

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第22期(決算日 2021年3月9日)

第23期(決算日 2021年6月9日)

(作成対象期間 2020年12月10日～2021年6月9日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／その他資産（ハイブリッド証券）		
信 託 期 間	約9年9カ月間（2015年8月27日～2025年6月9日）		
運 用 方 針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベ ビ ー フ ァ ン ド	ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンドの受益証券	
	ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド	世界の事業会社が発行するハイブリッド証券（劣後債および優先証券）	
組 入 制 限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分 配 方 針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、経費控除後の配当等収益等を中心に分配することをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、世界のハイブリッド証券等に投資し、高利回りの獲得を追求することにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近10期の運用実績

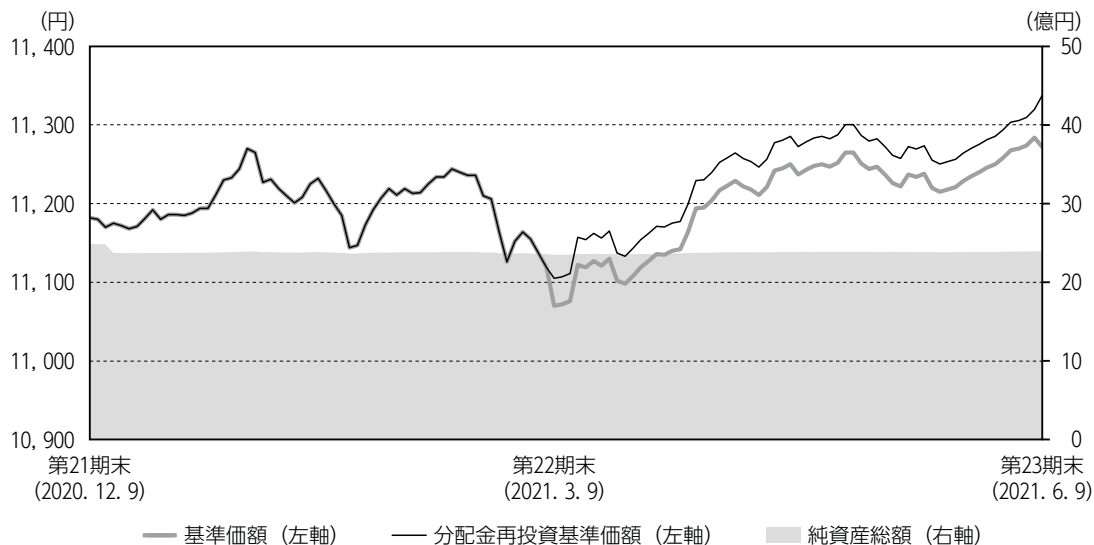
決 算 期	基 準 価 額				公 社 債 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分 配 落)	税 込 分	込 配 金	期 騰 落 中 率		
	円		円	%	%	百万円
14期末（2019年3月11日）	10,371		50	3.8	95.0	4,894
15期末（2019年6月10日）	10,565		50	2.4	93.3	4,459
16期末（2019年9月9日）	10,925		40	3.8	91.2	4,611
17期末（2019年12月9日）	10,961		35	0.6	91.3	4,626
18期末（2020年3月9日）	10,868		25	△ 0.6	90.8	2,414
19期末（2020年6月9日）	10,693		70	△ 1.0	94.4	2,376
20期末（2020年9月9日）	10,841		40	1.8	94.8	2,408
21期末（2020年12月9日）	11,182		35	3.5	96.9	2,484
22期末（2021年3月9日）	11,070		35	△ 0.7	97.4	2,349
23期末（2021年6月9日）	11,272		30	2.1	92.2	2,391

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注3) 公社債組入比率はハイブリッド証券（劣後債、優先証券）を含みます。
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。
(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

基準価額・騰落率

第22期首：11,182円

第23期末：11,272円（既払分配金65円）

騰落率：1.4%（分配金再投資ベース）

基準価額の主な変動要因

コーポレート・ハイブリッド証券市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）

	年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
			騰 落 率	
第22期		円	%	%
	(期 首) 2020年12月 9 日	11, 182	—	96. 9
	12月末	11, 194	0. 1	97. 2
	2021年 1 月末	11, 147	△ 0. 3	97. 2
	2 月末	11, 164	△ 0. 2	98. 8
第23期	(期 末) 2021年 3 月 9 日	11, 105	△ 0. 7	97. 4
	(期 首) 2021年 3 月 9 日	11, 070	—	97. 4
	3 月末	11, 142	0. 7	98. 0
	4 月末	11, 265	1. 8	98. 3
	5 月末	11, 246	1. 6	93. 0
	(期 末) 2021年 6 月 9 日	11, 302	2. 1	92. 2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020. 12. 10 ～ 2021. 6. 9）

■コーポレート・ハイブリッド証券市況

コーポレート・ハイブリッド証券市場は上昇しました。

コーポレート・ハイブリッド証券市場は、英国とEU（欧州連合）の通商交渉合意などを背景に、当作成期首より堅調な立ち上がりとなりました。2021年に入ると、米国での追加経済対策期待などが相場の支援材料となる一方で、欧州地域でのロックダウン（都市封鎖）実施による経済への影響などが不安視され、3月中旬ごろまで一進一退の推移が続きました。当作成期末にかけては、経済指標の改善や新型コロナウイルスのワクチン接種の進展、経済活動正常化への期待の高まりなどを背景に、コーポレート・ハイブリッド証券市場は上昇し、クレジット・スプレッド（国債との利回り格差）は縮小しました。また、世界各国の中央銀行による緩和的な金融政策も相場の支援材料となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド」の受益証券に投資を行い、組入比率は高位を維持します。また、為替変動リスク低減のため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

引き続き、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・UK・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

ポートフォリオについて

（2020. 12. 10 ～ 2021. 6. 9）

■当ファンド

「ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持しました。また、為替変動リスクの低減のため、為替ヘッジを行いました。

■ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

主として、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行いました。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・ＵＫ・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

分配金について

当作成期の１万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（１万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。
収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（１万口当り）」をご参照ください。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項 目	第22期	第23期
	2020年12月10日 ～2021年３月９日	2021年３月10日 ～2021年６月９日
当期分配金(税込み) (円)	35	30
対基準価額比率 (%)	0.32	0.27
当期の収益 (円)	35	30
当期の収益以外 (円)	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,462	1,533

(注１) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
(注２) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
(注３) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	第22期	第23期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 86.17円	✓ 101.55円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00	0.00
(c) 収益調整金	139.87	139.87
(d) 分配準備積立金	1,271.36	1,322.53
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,497.41	1,563.97
(f) 分配金	35.00	30.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,462.41	1,533.97

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド」の受益証券に投資を行い、組入比率は高位を維持します。また、為替変動リスクの低減のため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

引き続き、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・UK・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

1 万口当りの費用の明細

項 目	第22期～第23期 (2020. 12. 10～2021. 6. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	52円	0. 460%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11, 201円です。
(投 信 会 社)	(39)	(0. 346)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 096)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0. 019)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 011	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0. 007)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0. 471	

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

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

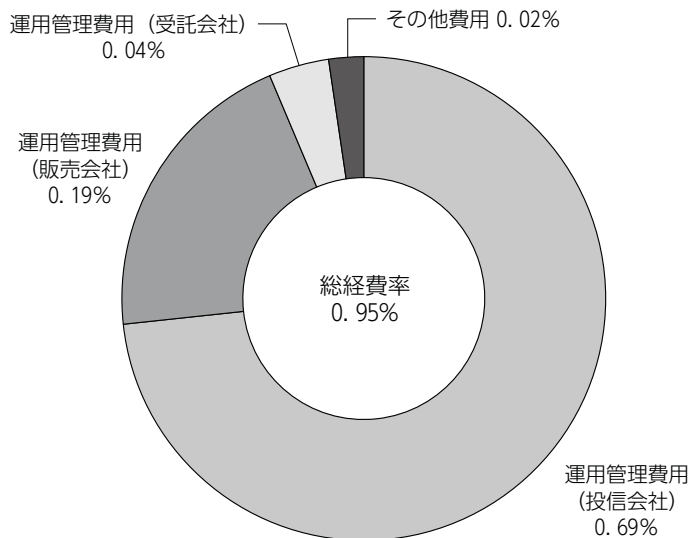
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.95%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年12月10日から2021年 6 月 9 日まで)

決 算 期	第 22 期 ～ 第 23 期			
	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド	—	—	231,746	276,000

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	第 21 期 末	第 23 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド	2,123,449	1,891,703	2,372,006

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年 6 月 9 日現在

項 目	第 23 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド	2,372,006	98.5
コール・ローン等、その他	36,887	1.5
投資信託財産総額	2,408,893	100.0

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.46円、1イギリス・ポンド＝154.94円、1スウェーデン・クローネ＝13.24円、1ユーロ＝133.26円です。

(注 3) ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンドにおいて、第23期末における外貨建純資産(2,362,486千円)の投資信託財産総額(2,372,021千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年 3 月 9 日)、(2021年 6 月 9 日) 現在

項 目	第22期末	第23期末
(A) 資産	4,708,731,116円	4,751,977,825円
コール・ローン等	76,649,911	36,639,992
ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド（評価額）	2,352,562,919	2,372,006,481
未収入金	2,279,518,286	2,343,331,352
(B) 負債	2,359,674,155	2,360,110,488
未払金	2,346,769,825	2,348,107,907
未払収益分配金	7,427,031	6,366,026
未払信託報酬	5,428,876	5,538,721
その他未払費用	48,423	97,834
(C) 純資産総額（A－B）	2,349,056,961	2,391,867,337
元本	2,122,008,961	2,122,008,961
次期繰越損益金	227,048,000	269,858,376
(D) 受益権総口数	2,122,008,961口	2,122,008,961口
1万口当り基準価額（C/D）	11,070円	11,272円

*第21期末における元本額は2,222,008,961円、当作成期間（第22期～第23期）中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は100,000,000円です。

*第23期末の計算口数当りの純資産額は11,272円です。

■損益の状況

	第22期	第23期
	自2020年12月10日	自2021年 3 月 9 日
	自2021年 3 月10日	自2021年 6 月 9 日
項 目	第22期	第23期
(A)配当等収益	△ 1,829円	△ 1,420円
受取利息	9	—
支払利息	△ 1,838	△ 1,420
(B)有価証券売買損益	△ 10,828,348	54,765,965
売買益	125,099,094	169,590,546
売買損	△ 135,927,442	△ 114,824,581
(C)信託報酬等	△ 5,477,299	△ 5,588,143
(D)当期損益金 (A + B + C)	△ 16,307,476	49,176,402
(E)前期繰越損益金	251,439,746	227,705,239
(F)追加信託差損益金	△ 657,239	△ 657,239
(配当等相当額)	(29,681,934)	(29,681,934)
(売買損益相当額)	(△ 30,339,173)	(△ 30,339,173)
(G)合計 (D + E + F)	234,475,031	276,224,402
(H)収益分配金	△ 7,427,031	△ 6,366,026
次期繰越損益金 (G + H)	227,048,000	269,858,376
追加信託差損益金	△ 657,239	△ 657,239
(配当等相当額)	(29,681,934)	(29,681,934)
(売買損益相当額)	(△ 30,339,173)	(△ 30,339,173)
分配準備積立金	280,644,005	295,828,024
繰越損益金	△ 52,938,766	△ 25,312,409

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

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

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

(注 4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：4,509,266円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第22期	第23期
(a) 経費控除後の配当等収益	18,287,009円	21,550,045円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0	0
(c) 収益調整金	29,681,934	29,681,934
(d) 分配準備積立金	269,784,027	280,644,005
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	317,752,970	331,875,984
(f) 分配金	7,427,031	6,366,026
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	310,325,939	325,509,958
(h) 受益権総口数	2,122,008,961口	2,122,008,961口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ		
1 万 口 当 り 分 配 金	第 22 期	第 23 期
	35円	30円

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

・ 分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
・ 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
・ 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
・ 元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

運用報告書 第6期（決算日 2021年6月9日）

（作成対象期間 2020年6月10日～2021年6月9日）

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

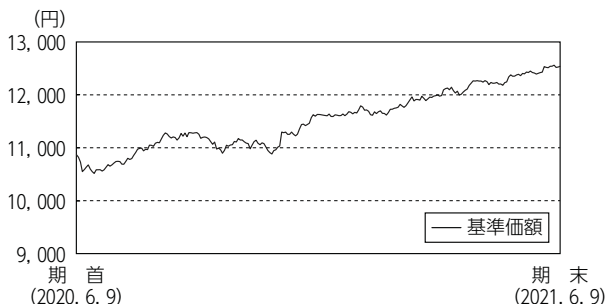
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	世界の事業会社が発行するハイブリッド証券（劣後債および優先証券）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	
	円	%	%
(期 首) 2020年 6 月 9 日	10, 870	—	94. 7
6 月末	10, 632	△ 2. 2	94. 4
7 月末	10, 965	0. 9	94. 4
8 月末	11, 210	3. 1	96. 1
9 月末	11, 048	1. 6	94. 8
10 月末	10, 908	0. 3	96. 5
11 月末	11, 440	5. 2	90. 9
12 月末	11, 671	7. 4	97. 1
2021年 1 月末	11, 663	7. 3	97. 3
2 月末	11, 935	9. 8	97. 7
3 月末	12, 179	12. 0	98. 1
4 月末	12, 379	13. 9	97. 8
5 月末	12, 519	15. 2	93. 1
(期 末) 2021年 6 月 9 日	12, 539	15. 4	93. 0

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) 公社債組入比率はハイブリッド証券（劣後債、優先証券）を含みます。

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

(注 4) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,870円 期末：12,539円 騰落率：15.4%

【基準価額の主な変動要因】

コーポレート・ハイブリッド証券市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○コーポレート・ハイブリッド証券市況

コーポレート・ハイブリッド証券市場は、当作成期を通じておおむね堅調に推移し、クレジット・スプレッド（国債との利回り格差）は縮小しました。

当作成期においては、新型コロナウイルスの感染再拡大およびそれに伴う経済活動の停滞、英国とEU（欧州連合）の通商交渉の難航、米国大統領選挙結果に対する不確実性の高まりなどから調整する局面も見られましたが、ワクチンの開発および接種の進展や経済活動正常化への期待の高まり、世界各国の中央銀行による緩和的な金融政策などがコーポレート・ハイブリッド証券市場を支えました。

○為替相場

ユーロ円相場は上昇（円安）しました。

ユーロ円為替相場は、欧州地域における新型コロナウイルスのワクチン接種の進展および経済活動正常化への期待の高まり、経済指標の改善、英国とEU（欧州連合）の通商交渉合意などを背景に、対円で堅調に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

引き続き、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・UK・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

◆ポートフォリオについて

主として、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行いました。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・UK・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

引き続き、世界の事業会社が発行するハイブリッド証券等に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・UK・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	1 (1)
(その他)	(0)
合 計	1

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2020年 6 月10日から2021年 6 月 9 日まで)

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	社債券	千アメリカ・ドル 956	千アメリカ・ドル 1, 073 (—)
	イギリス	社債券	千イギリス・ポンド —	千イギリス・ポンド 210 (—)

			買 付 額	売 付 額
外 国	ユーロ (オランダ)	社債券	千ユーロ 2, 523	千ユーロ 2, 664 (—)
	ユーロ (フランス)	社債券	千ユーロ 912	千ユーロ 2, 812 (—)
	ユーロ (ドイツ)	社債券	千ユーロ —	千ユーロ 806 (—)
	ユーロ (イタリア)	社債券	千ユーロ 801	千ユーロ — (—)
	ユーロ (その他)	社債券	千ユーロ 941	千ユーロ 702 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	社債券	千ユーロ 5, 179	千ユーロ 6, 985 (—)

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 社債券には新株予約権付社債券 (転換社債券) は含まれておりません。

(注 4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年 6 月10日から2021年 6 月 9 日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Volkswagen International Finance NV (オランダ) - floating - 永久債	170, 690	Volkswagen International Finance NV (オランダ) - floating - 永久債	168, 197
BP Capital Markets PLC (イギリス) - floating - 永久債	116, 781	Gas Natural Fenosa Finance BV (オランダ) - floating - 永久債	131, 618
Koninklijke FrieslandCampina NV (オランダ) - floating - 永久債	98, 444	Engie (フランス) - floating - 永久債	127, 599
Eni SpA (イタリア) - floating - 永久債	97, 907	Orange SA (フランス) - floating - 永久債	125, 736
Engie SA (フランス) - floating - 永久債	66, 350	SSE PLC (イギリス) - floating - 2077/9/16	117, 872
Scentre Group Trust 2 (オーストラリア) - floating - 2080/9/24	52, 169	Bertelsmann SE & Co KGaA (ドイツ) - floating - 2075/4/23	98, 493
Arkema SA (フランス) - floating - 永久債	50, 584	AMERICA MOVIL SA de CV (メキシコ) - floating - 2073/9/6	90, 989
ViacomCBS Inc (アメリカ) - floating - 2057/2/28	47, 907	Suez Environnement Co (フランス) - floating - 永久債	70, 535
Volkswagen International Finance NV (オランダ) - floating - 永久債	40, 655	Orange SA (フランス) - floating - 永久債	32, 087
		Volkswagen International Finance NV (オランダ) - floating - 永久債	30, 142

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期	当 期					末		
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 5,342	千アメリカ・ドル 5,773	千円 631,976	% 26.6	% —	% 26.6	% —	% —
イギリス	千イギリス・ポンド 1,062	千イギリス・ポンド 1,189	184,265	7.8	—	7.8	—	—
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 3,097	千ユーロ 3,382	450,729	19.0	—	19.0	—	—
ユーロ (ルクセンブルク)	千ユーロ 1,314	千ユーロ 1,363	181,727	7.7	—	7.7	—	—
ユーロ (フランス)	千ユーロ 2,400	千ユーロ 2,537	338,183	14.3	—	14.3	—	—
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 1,000	千ユーロ 1,018	135,677	5.7	—	5.7	—	—
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 800	千ユーロ 848	113,107	4.8	—	4.8	—	—
ユーロ (その他)	千ユーロ 1,189	千ユーロ 1,276	170,045	7.2	—	7.2	—	—
ユーロ (小計)	千ユーロ 9,800	千ユーロ 10,426	1,389,471	58.6	—	58.6	—	—
合 計	—	—	2,205,713	93.0	—	93.0	—	—

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

			当 期		末			
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ		Enel SpA	社債券	8.7500	千アメリカ・ドル 904	千アメリカ・ドル 1,054	千円 115,399	2073/09/24
		Enbridge Inc	社債券	6.2500	1,286	1,406	153,980	2078/03/01
		Transcanada Trust	社債券	5.3000	1,007	1,061	116,219	2077/03/15
		Transcanada Trust	社債券	5.6250	695	752	82,350	2075/05/20
		ViacomCBS Inc	社債券	5.8750	450	459	50,311	2057/02/28
		AusNet Services Holdings Pty Ltd	社債券	5.7500	500	506	55,441	2076/03/17
		Scentre Group Trust 2	社債券	5.1250	500	532	58,273	2080/09/24
		通貨小計		銘柄数 金 額	7銘柄		5,342	5,773
イギリス		NGG Finance PLC	社債券	5.6250	千イギリス・ポンド 1,062	千イギリス・ポンド 1,189	184,265	2073/06/18
通貨小計		銘柄数 金 額	1銘柄		1,062	1,189	184,265	

ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券マザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ (オランダ)		Volkswagen International Finance NV	社債券	4. 6250	千ユーロ 1, 100	千ユーロ 1, 283	千円 171, 095	永久債
		Volkswagen International Finance NV	社債券	3. 8750	300	335	44, 650	永久債
		TenneT Holding BV	社債券	2. 9950	897	943	125, 714	永久債
		Koninklijke FrieslandCampina NV	社債券	2. 8500	800	819	109, 270	永久債
国 小 計	銘柄数 金 額	4銘柄			3, 097	3, 382	450, 729	
ユーロ (ルクセンブルク)		Aroundtown SA	社債券	2. 8750	千ユーロ 1, 314	千ユーロ 1, 363	181, 727	永久債
国 小 計	銘柄数 金 額	1銘柄						
					1, 314	1, 363	181, 727	
ユーロ (フランス)		Electricite de France SA	社債券	5. 3750	千ユーロ 1, 000	千ユーロ 1, 125	149, 940	永久債
		Engie SA	社債券	1. 6250	500	509	67, 861	永久債
		Unibail-Rodamco SE	社債券	2. 8750	500	503	67, 126	永久債
		Arkema SA	社債券	1. 5000	400	399	53, 254	永久債
国 小 計	銘柄数 金 額	4銘柄						
					2, 400	2, 537	338, 183	
ユーロ (ドイツ)		Bayer AG	社債券	2. 3750	千ユーロ 1, 000	千ユーロ 1, 018	135, 677	2075/04/02
国 小 計	銘柄数 金 額	1銘柄						
					1, 000	1, 018	135, 677	
ユーロ (イタリア)		Eni SpA	社債券	3. 3750	千ユーロ 800	千ユーロ 848	113, 107	永久債
国 小 計	銘柄数 金 額	1銘柄						
					800	848	113, 107	
ユーロ (その他)		Orsted A/S	社債券	2. 2500	千ユーロ 300	千ユーロ 314	41, 937	2199/12/31
		BP Capital Markets PLC	社債券	3. 6250	889	961	128, 107	永久債
国 小 計	銘柄数 金 額	2銘柄						
					1, 189	1, 276	170, 045	
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			9, 800	10, 426	1, 389, 471	
合 計	銘柄数 金 額	21銘柄					2, 205, 713	

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	2,205,713	93.0
コール・ローン等、その他	166,307	7.0
投資信託財産総額	2,372,021	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.46円、1イギリス・ポンド＝154.94円、1スウェーデン・クローネ＝13.24円、1ユーロ＝133.26円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（2,362,486千円）の投資信託財産総額（2,372,021千円）に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年6月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	2,372,021,131円
コール・ローン等	124,470,221
公社債（評価額）	2,205,713,488
未収利息	36,853,940
前払費用	4,983,482
(B)負債	—
(C)純資産総額（A－B）	2,372,021,131
元本	1,891,703,072
次期繰越損益金	480,318,059
(D)受益権総口数	1,891,703,072口
1万口当り基準価額（C／D）	12,539円

- * 期首における元本額は2,178,863,774円、当作成期間中における追加設定元本額は22,628,531円、同解約元本額は309,789,233円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）1,891,703,072円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,539円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月10日 至2021年6月9日

項 目	当 期
(A)配当等収益	100,955,678円
受取利息	101,213,694
支払利息	△ 258,016
(B)有価証券売買損益	241,977,007
売買益	249,941,998
売買損	△ 7,964,991
(C)その他費用	△ 308,535
(D)当期損益金（A＋B＋C）	342,624,150
(E)前期繰越損益金	189,533,207
(F)解約差損益金	△ 54,210,767
(G)追加信託差損益金	2,371,469
(H)合計（D＋E＋F＋G）	480,318,059
次期繰越損益金（H）	480,318,059

- (注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。