

ダイワ・ボンド・ファンド・シリーズ
毎月分配カナダ・ボンド・ファンド

アイルランド籍カナダドル建オープン・エンド契約型外国投資信託

運用報告書(全体版)

作成対象期間

第16期

(2018年6月1日～2019年5月30日)

信託終了日 2019年5月30日

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。

さて、ダイワ・ボンド・ファンド・シリーズー毎月分配カナダ・ボンド・ファンド（以下「ファンド」といいます。）は、2019年5月30日に償還いたしました。

ここに、運用状況をご報告申し上げます。

管理会社

エスエムティー・ファンド・サービスズ
(アイルランド)リミテッド

代行協会員

大和証券株式会社

ファンドの仕組みは、以下のとおりです。

ファンド形態	アイルランド籍カナダドル建オープン・エンド契約型外国投資信託	
信託期間	2003年6月30日より運用を開始しております。 ファンドの存続期間は無期限です。 (注) ファンドは、2019年5月30日に償還いたしました。	
繰上償還	ファンドを存続させることが違法となる等、一定の事由が発生した場合には、受託会社は書面の通知をしてファンドを終了させることができます。 また、受益証券の当初発行日から1年間またはそれ以降のいずれかの取引日に、ファンドの純資産額が500万米ドルを下回る等、一定の事由が発生した場合には、管理会社は独自の判断に従って、書面の通知をしてファンドを終了させることができます。	
運用方針	ファンドの投資目的は、主として公認取引所に上場され、またはそこで取引される国債、国際機関債、社債、カナダの地方債、資産担保証券を含むカナダドル建債券および／または公認取引所で取引されるカナダの国内債に投資することにより、長期的な資本成長を目指し、かつ安定した分配を追求することです。	
主要投資対象	ファンドは、主として公認の証券取引所において上場され、または取引される国債、国際機関債、社債、カナダの地方債もしくは資産担保証券を含むカナダドル建ての債券および／または公認取引所で取引されるカナダの国内債に投資します。	
ファンドの運用方法	ファンドは、資産取得時において投資適格債券より高い格付けを有するカナダドル建て固定金利商品に主として投資します。	
	デュレーション	ファンドの平均デュレーションは、ブルームバーグ・パークレイズ・カナダ総合インデックスのデュレーションの±2.0年程度の範囲内とします。
	クレジット・アロケーション	国債以外の公社債、政府機関債、カナダの地方債および資産担保証券への投資は、取得時において信託資産の純資産総額の50%以内とします。
	個別銘柄	●ファンドはS&PまたはムーディーズのBBB-／Baa3以上の格付けを取得している証券に投資します。 ●ファンドの加重平均格付けは、S&PまたはムーディーズのAa-／Aa3相当以上を保持するものとします。
	通貨	カナダドル建資産にのみ投資します。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ●ファンドは、公認取引所に上場または取引されていない証券に、ファンドの純資産額の10%以上を投資してはなりません。 ●ファンドは同一発行体が発行した証券に純資産額の10%以上を投資してはなりません。 ●原則として、ファンドの純資産額の10%以上を、1つの機関に預託してはなりません。 ●ファンドは、いかなる種類の株式または出資に対しても投資することはできません。 ●ファンドは、会社型の株式に対して投資を行うオープン・エンド型集合投資スキームに投資してはなりません。 ●ファンドは、純資産額の10%以上をその他のオープン・エンド型集合投資ファンドに投資してはならない等の条件に従って、かかる投資ファンドの受益証券を購入することができます。 	
分配方針	<p>収益分配は、管理会社が毎月15日（ただし、かかる日が営業日でないときはその直前の営業日）に宣言することにより、行われる予定です（ただし、将来の分配金の支払およびその金額について保証するものではありません。分配が行われないこともあります。）。</p> <p>(注) 営業日とは、東京、ダブリン、ロンドンおよびトロントの銀行が通常通りに営業しており、かつ日本における金融商品取引業者の営業日をいいます。</p>	

I. ファンドの設定から前期までの運用の経過

(2003年6月30日～2018年5月31日)

投資環境について

期初には、中国やインドなどの新興国市場での堅調な経済成長が世界の商品価格の持続的な上昇につながりました。このことは、ドットコムバブル危機（2000年ないし2002年）後のリスク選好度の回復と相まって、安全資産に対する需要を減少させました。

センチメントは、2006年に再びマイナスに転じました。2006年の米国住宅市場の大規模な調整が2008年と2009年の世界的な金融危機という、この期間で最も驚異的な出来事を引き起こしました。2008年第4四半期は、流動性を注入し、信頼を回復し、また、歴史的な水準となったボラティリティを下げることを目的に、政府関係者が世界規模で前例のない措置を講じ、極めて波乱の多い期間となりました。この間、安全資産への強い需要は、総じて優良な国債のパフォーマンスにつながりました。

カナダでは、2008年10月に政府が大規模な住宅ローン買取りプログラム（IMPP）を導入した後も信用市場の悪化が続き、投資家の不安が懸念に転じました。金融政策面では、カナダ銀行が、世界各国の中央銀行と協調して、政策金利を大幅に緩和しました。持続的なデフレの防止に向けた世界的な取り組みにもかかわらず、市場の期待インフレーション率は著しく低下しました。

より近年では、世界的な金融政策の方向性は引き締めに向かいました。カナダ銀行は、2017年7月、オーバーナイト金利を7年ぶりに0.75%に引き上げました。その後、2回の追加利上げを実施し、期末までに主要プライムレートを1.25%に引き上げました。また、カナダ銀行は、金利を時の経過とともに中立的な範囲にまで上昇させるとの見方から、利上げサイクルの追加的な上昇を示唆しました。

ポートフォリオについて

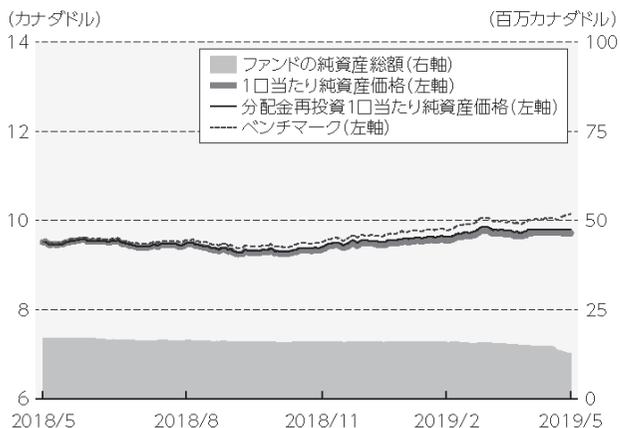
本ポートフォリオは、当該期間の費用控除前でベンチマークを下回りました（投資運用会社の採用する計算方法・費用控除前ベース。）。

政府関連セクターの平均組入比率を低めにしていたこととイールドカーブのポジションが2大マイナス要因となりましたが、銘柄選択も相対リターンを低下させました。これとは対照的に、社債と国債セクターの平均組入利率を高めにしてきたことは、相対リターンに貢献しました。

ファンドのポートフォリオは、設定時より、徹底したファンダメンタルズ調査と受益者保護に焦点を当てた投資哲学に基づいて運用されました。この考え方は、常に投資運用会社の基本的価値観と整合的であり、ポートフォリオの設定時から変更されませんでした。また、運用期間中、投資運用会社は、規律ある投資プロセスと厳格なリスク管理手法を維持しました。

II. 当期の運用の経過等

■ 当期の1口当たり純資産価格等の推移について



第15期末の1口当たり純資産価格	9.51カナダドル
第16期末の1口当たり純資産価格	9.71カナダドル(分配金額0.081カナダドル)
騰落率	2.98%

(注1) 騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算しています。以下同じです。

(注2) 1口当たり分配金額は、税引前の分配金額を記載しています。以下同じです。

(注3) 分配金再投資1口当たり純資産価格は、税引前の分配金を分配時にファンドへ再投資したとみなして算出したもので、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。以下同じです。

(注4) 分配金再投資1口当たり純資産価格およびベンチマークは、第15期末のファンドの1口当たり純資産価格を起点として計算しています。

(注5) ファンドの購入価額により課税条件は異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注6) ファンドのベンチマークは、「ブルームバーグ・パークレイズ・カナダ総合インデックス」です。ベンチマークの詳細は、後記「ベンチマークについて」をご参照ください。以下同じです。

■ 1口当たり純資産価格の主な変動要因

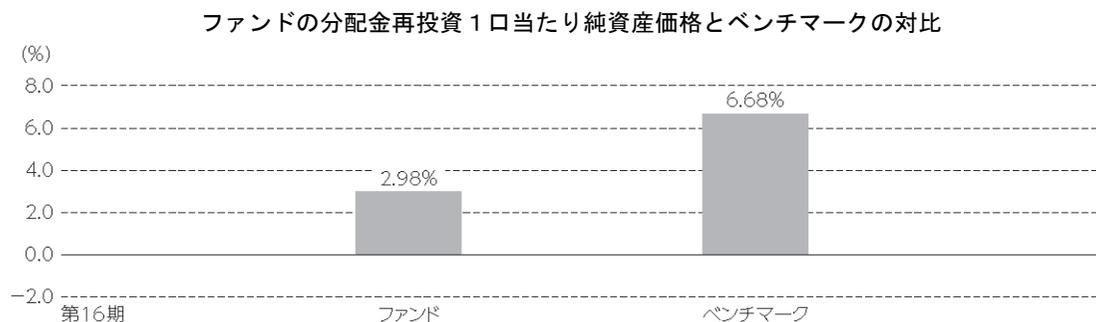
- ・ 当期のカナダ国債市場は、現地通貨建てベースでプラスのリターンとなりました^(注)。カナダ国債は、カナダ銀行による利上げサイクルの延長と米国との新たな貿易協定の締結を受けて当期序盤に売られました。地政学上の不確実性の再燃を受けて安全資産への需要が高まったことに伴い、11月から長期の上昇相場を展開しました。
 - ・ 投資配分をアンダーウエイトした社債に対する銘柄選択が相対リターンに貢献しました。(投資運用会社の採用する計算方法・費用控除前ベース。そのため上記グラフとは異なります。)
 - ・ イールドカーブのポジションが期中の相対リターンを最も低下させました。政府関連セクターのエクスポージャーのアンダーウエイトを中心に、セクター別配分も相対リターンを低下させました。
- (注) ブルームバーグ・パークレイズ・カナダ総合インデックスによります。

■ベンチマークについて

ベンチマークは2002年10月1日に導入された後名称が変更され、ブルームバーグ・バークレイズ・カナダ総合インデックスとなりました。この指数はグローバル債券市場においてファンド・マネージャーに広範かつ客観的なベンチマークを提供します。この指数は、固定金利投資適格カナダドル債券市場の客観的表示であるルールに基づく構造に従います。

■ベンチマークとの差異について

以下のグラフは、ファンドの分配金再投資1口当たり純資産価格とベンチマークの騰落率の対比です。



ファンドとベンチマークの騰落率の差異の状況および要因について

当期のファンドのリターンは、デュレーションのポジションを主因にベンチマークを下回りました（投資運用会社の採用する計算方法・費用控除前ベース。）。イールドカーブのポジションが期中の相対リターンを最も低下させました。政府関連セクターのエクスポージャーのアンダーウエイトを中心に、セクター別配分も相対リターンを低下させました。また、当期の1口当たり純資産価格ベースのリターンも、ベンチマークを下回りました。

■分配金について

当期（2018年6月1日～2019年5月30日）の1口当たり分配金（税引前）は下表のとおりです。なお、下表の「分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額」は、当該分配落日における1口当たり分配金額と比較する目的で、便宜上算出しているものです。

分配落日	1口当たり純資産価格	1口当たり分配金額 (対1口当たり純資産価格比率 ^(注1))	分配金を含む1口当たり 純資産価格の変動額 ^(注2)
2018年6月15日	9.51カナダドル	0.009カナダドル (0.09%)	0.189カナダドル
2018年7月13日	9.52カナダドル	0.009カナダドル (0.09%)	0.019カナダドル
2018年8月15日	9.44カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	-0.071カナダドル
2018年9月14日	9.39カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	-0.041カナダドル
2018年10月15日	9.27カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	-0.111カナダドル
2018年11月15日	9.32カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	0.059カナダドル
2018年12月14日	9.40カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	0.089カナダドル
2019年1月15日	9.46カナダドル	0.009カナダドル (0.10%)	0.069カナダドル
2019年2月15日	9.55カナダドル	0.003カナダドル (0.03%)	0.093カナダドル
2019年3月15日	9.66カナダドル	0.003カナダドル (0.03%)	0.113カナダドル
2019年4月15日	9.67カナダドル	0.003カナダドル (0.03%)	0.013カナダドル
2019年5月15日	9.72カナダドル	0.000カナダドル (0.00%)	0.050カナダドル

(注1) 「対1口当たり純資産価格比率」とは、以下の計算式により算出される値であり、ファンドの収益率とは異なる点にご留意ください。

$$\text{対1口当たり純資産価格比率 (\%)} = 100 \times a / b$$

a = 当該分配落日における1口当たり分配金額

b = 当該分配落日における1口当たり純資産価格 + 当該分配落日における1口当たり分配金額

(注2) 「分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額」とは、以下の計算式により算出されます。

$$\text{分配金を含む1口当たり純資産価格の変動額} = b - c$$

b = 当該分配落日における1口当たり純資産価格 + 当該分配落日における1口当たり分配金額

c = 当該分配落日の直前の分配落日における1口当たり純資産価格

(注3) 2019年5月においては分配が行われなかったため、「分配落日」および「1口当たり純資産価格」には、便宜上、分配が予定されていた2019年5月15日ならびに当該日の1口当たり純資産価格を記載しております。

(注4) 2018年6月15日の直前の分配落日（2018年5月15日）における1口当たり純資産価格は、9.33カナダドルでした。

■投資環境について

当期のカナダ国債市場は、現地通貨建てベースでプラスのリターンとなりました^(注)。カナダ国債は、カナダ銀行による利上げサイクルの延長と米国との新たな貿易協定の締結を受けて当期序盤に売られました。地政学上の不確実性の再燃を受けて安全資産への需要が高まったことに伴い、11月から長期の上昇相場を展開しました。

カナダ銀行は7月の政策決定会合で政策金利を0.25%引き上げて1.50%とし、10月にも追加利上げを行い、現在は1.75%としています。カナダ銀行は2019年5月の会合において、「家計支出、原油市場および世界の貿易環境の動向」に注目し、将来の政策決定においてデータに基づく手法を採用することを表明しました。

経済報道を見ると、カナダ統計局の調べでインフレーション率が4月に3か月連続で上昇し、対前年同月比で2%上昇しました。2019年第1四半期の経済成長率は、年率換算で0.4%でした。この数値は2018年第4四半期の成長率である0.3%（下方修正後）を僅かに上回りました。その他、失業率が4月に5.7%に低下しました。

(注) ブルームバーグ・パークレイズ・カナダ総合インデックスによります。

■ポートフォリオについて

当期のファンドのリターンは、デュレーションのポジションを主因にベンチマークを下回りました（投資運用会社の採用する計算方法・費用控除前ベース。）。また、当期の1口当たり純資産価格ベースのパフォーマンスも、ベンチマークを下回りました。

ファンドは、各通貨のうち、カナダドル建の銘柄にのみ投資することができます。

ファンドは当期序盤にカナダ国債への投資配分をややオーバーウエイトとし、米国とカナダ間の貿易協定修正案を巡る交渉の長期化を受けて景気の不確実性が強まったことに伴い、かかるポジションを引き上げました。12月に、世界の株式と原油価格の急落により安全資産への需要が高まったことから、オーバーウエイトのポジションをさらに引き上げました。2月に、割高感がかなり強まったように見受けられたため、利回りが一段と低下した機会を捉えてオーバーウエイトのポジションを引き下げました。4月には、国際通貨基金による世界の成長予測の下方修正と米中間の貿易摩擦が過熱化したことを踏まえ、オーバーウエイトのポジションを若干引き上げました。

社債セクターでは、投資適格社債のポジションのアンダーウエイトを維持しました。

絶対リターンに影響を及ぼした主な要因

絶対リターンを上昇させた要因

当期のカナダ国債市場は、現地通貨建てベースでプラスのリターンとなりました^(注)。カナダ国債は、カナダ銀行による利上げサイクルの延長と米国との新たな貿易協定の締結を受けて当期序盤に売られましたが、地政学上の不確実性の再燃を受けて安全資産への需要が高まったことに伴い、11月から長期の上昇相場を展開しました。

(注) ブルームバーグ・パークレイズ・カナダ総合インデックスによります。

絶対リターンを低下させた要因

絶対リターンを低下させた主な要因はありませんでした。

相対リターン（投資運用会社の採用する計算方法・費用控除前ベース。）に影響を及ぼした主な要因

相対リターンを上昇させた要因

投資配分をアンダーウエイトした社債に対する銘柄選択が相対リターンに貢献しました。

相対リターンを低下させた要因

イールドカーブのポジションが期中の相対リターンを最も低下させました。政府関連セクターのエクスポージャーのアンダーウエイトを中心に、セクター別配分も相対リターンを低下させました。

■投資の対象とする有価証券の主な銘柄

当期末現在における有価証券等の組入れはありません。

■今後の運用方針

ファンドは、2019年5月30日に償還いたしました。

■費用の明細

項目		項目の概要	
管理報酬等		報酬の年率合計は、ファンドの純資産額の1.29%を超えないものとします。	
管理会社報酬		ファンドの純資産額につき以下の年率が、ファンドの資産の運用・管理業務の対価として、管理会社に支払われます。 管理会社は、当該報酬から販売報酬および代行協会員報酬を支払います。	
		ファンドの純資産額	料率
		100百万カナダドル以下の場合	0.61%
内訳		100百万カナダドル超の場合	0.67%
		ファンドの純資産額	料率
		100百万カナダドル以下の場合	0.51%
代行協会員報酬		100百万カナダドル超の場合	0.57%
		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	
管理事務代行報酬		ファンドの日々の平均純資産額の年率0.10%	受益証券の（1口当たりの）純資産価格の公表業務、目論見書、決算報告書等の販売会社への交付業務等の対価
		ファンドの純資産額	料率
		100百万カナダドル以下の場合	0.12%
受託会社報酬		100百万カナダドル超の場合	0.11%
		ファンドの管理事務代行業務の対価	
受託会社報酬		ファンドの純資産額の年率0.06%	ファンドの受託業務の対価
投資運用会社報酬		ファンドの純資産額	料率
		100百万カナダドル以下の場合	0.50%
		100百万カナダドル超の場合	0.45%
投資運用会社報酬		ファンドに関する投資運用業務の対価	
その他の費用(当期)		1.05%	監査報酬、法務報酬、印刷費等

(注) 各報酬については、目論見書に定められている料率を記しています。「その他の費用(当期)」には運用状況等により変動するものや実費となる費用が含まれます。便宜上、その他の費用(当期)の金額をファンドの当期末の純資産総額で除して100を乗じた比率を表示していますが、実際の比率とは異なります。

Ⅲ. 直近10期の運用実績

1. 純資産の推移

下記各会計年度末および第16会計年度中における各月末の純資産の推移は、以下のとおりです。

	純資産総額		1口当たり純資産価格	
	千カナダドル	百万円	カナダドル	円
第七会計年度末 (2010年5月末日)	49,715	4,110	9.94	822
第八会計年度末 (2011年5月末日)	42,733	3,533	10.12	837
第九会計年度末 (2012年5月末日)	35,128	2,904	10.53	871
第十会計年度末 (2013年5月末日)	30,746	2,542	10.27	849
第十一会計年度末 (2014年5月末日)	28,084	2,322	10.14	838
第十二会計年度末 (2015年5月末日)	26,993	2,232	10.35	856
第十三会計年度末 (2016年5月末日)	22,528	1,862	10.19	842
第十四会計年度末 (2017年5月末日)	20,446	1,690	9.95	823
第十五会計年度末 (2018年5月末日)	17,053	1,410	9.51	786
第十六会計年度末 (2019年5月30日)	12,731	1,052	9.71	803
2018年6月末日	16,968	1,403	9.52	787
7月末日	16,331	1,350	9.40	777
8月末日	16,374	1,354	9.46	782
9月末日	16,114	1,332	9.34	772
10月末日	15,851	1,310	9.26	766
11月末日	15,881	1,313	9.35	773
12月末日	15,917	1,316	9.47	783
2019年1月末日	16,000	1,323	9.53	788
2月末日	15,860	1,311	9.55	789
3月末日	15,626	1,292	9.73	804
4月末日	14,752	1,220	9.72	804
5月30日	12,731	1,052	9.71	803

(注) カナダドルの円貨換算は、便宜上、2019年7月31日現在の株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1カナダドル=82.67円)によります。以下同じです。

2. 分配の推移

	分配金（1口当たり）	
	カナダドル	円
第七会計年度 (2009年6月1日～2010年5月末日)	0.282	23.31
第八会計年度 (2010年6月1日～2011年5月末日)	0.264	21.82
第九会計年度 (2011年6月1日～2012年5月末日)	0.264	21.82
第十会計年度 (2012年6月1日～2013年5月末日)	0.264	21.82
第十一会計年度 (2013年6月1日～2014年5月末日)	0.264	21.82
第十二会計年度 (2014年6月1日～2015年5月末日)	0.264	21.82
第十三会計年度 (2015年6月1日～2016年5月末日)	0.264	21.82
第十四会計年度 (2016年6月1日～2017年5月末日)	0.264	21.82
第十五会計年度 (2017年6月1日～2018年5月末日)	0.173	14.30
第十六会計年度 (2018年6月1日～2019年5月30日)	0.081	6.70

1口当たり分配金 設定来累計 (2019年5月30日までの累計額)	4.840カナダドル
--------------------------------------	------------

3. 販売及び買戻しの実績

下記会計年度における販売および買戻しの実績ならびに下記会計年度末現在の発行済口数は、以下のとおりです。

	販売口数		買戻し口数		発行済口数	
		本邦内における販売口数		本邦内における買戻し口数		本邦内における発行済口数
第七会計年度 (2009年6月1日～ 2010年5月末日)	□ 1,300	□ 1,300	□ 1,203,900	□ 1,203,900	□ 5,000,360	□ 5,000,360
第八会計年度 (2010年6月1日～ 2011年5月末日)	□ 4,690	□ 4,690	□ 780,510	□ 780,510	□ 4,224,540	□ 4,224,540
第九会計年度 (2011年6月1日～ 2012年5月末日)	□ 34,500	□ 34,500	□ 924,190	□ 924,190	□ 3,334,850	□ 3,334,850
第十会計年度 (2012年6月1日～ 2013年5月末日)	□ 26,460	□ 26,460	□ 368,730	□ 368,730	□ 2,992,580	□ 2,992,580
第十一会計年度 (2013年6月1日～ 2014年5月末日)	□ 26,280	□ 26,280	□ 248,090	□ 248,090	□ 2,770,770	□ 2,770,770
第十二会計年度 (2014年6月1日～ 2015年5月末日)	□ 66,900	□ 66,900	□ 230,460	□ 230,460	□ 2,607,210	□ 2,607,210
第十三会計年度 (2015年6月1日～ 2016年5月末日)	□ 66,280	□ 66,280	□ 461,730	□ 461,730	□ 2,211,760	□ 2,211,760
第十四会計年度 (2016年6月1日～ 2017年5月末日)	□ 19,140	□ 19,140	□ 175,570	□ 175,570	□ 2,055,330	□ 2,055,330
第十五会計年度 (2017年6月1日～ 2018年5月末日)	□ 100	□ 100	□ 262,010	□ 262,010	□ 1,793,420	□ 1,793,420
第十六会計年度 (2018年6月1日～ 2019年5月30日)	□ 33,770	□ 33,770	□ 516,050	□ 516,050	□ 1,311,140	□ 1,311,140

(注) 第16会計年度末の受益証券(発行済口数1,311,140口)は、2019年5月30日にすべて償還されました。

IV. ファンドの経理状況

- a. ファンドの2018年6月1日から2019年5月30日までの期間の日本語の財務書類は、英国およびアイルランドにおける法令に準拠して作成された原文の財務書類を翻訳したものです。これは「特定有価証券の内容等の開示に関する内閣府令」に基づき、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」第131条第5項ただし書の規定の適用によるものです。
- b. ファンドの原文の財務書類は、外国監査法人等（公認会計士法（昭和23年法律第103号）第1条の3第7項に規定する外国監査法人等をいいます。）の監査を受けていません。
- c. ファンドの原文の財務書類は、カナダ・ドルで表示されています。日本語の財務書類には、主要な金額について円貨換算が併記されています。日本円による金額は、2019年7月31日現在における株式会社三菱UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1カナダ・ドル=82.67円）で換算されています。なお、千円未満の金額は四捨五入されています。

(1) 貸借対照表

ダイワ・ボンド・ファンド・シリーズ
 毎月分配カナダ・ボンド・ファンド
 財政状態計算書
 2019年5月30日現在

	2019年5月30日		2018年5月31日	
	(カナダドル)	(千円)	(カナダドル)	(千円)
資産				
現金預金	13,469,858	1,113,553	395,197	32,671
未収債権	28,192	2,331	30,362	2,510
損益を通じて公正価値で測定する 金融資産	—	—	16,939,853	1,400,418
資産合計	13,498,050	1,115,884	17,365,412	1,435,599
負債				
未払債務－1年以内支払期限到来	766,880	63,398	312,022	25,795
損益を通じて公正価値で測定する 金融負債	1	0	—	—
金融資産	766,881	63,398	312,022	25,795
買戻可能受益証券保有者に帰属す る純資産	12,731,169	1,052,486	17,053,390	1,409,804

(2) 損益計算書

ダイワ・ボンド・ファンド・シリーズ
毎月分配カナダ・ボンド・ファンド
包括利益計算書

2018年6月1日から2019年5月30日までの期間

	2018年6月1日から 2019年5月30日までの期間		2018年5月31日に終了した年度	
	(カナダドル)	(千円)	(カナダドル)	(千円)
収益				
預金利息	3,759	311	998	83
報酬の払戻し	24,516	2,027	—	—
損益を通じて公正価値で測定する金融資産・負債に係る純利益／(損失)	756,829	62,567	(201,080)	(16,623)
収益／(費用)合計	785,104	64,905	(200,082)	(16,541)
費用				
受託会社報酬	9,493	785	11,096	917
販売会社報酬	80,800	6,680	94,322	7,798
代行協会報酬	15,821	1,308	18,491	1,529
投資運用報酬	47,554	3,931	55,487	4,587
投資顧問報酬	31,643	2,616	36,983	3,057
管理事務代行報酬	18,985	1,569	22,193	1,835
監査報酬	16,769	1,386	15,340	1,268
法務報酬	35,294	2,918	44,448	3,675
印刷費	22,325	1,846	48,749	4,030
その他の費用	59,804	4,944	13,723	1,134
費用合計	338,488	27,983	360,832	29,830
純収益／(費用)	446,616	36,922	(560,914)	(46,371)
ファイナンス費用				
分配金	(138,678)	(11,465)	(338,950)	(28,021)
ファイナンス費用合計	(138,678)	(11,465)	(338,950)	(28,021)
分配後の買戻可能受益証券保有者に帰属する純資産の増(減)	307,938	25,457	(899,864)	(74,392)

利益および損失は、専ら非継続運用から生じた。

当包括利益計算書に表示された以外に、計上すべき損益はない。

ダイワ・ボンド・ファンド・シリーズ
 毎月分配カナダ・ボンド・ファンド
 買戻可能受益証券保有者に帰属する
 純資産の変動計算書

2018年6月1日から2019年5月30日までの期間

	2018年6月1日から 2019年5月30日までの期間		2018年5月31日に終了した年度	
	(カナダドル)	(千円)	(カナダドル)	(千円)
期首現在買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産	17,053,390	1,409,804	20,446,293	1,690,295
買戻可能受益証券の発行額からの手 取金	318,313	26,315	967	80
買戻可能受益証券の買戻額に対する 支払	(4,964,277)	(410,397)	(2,512,975)	(207,748)
純収益平準化	15,805	1,307	18,963	1,568
純資本平準化	—	—	6	0
分配後の買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産の増(減)	307,938	25,457	(899,864)	(74,392)
期末現在買戻可能受益証券保有者に 帰属する純資産	12,731,169	1,052,486	17,053,390	1,409,804

V. 投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託当初払込日	2003年6月30日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2019年5月30日		資産総額	13,498,050 ^{カナダドル}
区分	投資信託当初払込時	投資信託契約終了時	差引増減	負債総額	766,881 ^{カナダドル}
				純資産総額	12,731,169 ^{カナダドル}
受益権口数	27,011,760口	1,311,140口	-25,700,620口	受益権口数	1,311,140口
元本額	270,117,600 ^{カナダドル}	12,731,169 ^{カナダドル}	-257,386,431 ^{カナダドル}	1口当たり償還金	9.71 ^{カナダドル}

毎計算期末の状況

計算期	元本額 (千カナダドル)	純資産総額 (千カナダドル)	1口当たり 純資産価格 (カナダドル)	1口当たり分配金	
				金額 (カナダドル)	分配率 (%)
第1期	270,118	267,479	9.83	0.380	3.87
第2期	267,479	223,731	10.23	0.444	4.34
第3期	223,731	108,772	9.86	0.408	4.14
第4期	108,772	84,696	9.77	0.408	4.18
第5期	84,696	73,615	9.88	0.408	4.13
第6期	73,615	60,360	9.73	0.408	4.19
第7期	60,360	49,715	9.94	0.282	2.84
第8期	49,715	42,733	10.12	0.264	2.61
第9期	42,733	35,128	10.53	0.264	2.51
第10期	35,128	30,746	10.27	0.264	2.57
第11期	30,746	28,084	10.14	0.264	2.60
第12期	28,084	26,993	10.35	0.264	2.55
第13期	26,993	22,528	10.19	0.264	2.59
第14期	22,528	20,446	9.95	0.264	2.65
第15期	20,446	17,053	9.51	0.173	1.82
第16期	17,053	12,731	9.71	0.081	0.83

(注) 当初申込期間における1口当たり申込価格は、10カナダドルでした。
ファンドの受益証券は、2019年5月30日にすべて償還されました。

VI. お知らせ

- ・投資顧問会社であった大和住銀投信投資顧問株式会社は、2019年4月1日に三井住友アセットマネジメント株式会社と合併し、三井住友DSアセットマネジメント株式会社となりました。ファンドの投資顧問業務は、三井住友DSアセットマネジメント株式会社が継承しました。
- ・ファンドの純資産総額は、ポートフォリオリスクを分散させることや、理想的なポートフォリオを維持するには十分ではない状態となりました。また、近年、法律上および規制上の要件から生じる財務費用の増加が著しく、今後さらなる増加が予想されます。このような状況において、管理会社は、ファンドを償還することが受益者の最善の利益に適うという結論に至り、2019年5月30日にファンドを償還いたしました。