Dallas/Fort Worth International Airport	
USD 1,000,000	2.92% due 2050/11/1	994,820
	Oklahoma Development Finance Authority	
USD 350,000	4.65% due 2030/8/15	407,271
	San Diego Unified School District	
USD 1,200,000	0.00% due 2042/7/1 (e)	708,144
USD 250,000	2.60% due 2033/7/1	263,965
	San Dieguito Union High School District (b)	
USD 250,000	2.68% due 2036/8/1	261,630
	State of California	
USD 150,000	7.35% due 2039/11/1	247,863
USD 200,000	7.55% due 2039/4/1	349,924
	State of New York Mortgage Agency (b)	
USD 200,000	3.85% due 2044/10/1	208,426
	Westchester County Local Development Corp. (b)	
USD 500,000	3.85% due 2050/11/1	502,795
	Wylie Independent School District (b),(e)	
USD 3,000,000	0.00% due 2043/8/15	1,362,870
	地方債合計	5,704,188
	TBA証券 (6.6%)	
	Fannie Mae or Freddie Mac	
USD 2,350,000	1.50% due 2035/10/1	2,404,527
USD 19,310,000	2.00% due 2050/12/1	19,895,036
	TBA証券合計	299,563
	米国合計 (簿価 \$280,118,529)	8,272,863
	債券合計 (簿価 \$348,463,411)	6,085,335
株数	優先株式 (0.9%)	
	米国 (0.9%)	

	American Financial Group, Inc. (b)							
48,000	4.50% due 2060/9/15							1,307,040
	First Republic Bank (b),(g)							
26,000	4.13%							660,400
	Public Storage (b),(g)							
5,600	4.13%							145,208
24,400	4.63%							656,848
	W R Berkley Corp. (b)							
6,800	4.25% due 2060/9/30							177,140
	米国合計 (簿価 \$2,770,000)							2,946,636
	優先株式合計 (簿価 \$2,770,000)							2,946,636
取引数	金利キャップオプション(0.3%)							
	米国 (0.3%)							
216,000,000	CMS Swap 2 Year, Put,0.395							784,080
	Expiration date 2022/7/29							
72,000,000	CMS Swap 2 Year, Put,0.605							174,240
	Expiration date 2022/7/29							
	米国合計							958,320
	金利キャップオプション合計 (支払プレミアム \$668,129)							958,320
元本	短期投資 (2.4%)							
	英国 (0.2%)							
	定期預金 (0.2%)							
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria							
GBP 399,500	0.01% due 2020/10/1							516,474
	定期預金合計							516,474
	英国合計 (簿価 \$516,474)							516,474
	米国 (2.2%)							
	定期預金 (2.2%)							
	Citibank, New York							
USD 7,548,859	0.01% due 2020/10/1							7,548,859
	定期預金合計							7,548,859
	米国合計 (簿価 \$7,548,859)							7,548,859
	短期投資合計 (簿価 \$8,065,333)							8,065,333
						純資産に 占める割合		
	投資総額 (簿価 \$359,966,873)					109.1	\$	368,055,624
	現金および他の資産を超過する負債					(9.1)		(30,613,406)
	純資産					100.0%	\$	337,442,218

*バンクローンは変動利付債務です。記載されているクーポンレートは期末時点のものです。

(a) 144A 証券 - 1933年証券取引法の規則144Aの下でSECへの登録の適用除外になっている証券。これらの証券は、適格機関投資家に対することで登録せずに転売が可能です。他に記載がない限り、これらの証券は非流動性資産とはみなされません。

(b) 期前償還条項付き証券

(c) 2020年9月30日時点レートでの変動金利証券

(d) 当該残高の全てもしくは一部が期末時点における未決済の貸出予約を表しています。未決済の貸出予約のクーポンレートを含む詳細について、受渡日前に入手することはできません。

(e) ゼロクーポン債

(f) 当該証券は、2020年9月30日時点において、買い現先取引のために、相手方へ全てもしくは一部を担保として差し入れられています。

(g) 永久債

ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンドの外国為替先渡取引 2020年9月30日現在 (純資産の0.2%)

買入	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
EUR	JP Morgan Chase N.A.	2,297,100	2021/7/30	USD	1,639,219	\$ 72,752	\$ (27,287)	\$ (27,287)
ILS	Goldman Sachs Group, Inc.	100,799	2020/11/30	USD	1,231,319	2,774	(21,070)	(21,070)
ILS	Goldman Sachs Group, Inc.	100,250	2021/11/30	USD	97,500	2,853	-	15

ILS	Goldman Sachs Group, Inc.	8,120,250	2022/11/30	USD	3,534,877	240,149	(1)	(1)
JPY	Goldman Sachs Group, Inc.	97,500	2020/11/2	USD	39,000	15	-	7
JPY	Morgan Stanley Capital Service	14,932	2020/11/2	USD	50,500	1	-	8
JPY	JP Morgan Chase N.A.	39,000	2020/12/1	USD	63,800,000	6	(101)	(101)
JPY	Morgan Stanley Capital Service	5,973	2020/12/1	USD	255,100,000	-	-	461
JPY	Barclays Bank PLC	50,500	2020/12/21	USD	88,000	4	-	4,880
JPY	Morgan Stanley Capital Service	7,734	2020/12/21	USD	90,000	1	-	4,974
JPY	Goldman Sachs Group, Inc.	247,704	2021/2/1	USD	459,000,000	17	-	31,351
JPY	Morgan Stanley Capital Service	44,796	2021/2/1	USD	37,590,000	3	(388,450)	(388,450)
JPY	Goldman Sachs Group, Inc.	195,097,500	2021/5/6	USD	195,000	25,724	-	44
JPY	Morgan Stanley Capital Service	14,932	2021/5/6	USD	97,500	-	-	17
JPY	JP Morgan Chase N.A.	78,039,000	2021/6/1	USD	3,534,877	9,670	-	-
JPY	Morgan Stanley Capital Service	5,973	2021/6/1	USD	1,456,000	-	-	57,809
JPY	Barclays Bank PLC	50,500	2021/6/21	USD	97,500	2	-	15
JPY	Morgan Stanley Capital Service	7,734	2021/6/21	USD	3,458,032	-	(4)	(4)
JPY	Goldman Sachs Group, Inc.	585,247,704	2021/8/2	USD	39,000	1,794	-	7
JPY	Morgan Stanley Capital Service	44,796	2021/8/2	USD	586,880	-	-	23,225
JPY	Barclays Bank PLC	101,050,500	2021/12/20	USD	503,040	1,116	-	20,211
JPY	Morgan Stanley Capital Service	7,734	2021/12/20	USD	50,500	-	-	8
USD	JP Morgan Chase N.A.	826,248	2020/10/16	GBP	17,100	-	-	395
USD	Citibank N.A.	941	2020/11/2	JPY	195,000	16	-	44
USD	JP Morgan Chase N.A.	139	2020/11/2	JPY	97,500	-	-	16
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	29,551	2020/11/30	ILS	3,534,877	55	(3)	(3)
USD	Barclays Bank PLC	378	2020/12/1	JPY	97,500	8	-	15
USD	JP Morgan Chase N.A.	56	2020/12/1	JPY	3,534,877	-	-	1
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	489	2020/12/21	JPY	39,000	9	-	7
USD	JP Morgan Chase N.A.	72	2020/12/21	JPY	50,500	-	-	8
USD	Bank of America N.A.	1,905	2021/2/1	JPY	195,000	54	-	44
USD	Morgan Stanley Capital Service	947	2021/2/1	JPY	97,500	21	-	17
USD	Citibank N.A.	1,902,648	2021/5/6	JPY	3,534,877	48,113	-	1
USD	JP Morgan Chase N.A.	140	2021/5/6	JPY	195,097,500	-	-	31,225
USD	Barclays Bank PLC	763,890	2021/6/1	JPY	3,419,609	21,803	-	-
USD	JP Morgan Chase N.A.	56	2021/6/1	JPY	78,039,000	-	-	14,200
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	494	2021/6/21	JPY	50,500	14	-	8
USD	JP Morgan Chase N.A.	73	2021/6/21	JPY	7,734	-	(1)	(1)
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	2,668,369	2021/7/30	EUR	2,297,100	-	(43,752)	(43,752)
USD	Bank of America N.A.	3,850,545	2021/8/2	JPY	390,195,000	136,565	-	136,565
USD	Morgan Stanley Capital Service	1,914,786	2021/8/2	JPY	195,097,500	57,796	-	57,796
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	29,923	2021/11/30	ILS	100,250	336	-	336
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	998,424	2021/12/20	JPY	101,050,500	34,097	-	34,097

USD	JP Morgan Chase N.A.	73	2021/12/20	JPY	7,734	-	(1)	(1)
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	2,462,921	2022/11/30	ILS	8,120,250	50,420	-	50,420
						\$ 706,188	\$ (56,598)	\$ 649,590

豪ドル・クラスの外国為替先渡取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
AUD	Citibank N.A.	12,645,998	2020/10/13	USD	9,204,849	\$ -	\$ (140,676)	\$ (140,676)

円ヘッジ・クラスの外国為替先渡取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
JPY	Citibank N.A.	3,160,919,369	2020/10/13	USD	29,776,501	\$ 179,877	\$ -	\$ 179,877

NZドル・クラスの外国為替先渡取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
NZD	Citibank N.A.	7,218,388	2020/10/13	USD	4,847,214	\$ -	\$ (75,830)	\$ (75,830)

トルコ・リラ・クラスの外国為替先渡取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の-0.1%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
TRY	Citibank N.A.	110,523,064	2020/10/13	USD	14,656,318	\$ -	\$ (340,915)	\$ (340,915)

南アフリカ・ランド・クラスの外国為替先渡取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.0%)

買い	取引相手	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	評価益(損)
ZAR	Citibank N.A.	80,251,592	2020/10/13	USD	4,826,309	\$ -	\$ (21,783)	\$ (21,783)

中央清算されるクレジット・デフォルト・インデックス・スワップ取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.1%)

通貨	取引相手	想定元本	プロテクション	参照対象	固定レート 受取(支払)	終了日	支払(受取) プレミアム	評価益(損)	評価額
USD	Citibank N.A.	20,150,000	Sell protection	Markit CDX North America	1.000%	2025/6/20	\$ (396,230)	\$ 549,745	\$ 153,515
USD	Goldman Sachs Group, Inc.	3,760,000	Sell protection	Markit CDX North America	5.000%	2025/12/20	161,000	1,784	162,784
							\$ (235,230)	\$ 551,529	\$ 316,299

中央清算される金利スワップ取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の0.0%)

通貨	取引相手	想定元本	変動金利	受取(支払)	終了日	支払(受取) プレミアム	評価益(損)	評価額
USD	BNP Paribas S.A.	3,000,000	1 Day Overnight Federal Funds Effective Rate	0.15%	2025/8/17	314	1,911	2,225
						\$ 314	\$ 1,911	\$ 2,225

店頭取引されるトータルリターンスワップ取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の-0.0%)

通貨	取引相手	想定元本	変動金利	受取(支払)	終了日	支払(受取) プレミアム	評価益(損)	評価額
USD	BNP Paribas S.A.	11,860	iShares IBOX High Yield Corp	0.46%	2020/10/30	\$ -	\$ (16,146)	\$ (16,146)
						\$ -	\$ (16,146)	\$ (16,146)

買い現先取引残高 2020年9月30日現在 (純資産の-0.5%)

取引相手	元本	通貨	利率	終了日	借入金額	未払 買い現先取引
Bank of Montreal	(1,486,005)	USD	0.23%	2020/11/16	\$ (1,486,005)	\$ (1,486,166)
					\$ (1,486,005)	\$ (1,486,166)

通貨の略称

AUD	-	豪ドル
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
ILS	-	イスラエル・シケル
JPY	-	日本円
NZD	-	ニュージーランド・ドル
TRY	-	トルコ・リラ
USD	-	米ドル
ZAR	-	南アフリカ・ランド

「ダイワ・マネーアセット・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

	2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	553,840,724	693,501,368
流動資産合計	553,840,724	693,501,368
資産合計	553,840,724	693,501,368
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 554,625,928	694,638,042
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2 785,204	1,136,674
元本等合計	553,840,724	693,501,368
純資産合計	553,840,724	693,501,368
負債純資産合計	553,840,724	693,501,368

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

自 2021年3月9日 至 2021年9月7日
該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首	2020年9月8日	2021年3月9日
期首元本額	568,765,403円	554,625,928円
期中追加設定元本額	1,079,626円	170,035,124円
期中一部解約元本額	15,219,101円	30,023,010円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり)	999円	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし)	999円	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (毎月分配型)	219,583円	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (年2回決算型)	24,953円	24,953円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(毎月分配型)	848,389円	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(年2回決算 型)	66,873円	66,873円
ダイワ米国株主還元株ファン ド	36,730,213円	36,730,213円
ダイワDBモメンタム戦略 ファンド(為替ヘッジあり)	6,592,748円	6,592,748円
ダイワDBモメンタム戦略 ファンド(為替ヘッジなし)	10,288,683円	10,288,683円
ダイワ/バリュー・パート ナーズ・チャイナ・イノベ ター・ファンド	10,000円	10,000円
世界M&A戦略株ファンド	1,001,302円	1,001,302円

	ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	4,995円	4,995円
	ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	4,995円	4,995円
	ダイワ・ブラジル・レアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 50 コース	49,911円	49,911円
	ダイワ・ブラジル・レアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 100 コース	49,911円	49,911円
	S&P500(マルチアイ搭載)	- 円	130,188,276円
	ダイワ・オーストラリア高配 当株ファンド・マネー・ポー トフォリオ	15,808,517円	15,808,517円
	ダイワ円債セレクト マネー コース	479,920,390円	489,744,228円
	ダイワ・スイス高配当株ツイ ン(毎月分配型)	2,996,106円	2,996,106円
	ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型)	1,235円	1,235円
	ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型)	1,598円	1,598円
	通貨選択型 ダイワ/NB・ 米国債券戦略ファンド 日本 円コース(毎月分配型)	1,544円	1,544円
	通貨選択型 ダイワ/NB・ 米国債券戦略ファンド 通貨 セレクトコース(毎月分配 型)	1,984円	1,984円
	計	554,625,928円	694,638,042円
2.	期末日における受益権の総数	554,625,928口	694,638,042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785,204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1,136,674円であります。
------------	---	---

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2021年3月9日 至 2021年9月7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、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。 これらの金融商品に係るリスクは、信用リスクであります。
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。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年9月7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	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)

2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(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

2021年3月8日現在	2021年9月7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)

	2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
1口当たり純資産額	0.9986円	0.9984円
(1万口当たり純資産額)	(9,986円)	(9,984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

該当事項はありません。

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。

【ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)】

(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12期計算期間(2021年3月9日から2021年9月7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】

ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,563,499	16,328,508
投資信託受益証券	533,978,136	542,713,330
親投資信託受益証券	997	997
流動資産合計	547,542,632	559,042,835
資産合計	547,542,632	559,042,835
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,794,765	5,476,550
未払解約金	96	-
未払受託者報酬	75,646	75,261
未払委託者報酬	3,330,784	3,313,143
その他未払費用	22,626	22,500
流動負債合計	6,223,917	8,887,454
負債合計	6,223,917	8,887,454
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 558,953,045	¹ 547,655,083
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	² 17,634,330	² 2,500,298
(分配準備積立金)	11,313,668	30,156,907
元本等合計	541,318,715	550,155,381
純資産合計	541,318,715	550,155,381
負債純資産合計	547,542,632	559,042,835

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第11期 自 2020年9月8日 至 2021年3月8日	第12期 自 2021年3月9日 至 2021年9月7日
営業収益		
受取配当金	6,233,218	6,245,590
受取利息	41	45
有価証券売買等損益	1,026,715	22,489,604
営業収益合計	7,259,974	28,735,239
営業費用		
支払利息	2,177	1,998
受託者報酬	75,646	75,261
委託者報酬	3,330,784	3,313,143
その他費用	22,626	22,520
営業費用合計	3,431,233	3,412,922
営業利益	3,828,741	25,322,317
経常利益	3,828,741	25,322,317
当期純利益	3,828,741	25,322,317
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()	334,681	545,142
期首剰余金又は期首欠損金()	20,333,996	17,634,330
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,137,727	834,003
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,137,727	713,280
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	120,723
剰余金減少額又は欠損金増加額	806,718	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	806,718	-
分配金	1 2,794,765	1 5,476,550
期末剰余金又は期末欠損金()	17,634,330	2,500,298

(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12期	
	自 2021年3月9日	至 2021年9月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>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な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間末日</p> <p>2021年3月7日が休日のため、前計算期間末日を2021年3月8日としております。このため、当計算期間は183日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第11期	第12期
	2021年3月8日現在	2021年9月7日現在
1. 1 期首元本額	601,684,369円	558,953,045円
期中追加設定元本額	20,471,739円	11,374,256円
期中一部解約元本額	63,203,063円	22,672,218円

2.	計算期間末日における受益権の総数	558,953,045口	547,655,083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17,634,330円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第11期	第12期
	自 2020年9月8日 至 2021年3月8日	自 2021年3月9日 至 2021年9月7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(3,396,779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(766,643円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,169,373円)及び分配準備積立金(9,945,011円)より分配対象額は18,277,806円(1万口当たり327.00円)であり、うち2,794,765円(1万口当たり50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(5,477,160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(19,300,015円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,314,983円)及び分配準備積立金(10,856,282円)より分配対象額は39,948,440円(1万口当たり729.45円)であり、うち5,476,550円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第12期
	自 2021年3月9日 至 2021年9月7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	<p>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、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第12期 2021年9月7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	<p>(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。</p> <p>(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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7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）
投資信託受益証券	1,258,351	21,774,789
親投資信託受益証券	0	0
合計	1,258,351	21,774,789

（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11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7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12期 自 2021年3月9日 至 2021年9月7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11期 2021年3月8日現在	第12期 2021年9月7日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9685円 (9,685円)	1.0046円 (10,046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
投資信託受益証券	DAIWA CORE BOND STRATEGY FUND - THE JPY NON-HEDGED CLASS UNIT	5,350,408.450	542,713,330	
投資信託受益証券 合計			542,713,330	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	999	997	
親投資信託受益証券 合計			997	
合計			542,714,327	

投資信託受益証券及び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、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」の受益証券（円建）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「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・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、同ファンドの状況及び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・ディスカバリー・ファンド・シリーズ - ダイワ・コア・ボンド・ストラテジー・ファンド（ノンヘッジ・クラス）」の状況

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）」に記載のとおりであります。

2【ファンドの現況】

ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)

【純資産額計算書】

2021年9月30日

資産総額	2,566,272,235円
負債総額	7,136,123円
純資産総額(-)	2,559,136,112円
発行済数量	2,484,538,363口
1単位当たり純資産額(/)	1.0300円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

純資産額計算書

2021年9月30日

資産総額	693,483,591円
負債総額	0円
純資産総額(-)	693,483,591円
発行済数量	694,633,534口
1単位当たり純資産額(/)	0.9983円

ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジなし)

純資産額計算書

2021年9月30日

資産総額	557,007,271円
負債総額	433,662円
純資産総額(-)	556,573,609円
発行済数量	548,643,190口
1単位当たり純資産額(/)	1.0145円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「ダイワ債券コア戦略ファンド(為替ヘッジあり)」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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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る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。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(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、）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簿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

2021年9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年間に於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

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、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せん。

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. 商品会議

ファンド設立時に経営会議の分科会である商品会議を開催し、ファンドの新規設定を決定します。

ロ. 商品担当役員

商品担当役員は、ファンド設立の趣旨に沿って、各ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を決定します。

ハ. 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。

ニ. 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。

ホ. 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。

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。

2021年9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	53	143,674
追加型株式投資信託	762	21,577,322
株式投資信託 合計	815	21,720,997
単位型公社債投資信託	73	207,569
追加型公社債投資信託	14	1,521,540
公社債投資信託 合計	87	1,729,109
総合計	902	23,450,106

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。
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、当事業年度（2020年4月1日から2021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。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	2,741	4,860
有価証券	22,167	333
前払費用	205	237
未収委託者報酬	10,847	13,150
未収収益	63	49
関係会社短期貸付金	-	18,700
その他	62	207
流動資産計	36,088	37,539
固定資産		
有形固定資産	1	224
建物	7	6
器具備品	209	218
無形固定資産	2,362	1,937
ソフトウェア	2,028	1,882
ソフトウェア仮勘定	333	54
投資その他の資産	15,844	16,121
投資有価証券	9,153	10,159
関係会社株式	3,972	3,705
出資金	183	183
長期差入保証金	1,069	1,068

繰延税金資産	1,431	973
その他	33	30
固定資産計	18,424	18,283
資産合計	54,512	55,822

(単位:百万円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	69	68
未払金	7,573	8,405
未払収益分配金	14	13
未払償還金	39	39
未払手数料	3,988	4,734
その他未払金	2,3,530	2,3,617
未払費用	3,830	3,777
未払法人税等	656	804
未払消費税等	590	631
賞与引当金	688	950
その他	5	88
流動負債計	13,414	14,725
固定負債		
退職給付引当金	2,574	2,452
役員退職慰労引当金	88	74
その他	5	3
固定負債計	2,667	2,530
負債合計	16,082	17,256
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	11,749	10,574

利益剰余金合計	12,123	10,948
株主資本合計	38,793	37,618
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	363	947
評価・換算差額等合計	363	947
純資産合計	38,430	38,566
負債・純資産合計	54,512	55,822

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	69,550	65,487
その他営業収益	583	419
営業収益計	70,134	65,906
営業費用		
支払手数料	31,120	27,965
広告宣伝費	745	624
調査費	8,858	8,245
調査費	1,188	1,134
委託調査費	7,670	7,110
委託計算費	1,410	1,501
営業雑経費	1,770	1,870
通信費	240	240
印刷費	524	478
協会費	56	51
諸会費	13	14
その他営業雑経費	936	1,084
営業費用計	43,906	40,207
一般管理費		
給料	5,793	5,991
役員報酬	374	351
給料・手当	4,335	4,293
賞与	395	395
賞与引当金繰入額	688	950
福利厚生費	838	893
交際費	62	32
旅費交通費	154	37

租税公課	451	472
不動産賃借料	1,299	1,302
退職給付費用	368	449
役員退職慰労引当金繰入額	37	28
固定資産減価償却費	925	661
諸経費	1,770	1,763
一般管理費計	11,702	11,631
営業利益	14,525	14,067

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31 日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	214	578
有価証券償還益	24	42
その他	991	68
営業外収益計	1,230	689
営業外費用		
投資有価証券売却損	1	69
有価証券償還損	71	47
その他	54	24
営業外費用計	127	141
経常利益	15,629	14,616
特別損失		
システム刷新関連費用	537	547
関係会社整理損失	-	267
投資有価証券評価損	48	45
特別損失計	585	860
税引前当期純利益	15,043	13,756
法人税、住民税及び事業税	4,555	4,476
法人税等調整額	78	109
法人税等合計	4,477	4,366
当期純利益	10,566	9,389

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	13,052	13,426	40,096
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,868	11,868	11,868
当期純利益	-	-	-	10,566	10,566	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,302	1,302	1,302
当期末残高	15,174	11,495	374	11,749	12,123	38,793

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	410	410	410
当期変動額合計	410	410	410
当期末残高	363	363	38,430

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	11,749	12,123	38,793

当期変動額						
残余金の配当	-	-	-	10,564	10,564	10,564
当期純利益	-	-	-	9,389	9,389	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,175	1,175	1,175
当期末残高	15,174	11,495	374	10,574	10,948	37,618

	評価・換算差額等		純資産合計
	其他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	363	363	38,430
当期変動額			
残余金の配当	-	-	10,564
当期純利益	-	-	9,389
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	1,311	1,311	1,311
当期変動額合計	1,311	1,311	136
当期末残高	947	947	38,566

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）其他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

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。

市場価格のない株式等

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・参与及び上席参事についても、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。

6．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「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 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

（追加情報）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。この結果、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。ただし、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2019年7月4日）第7 - 4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載していません。

（重要な会計上の見積り）

該当事項はありません。

（未適用の会計基準等）

収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018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 2018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

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準の適用による影響は軽微であります。

（表示方法の変更）

（損益計算書関係）

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」912百万円、「その他」78百万円は、「その他」991百万円として組替えております。

（注記に関する表示方法の変更）

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日。以下「見積り会計基準」という）が公表日以後終了する事業年度における年度末に係る財務諸表から適用できることになったことに伴い、当事業年度末から適用し、（重要な会計上の見積り）を開示しております。

見積り会計基準の適用については、見積り会計基準第11項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、会計基準第6項及び第7項に定める注記事項について、前事業年度における財務諸表に関する注記を省略しております。

（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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	34百万円	35百万円
器具備品	276百万円	259百万円

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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
未払金	3,397百万円	3,473百万円

3 保証債務

前事業年度（2020年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2021年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,727百万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 2019年4月1日 至 2020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
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

(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

2020年6月23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。

剰余金の配当の総額	10,564百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,050円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月24日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月23日 定時株主総会	普通株式	10,564	4,050	2020年 3月31日	2020年 6月24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

2021年6月22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。

剰余金の配当の総額	9,388百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,599円
基準日	2021年3月31日
効力発生日	2021年6月23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、子会社株式並びに関連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、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。関係会社短期貸付金は、親会社に対して貸付を行っているものであります。

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係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

市場リスクの管理

() 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。

() 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。

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. 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額並びにレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、企業会計基準適用指針第31号「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下、「時価算定適用指針」という。)第26項に従い経過措置を適用した有価証券、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

前事業年度(2020年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表	計上額	時価	差額
投資有価証券(1)		60	60	-
資産合計		60	60	-

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券267百万円、投資有価証券8,426百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、コマーシャル・ペーパー、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

当事業年度(2021年3月31日)

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券(1)	85	-	-	85
資産合計	85	-	-	85

(1) 時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、有価証券333百万円、投資有価証券9,406百万円は上記の表に含めておりません。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間(1年以内)で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

投資有価証券

株式は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。なお、時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用している有価証券は、公表されている基準価額によっていることからレベルを付しておりません。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。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであり、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中の投資有価証券には含めておりません。

(単位：百万円)

区分	前事業年度	当事業年度
非上場株式等	666	666
子会社株式	1,944	1,677
関連会社株式	2,027	2,027

(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(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,944百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,677百万円)及び関連会社株式(貸借対照表計上額 2,027百万円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(2020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	60	55	5
(2) その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	764
小計	27,589	28,354	764
合計	30,654	31,181	526

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、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(2021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	85	55	30
(2) その他	7,179	5,697	1,481
小計	7,265	5,752	1,512
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	2,561	2,721	160
小計	2,561	2,721	160
合計	9,826	8,474	1,352

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)については、市場価格がないことから、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 2019年4月1日 至 2020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	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	5,353	578	69
合計	5,353	578	69

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、関係会社株式について267百万円、証券投資信託について45百万円の減損処理を行っております。

(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いません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,389百万円	2,574百万円
勤務費用	159	155
退職給付の支払額	183	378
その他	207	101
退職給付債務の期末残高	2,574	2,452

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,574百万円	2,452百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452
退職給付引当金	2,574	2,452
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,574	2,452

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	159百万円	155百万円
その他	27	108
確定給付制度に係る退職給付費用	187	263

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181百万円、当事業年度186百万円であります。

(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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	788	750
賞与引当金	177	243
未払事業税	129	170
システム関連費用	198	155
投資有価証券評価損	47	128
出資金評価損	94	94
その他	399	298
繰延税金資産小計	1,835	1,841
評価性引当額	173	254
繰延税金資産合計	1,661	1,586
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	71	453
繰延税金負債合計	230	612
繰延税金資産の純額	1,431	973

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（2020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（2021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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

（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、記載を省略していません。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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親会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	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 (%)	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				
親会社	㈱大和証券グループ本社	東京都千代田区	247,397	証券持株会社業	被所有 100.0	あり	経営管理	資金の貸付 利息の受取 (注)	19,300 0	関係会社短期貸付金 -	18,700 -

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) 貸付利息については市場金利を勘案して合理的に決定し、返済期間は1年以内としております。なお、担保は受け入れておりません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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)	1,603	-	-

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 2020年4月1日 至 2021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)	1,727	-	-

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。

(ウ) 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 2019年4月1日 至 2020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)	16,953	未払手数料	2,984
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)	1,031	未払費用	224
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)	1,061	長期差入保証金	1,054

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せん。

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	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)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	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 本社ビルの管理	証券投資信託の代行手数料(注2) 不動産の賃借料(注4)	14,917 527	未払手数料 長期差入保証金	3,321 1,054
同一の親会社をもつ会社	(株)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)	883	未払費用	179
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	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)	527	-	-

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せん。

(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。

(注5)大和プロパティ株式会社は、2020年10月1日付で大和証券株式会社を存続会社とする吸収合併により消滅しております。このため、取引金額は関連当事者であった期間の金額を記載しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,732.52円	1株当たり純資産額	14,784.79円
1株当たり当期純利益	4,050.66円	1株当たり当期純利益	3,599.54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いません。

(注2)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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,556	9,389
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。

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。

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。）。

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。）。

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。

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。

上記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

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

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】

	名 称	資本金の額 (2021年03月末日現在)	事業の内容	備考
受託会社	みずほ信託銀行株式会社	247,369百万円	(注6)	
再信託受託会社	株式会社日本カスト ディ銀行	51,000百万円	(注6)	
販売会社	大和証券株式会社	100,000百万円	(注1)	

(注1) 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。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

(注4) 全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。

(注5) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

(注6) 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。

(注7) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注8) 保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

(注9) 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。

(注10) 全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余裕資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

(注11) 労働金庫連合会は、労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。

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いません。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。

再信託受託会社は、受託会社と再信託契約を締結し、信託事務の一部（信託財産の管理等）を行いません。

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いません。

3【資本関係】

該当事項はありません。

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)
2021年6月1日	有価証券報告書、有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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**監査意見**

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アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第62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。

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、大和アセットマネジメント株式会社の2021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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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

2021年10月8日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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 竹内 知明 印**監査意見**

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債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）の2021年3月9日から2021年9月7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。

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、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジあり）の2021年9月7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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント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

2021年10月8日

大和アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

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 竹内 知明 印**監査意見**

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債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）の2021年3月9日から2021年9月7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。

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、ダイワ債券コア戦略ファンド（為替ヘッジなし）の2021年9月7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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、大和アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

大和アセットマネジメント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。