

# 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26期(決算日 2022年3月9日)

第27期(決算日 2022年6月9日)

(作成対象期間 2021年12月10日～2022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	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実質組入上限比率	
	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			騰落率	公社債組入比率	純資産総額
	(分配落)	税金	込み			
	円	円	円	%	%	百万円
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
24期末 (2021年9月9日)	11,372	30		1.2	92.9	2,413
25期末 (2021年12月9日)	11,227	35		△ 1.0	92.4	2,382
26期末 (2022年3月9日)	10,580	55		△ 5.3	89.1	2,245
27期末 (2022年6月9日)	9,997	115		△ 4.4	99.7	2,092

(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。

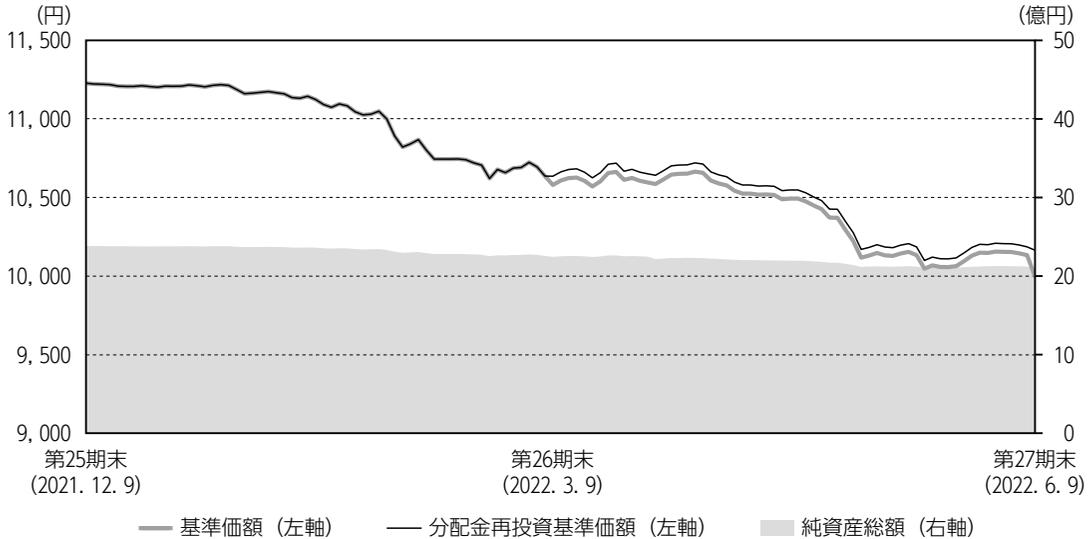
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

(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



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

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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

第26期首：11,227円

第27期末：9,997円（既払分配金170円）

騰落率：△9.5%（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下落したことから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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 比 率 組 入 比 率
		円	騰 落 率 %	
第26期	(期首) 2021年12月9日	11,227	—	92.4
	12月末	11,204	△ 0.2	93.5
	2022年1月末	11,046	△ 1.6	92.4
	2月末	10,678	△ 4.9	92.2
	(期末) 2022年3月9日	10,635	△ 5.3	89.1
第27期	(期首) 2022年3月9日	10,580	—	89.1
	3月末	10,646	0.6	98.7
	4月末	10,372	△ 2.0	94.1
	5月末	10,149	△ 4.1	94.3
	(期末) 2022年6月9日	10,112	△ 4.4	99.7

(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

（2021. 12. 10 ～ 2022. 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下落しました。

2022年に入り、ロシアとウクライナの情勢緊迫化への懸念に加え、欧米金融当局の金融緩和政策からの脱却ペースの加速などに対して投資家の間で警戒感が広がったことなどを背景に、コーポレート・ハイブリッド証券市場は当作成期末にかけて大きく下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「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。

## ポートフォリオについて

（2021. 12. 10 ～ 2022. 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26期	第27期
	2021年12月10日 ～2022年3月9日	2022年3月10日 ～2022年6月9日
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>	<b>55</b>	<b>115</b>
対基準価額比率 (%)	0.52	1.14
当期の収益 (円)	55	86
当期の収益以外 (円)	—	28
翌期繰越分配対象額 (円)	1,657	1,628

(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26期	第27期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 77.63円	✓ 86.10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	1,494.67	✓ 1,517.31
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,712.18	1,743.29
(f) 分配金	55.00	115.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,657.18	1,628.29

(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26期～第27期 (2021. 12. 10～2022. 6. 9)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	49円	0.460%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当作成期中の平均基準価額は10,696円です。</b>
（投信会社）	(37)	(0.345)	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）	(10)	(0.096)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	50	0.472	

(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。

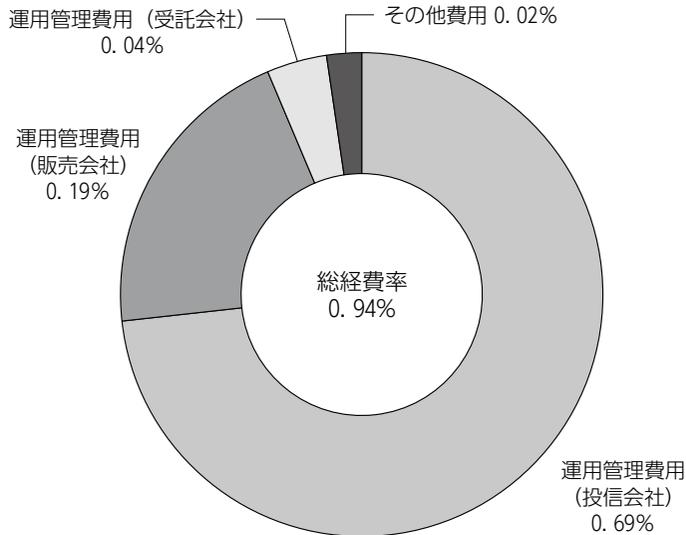
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.94%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

(2021年12月10日から2022年6月9日まで)

決算期	第26期～第27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	—	—	223,427	281,000

(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25期末		第27期末	
	□数	評価額	□数	評価額
	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	1,899,122	1,675,695	—	2,166,339

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2022年6月9日現在

項目	第27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	2,166,339	97.0
コール・ローン等、その他	66,275	3.0
投資信託財産総額	2,232,614	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＝134.46円、1イギリス・ポンド＝168.49円、1スウェーデン・クローネ＝13.69円、1ユーロ＝144.03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27期末における外貨建純資産(2,156,270千円)の投資信託財産総額(2,166,375千円)に対する比率は、99.5%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2022年3月9日)、(2022年6月9日)現在

項目	第26期末	第27期末
<b>(A) 資産</b>	<b>4,485,496,140円</b>	<b>4,280,672,244円</b>
コール・ローン等	21,122,603	66,275,359
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)	2,213,614,739	2,166,339,194
未収入金	2,250,758,798	2,048,057,691
<b>(B) 負債</b>	<b>2,240,378,793</b>	<b>2,188,012,470</b>
未払金	2,223,331,576	2,158,762,969
未払収益分配金	11,671,049	24,071,659
未払信託報酬	5,328,632	5,084,954
その他未払費用	47,536	92,888
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>2,245,117,347</b>	<b>2,092,659,774</b>
元本	2,122,008,961	2,093,187,749
次期繰越損益金	123,108,386	△ 527,975
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>2,122,008,961口</b>	<b>2,093,187,749口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	10,580円	9,997円

\* 当作成期首における元本額は2,122,008,961円、当作成期間(第26期～第27期)中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は28,821,212円です。

\* 第27期末の計算口数当りの純資産額は9,997円です。

\* 第27期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は527,975円です。

## ■損益の状況

第26期 自2021年12月10日 至2022年3月9日  
第27期 自2022年3月10日 至2022年6月9日

項目	第26期	第27期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 586円</b>	<b>△ 1,314円</b>
受取利息	1	—
支払利息	△ 587	△ 1,314
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 120,178,819</b>	<b>△ 92,754,563</b>
売買益	43,271,883	217,558,381
売買損	△ 163,450,702	△ 310,312,944
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 5,378,806</b>	<b>△ 5,136,761</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 125,558,211</b>	<b>△ 97,892,638</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>260,994,885</b>	<b>122,084,635</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>△ 657,239</b>	<b>△ 648,313</b>
(配当等相当額)	( 29,681,934)	( 29,278,792)
(売買損益相当額)	(△ 30,339,173)	(△ 29,927,105)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>134,779,435</b>	<b>23,543,684</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 11,671,049</b>	<b>△ 24,071,659</b>
<b>次期繰越損益金(G+H)</b>	<b>123,108,386</b>	<b>△ 527,975</b>
追加信託差損益金	△ 657,239	△ 648,313
(配当等相当額)	( 29,681,934)	( 29,278,792)
(売買損益相当額)	(△ 30,339,173)	(△ 29,927,105)
分配準備積立金	321,975,141	311,554,808
繰越損益金	△ 198,209,516	△ 311,434,470

(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:4,300,742円(未監査)

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	第26期	第27期
(a) 経費控除後の配当等収益	16,474,100円	18,024,408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	29,278,792
(d) 分配準備積立金	317,172,090	317,602,059
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	363,328,124	364,905,259
(f) 分配金	11,671,049	24,071,659
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	351,657,075	340,833,600
(h) 受益権総口数	2,122,008,961口	2,093,187,749口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ		
1 万 口 当 り 分 配 金 （ 税 込 み ）	第 2 6 期	第 2 7 期
	55円	115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7期 (決算日 2022年6月9日)

(作成対象期間 2021年6月10日～2022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いません。
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

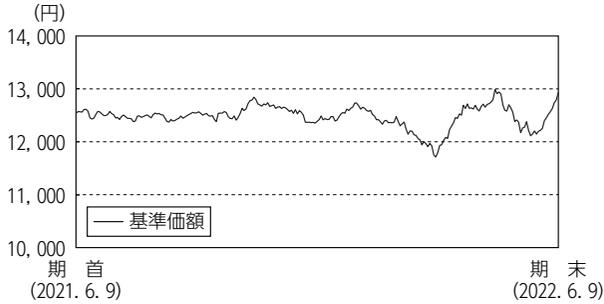
## 大和アセットマネジメント

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)2021年 6 月 9 日	12,539	—	93.0
6 月 末	12,494	△ 0.4	95.2
7 月 末	12,495	△ 0.4	93.3
8 月 末	12,492	△ 0.4	92.9
9 月 末	12,554	0.1	91.1
10 月 末	12,737	1.6	91.9
11 月 末	12,368	△ 1.4	92.9
12 月 末	12,631	0.7	92.6
2022年 1 月 末	12,362	△ 1.4	93.3
2 月 末	11,998	△ 4.3	92.8
3 月 末	12,716	1.4	97.3
4 月 末	12,580	0.3	94.7
5 月 末	12,400	△ 1.1	94.2
(期 末)2022年 6 月 9 日	12,928	3.1	96.3

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 公社債組入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：12,539円 期末：12,928円 騰落率：3.1%

【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は下落しましたが、ユーロが対円で大きく上昇(円安)した結果、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場

コーポレート・ハイブリッド証券市場は下落しました。

当作成期首から2021年9月中旬にかけては、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などを背景に良好な経済統計の発表が続いたことなどから、コーポレート・ハイブリッド証券市場は堅調に推移しました。その後は、FRB(米連邦準備制度理事会)の利上げ見通しが市場予想を上回ったことや、物資の供給制約の長期化などを背景としたインフレ懸念の高まりを受けて金利に上昇圧力が働いた中、コーポレート・ハイブリッド証券市場は軟調な推移となりました。11月下旬には、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まり、一段と下落が加速しましたが、年末にかけては、やや値を戻す展開となりました。2022年に入ると、ロシアとウクライナの情勢緊迫化への懸念に加え、欧米金融当局の金融緩和政策からの脱却ペースの加速などに対して投資家の間で警戒感が広がったことなどを背景に、コーポレート・ハイブリッド証券市場は当作成期末にかけて大きく下落しました。

○為替相場

ユーロ円為替相場は上昇しました。

ユーロは、米国金利の先高感やロシアとウクライナの情勢緊迫化への懸念などを背景に、対米ドルでは当作成期を通して下落基調となりましたが、一方で、米ドル円相場が2022年以降大幅に上昇したことで、クロス円相場(米ドル以外の対円為替相場)全般に円売り圧力が強まり、ユーロ円相場も当作成期末にかけて大きく上昇しました。

◆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・U.K・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・U.K・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・U.K・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)	2 (2)
(その他)	(0)
合 計	2

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### 公 社 債

(2021年6月10日から2022年6月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 1,966	千アメリカ・ドル 346 ( 950)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ —	千ユーロ 1,737 ( —)

## ■ 主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2021年6月10日から2022年6月9日まで)

当 期		買 付 額		売 付 額	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円		千円
Bayer AG (ドイツ) - floating - 2079/11/12	191,119	Electricite de France SA (フランス) - floating - 永久債	138,791		
Enterprise Products Operating LLC (アメリカ) - floating - 2077/8/16	95,334	Bayer AG (ドイツ) - floating - 2075/4/2	133,816		
SCENTRE GROUP TRUST 2 (オーストラリア) - floating - 2080/9/24	94,725	TenneT Holding BV (オランダ) - floating - 永久債	124,124		
UNIBAIL-RODAMCO SE (フランス) - floating - 永久債	65,716	Koninklijke FrieslandCampina NV (オランダ) - floating - 永久債	109,296		
TOTAL SE (フランス) - floating - 永久債	48,915	TOTAL SE (フランス) - floating - 永久債	49,121		
SOUTHERN CO/THE (アメリカ) - floating - 2081/9/15	47,215	Transcanada Trust (カナダ) - floating - 2075/5/20	44,585		
Enterprise Products Operating LLC (アメリカ) - floating - 2077/8/16	46,868				
Eni SpA (イタリア) - floating - 永久債	46,666				

(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。

		買 付 額	売 付 額
外	ユーロ (フランス)	千ユーロ 867	千ユーロ 1,440 ( —)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 1,452	千ユーロ 1,017 ( —)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 351	千ユーロ — ( —)
国	ユーロ (その他)	千ユーロ 345	千ユーロ — ( —)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 3,017	千ユーロ 4,194 ( —)

(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。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 率	残存期間別組入比率			
		評 価 額		%			%	%	%	%
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
アメリカ	千アメリカ・ドル 6,049	千アメリカ・ドル 5,671	千円 762,619	% 35.2	% —	% 35.2	% —	% —		
イギリス	千イギリス・ポンド 1,062	千イギリス・ポンド 1,065	179,467	8.3	—	8.3	—	—		
ユーロ （オランダ）	千ユーロ 1,400	千ユーロ 1,326	191,003	8.8	—	8.8	—	—		
ユーロ （ルクセンブルク）	千ユーロ 1,314	千ユーロ 1,153	166,147	7.7	—	7.7	—	—		
ユーロ （フランス）	千ユーロ 1,900	千ユーロ 1,757	253,200	11.7	—	11.7	—	—		
ユーロ （ドイツ）	千ユーロ 1,400	千ユーロ 1,260	181,548	8.4	—	8.4	—	—		
ユーロ （イタリア）	千ユーロ 1,150	千ユーロ 1,013	145,908	6.7	—	6.7	—	—		
ユーロ （その他）	千ユーロ 1,576	千ユーロ 1,434	206,589	9.5	—	9.5	—	—		
ユーロ （小計）	千ユーロ 8,740	千ユーロ 7,945	1,144,397	52.8	—	52.8	—	—		
合 計	—	—	2,086,484	96.3	—	96.3	—	—		

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日		
					%	千円		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
アメリカ	Enel SpA	社債券	8.7500	904	941	126,626	2073/09/24		
	Enbridge Inc	社債券	6.2500	1,286	1,239	166,598	2078/03/01		
	Enterprise Products Operating LLC	社債券	4.8750	813	671	90,313	2077/08/16		
	Enterprise Products Operating LLC	社債券	5.2500	400	346	46,551	2077/08/16		
	Transcanada Trust	社債券	5.3000	1,007	931	125,204	2077/03/15		
	Transcanada Trust	社債券	5.6250	349	341	45,870	2075/05/20		
	Scentre Group Trust 2	社債券	5.1250	500	452	60,880	2080/09/24		
	SCENTRE GROUP TRUST 2	社債券	4.7500	790	747	100,573	2080/09/24		
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		6,049	5,671	762,619		
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 1,065	179,467	2073/06/18		
				1,062	1,065	179,467			
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		1,062	1,065	179,467			

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	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末			償 還 年 月 日
					評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	千 円	
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 1,055	152,021	永久債	
	Volkswagen International Finance NV	社債券	3.8750	300	270	38,981	永久債	
国小計	銘柄数 金 額	2銘柄		1,400	1,326	191,003		
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 1,153	166,147	永久債	
国小計	銘柄数 金 額	1銘柄		1,314	1,153	166,147		
ユーロ (フランス)	Engie SA	社債券	1.6250	千ユーロ 500	千ユーロ 466	67,183	永久債	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	社債券	2.1250	500	476	68,646	永久債	
	Unibail-Rodamco SE	社債券	2.8750	500	452	65,127	永久債	
	Arkema SA	社債券	1.5000	400	362	52,242	永久債	
国小計	銘柄数 金 額	4銘柄		1,900	1,757	253,200		
ユーロ (ドイツ)	Bayer AG	社債券	3.1250	千ユーロ 1,400	千ユーロ 1,260	181,548	2079/11/12	
国小計	銘柄数 金 額	1銘柄		1,400	1,260	181,548		
ユーロ (イタリア)	Eni SpA	社債券	3.3750	千ユーロ 800	千ユーロ 705	101,584	永久債	
	Eni SpA	社債券	2.0000	350	307	44,323	永久債	
国小計	銘柄数 金 額	2銘柄		1,150	1,013	145,908		
ユーロ (その他)	Orsted A/S	社債券	2.2500	千ユーロ 300	千ユーロ 294	42,474	2199/12/31	
	SOUTHERN CO/THE	社債券	1.8750	387	316	45,609	2081/09/15	
	BP Capital Markets PLC	社債券	3.6250	889	822	118,506	永久債	
国小計	銘柄数 金 額	3銘柄		1,576	1,434	206,589		
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		8,740	7,945	1,144,397		
合 計	銘柄数 金 額	22銘柄				2,086,484		

(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

2022年6月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	2,086,484 千円	96.3 %
コール・ローン等、その他	79,890	3.7
投資信託財産総額	2,166,375	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=134.46円、1イギリス・ポンド=168.49円、1スウェーデン・クローネ=13.69円、1ユーロ=144.03円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(2,156,270千円)の投資信託財産総額(2,166,375千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月9日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	2,166,375,168円
コール・ローン等	33,272,742
公社債(評価額)	2,086,484,778
未取利息	45,323,890
前払費用	1,293,758
(B)負債	—
(C)純資産総額(A-B)	2,166,375,168
元本	1,675,695,540
次期繰越損益金	490,679,628
(D)受益権総口数	1,675,695,540口
1万口当り基準価額(C/D)	12,928円

\* 期首における元本額は1,891,703,072円、当作成期間中における追加設定元本額は45,561,829円、同解約元本額は261,569,361円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：  
ダイワ世界コーポレート・ハイブリッド証券ファンド(為替ヘッジあり)

1,675,695,540円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,928円です。

■損益の状況

当期 自2021年6月10日 至2022年6月9日

項 目	当 期
(A)配当等収益	99,333,610円
受取利息	99,641,179
支払利息	△ 307,569
(B)有価証券売買損益	△ 32,682,136
売買益	282,512,566
売買損	△ 315,194,702
(C)その他費用	△ 297,437
(D)当期損益金(A+B+C)	66,354,037
(E)前期繰越損益金	480,318,059
(F)解約差損益金	△ 67,430,639
(G)追加信託差損益金	11,438,171
(H)合計(D+E+F+G)	490,679,628
次期繰越損益金(H)	490,679,628

(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。