

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	令和2年4月27日
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	植松 克彦
【電話番号】	03-5405-0784
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	大和住銀ノウエリントン・ワールド・ボンド(SMA専用)
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年8月13日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。なお、2020年2月13日付および2020年2月26日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。）について、運用の基本方針における投資態度にかかる信託約款の変更が決定したことに伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正箇所および訂正事項】

第一部【証券情報】

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(12)その他

(以下略)

日本以外の地域における発行
ありません。

信託約款変更手続きの実施について

当ファンドの主要投資対象である「ワールド・ボンド・マザーファンド」の運用手法を安定したトータル・リターンを追求するものから、新たに設定するベンチマーク（FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算））に対して中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指すものに変更するため、運用の基本方針における投資態度にかかる信託約款の変更が行われる予定です。このため、当ファンドの信託約款において、当該マザーファンドを通じて実現される運用内容に関する記載に同様の変更を行うものです。

・信託約款の変更内容（新旧対照表）

大和住銀 / ウェリントン・ワールド・ボンド（SMA専用）

新	旧
運用の基本方針 < 略 >	運用の基本方針 < 略 >
2. 運用方法 < 略 >	2. 運用方法 < 略 >
(2) 投資態度 ワールド・ボンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主に世界のソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。	(2) 投資態度 ワールド・ボンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。
世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。	世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。
FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算）をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。	[新 設]
— [略]	— [略]
— [略]	— [略]
— [略]	— [略]
— [略]	— [略]
— [略]	— [略]
— [略]	— [略]

この信託約款の変更は、2020年2月28日現在の受益者による書面決議によるものとします。

2020年4月20日実施の書面決議において、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって可決された場合、2020年4月28日付で信託約款が変更されます。

ただし、この信託約款の変更は、「ワールド・ボンド・マザーファンド」の信託約款の変更が前提となります。また、「ワールド・ボンド・マザーファンド」の信託約款の変更は、同マザーファンドを投資対象とするすべてのファンドの信託約款の変更の成立が前提となります。従いまして、「ワールド・ボンド・マザーファンド」を投資対象とする当ファンド以外のファンドにおいて信託約款の変更が不成立となった場合には、当ファンドの信託約款の変更も行いません。

なお、2020年2月27日以降に、当ファンドの購入申込みをされることにより取得された受益権については、議決権はございません。

当ファンドの購入申込みの際は、上記の信託約款変更手続きの内容をご理解のうえ、お申込みください。

<訂正後>

(12)その他

(以下略)

日本以外の地域における発行
ありません。

第二部【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

ファンドの目的

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）へ投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

信託約款変更が成立した場合、2020年4月28日以降は以下の通りとなります。

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主に世界のソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）へ投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

<訂正後>

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて、主に世界のソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）へ投資することにより、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ファンドの特色

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

1 ワールド・ボンド・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界のソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。

2 世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。

●FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

※ FTSE世界国債インデックス(除く日本)とは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)とは、米ドルベースのFTSE世界国債インデックス(除く日本)を委託会社が円換算したものです。

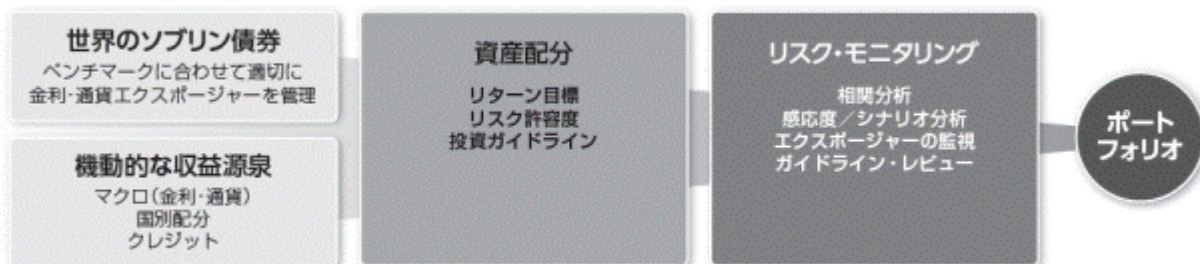
3 実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。

4 マザーファンドにおける運用指図にかかる権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

<ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドについて>

- ・ウエリントン・マネージメント・グループ・エルエルピーはその起源を1928年に遡る、米国で最も歴史のある大手独立系運用会社のひとつです。
- ・ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー(所在地:米国マサチューセッツ州ボストン)およびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッド(所在地:英国ロンドン)は、ウエリントン・マネージメント・グループ・エルエルピーが間接的に100%出資する法人です。
- ・60か国以上にわたる機関投資家顧客ならびにミューチュアル・ファンド・スポンサー向けに、米国ならびにグローバルの株式、債券、マルチアセットなどのポートフォリオを運用しています。

〈運用プロセス〉

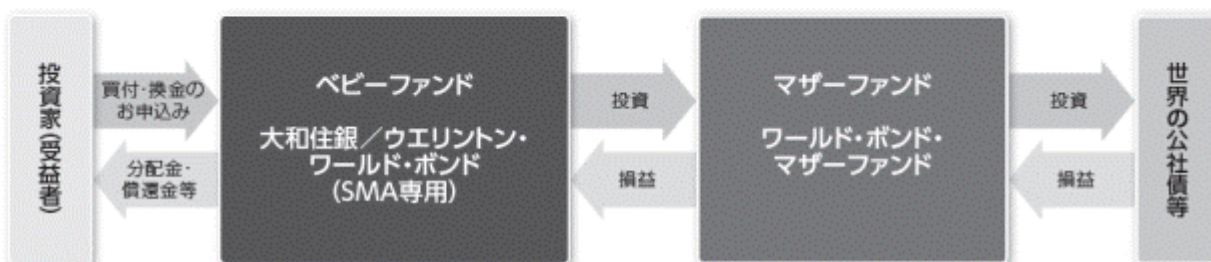


※運用プロセスは将来変更される場合があります。

ファンドの仕組み

運用はファミリーファンド方式で行います。

ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様からご投資いただいた資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。なお、ベビーファンドから有価証券等に直接投資する場合があります。



※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) ファンドの沿革

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

- 2015年5月12日 信託契約締結
- 2015年5月12日 当ファンドの設定・運用開始
- 2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継

< 訂正後 >

- 2015年5月12日 信託契約締結
- 2015年5月12日 当ファンドの設定・運用開始
- 2019年4月1日 ファンドの委託会社としての業務を大和住銀投信投資顧問株式会社から三井住友D Sアセットマネジメント株式会社へ承継
- 2020年4月28日 運用手法を安定したトータル・リターンを追求するものから中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指すものに変更

2 投資方針

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(1) 投資方針

ワールド・ボンド・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界の中核的なソブリン債券（準ソブリン債券も含まれます。）への実質的な投資を行います。

・中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。

世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

信託約款変更が成立した場合、2020年4月28日以降は以下の通りとなります。

ワールド・ボンド・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界のソブリン債券(準ソブリン債券も含みます。)への実質的な投資を行います。

世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(以下略)

(参考)マザーファンドの投資方針

ワールド・ボンド・マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(以下略)

(2)運用方法

(以下略)

投資態度

イ. 主に世界の中核的なソブリン債券(準ソブリン債券も含みます。)への投資を行います。

・中核的ソブリン債券の選定基準は、主に投資適格相当のソブリン債券の中から、安定的もしくは改善している信用力、バリュエーション、流動性を考慮して決定します。

ロ. 世界のソブリン債券を中核とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れることで、安定したトータル・リターンを追求します。

ハ. 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

ニ. 運用指図にかかる権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

ホ. 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

信託約款変更が成立した場合、2020年4月28日以降は以下の通りとなります。

イ. 主に世界のソブリン債券(準ソブリン債券も含みます。)への投資を行います。

ロ. 世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。

ハ. FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

ニ. 組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

ホ．運用指図にかかる権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

ヘ．資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
(以下略)

<訂正後>

(1)投資方針

ワールド・ボンド・マザーファンドへの投資を通じて、主に世界のソブリン債券(準ソブリン債券も含みます。)への実質的な投資を行います。

世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(以下略)

(参考)マザーファンドの投資方針

ワールド・ボンド・マザーファンドの信託約款の運用の基本方針の概要

(以下略)

(2)運用方法

(以下略)

投資態度

イ．主に世界のソブリン債券(準ソブリン債券も含みます。)への投資を行います。

ロ．世界のソブリン債券を中心とするポートフォリオを構築しつつ、公社債や通貨を対象とした機動的アクティブ戦略を組み入れます。

ハ．FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。

ニ．組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

ホ．運用指図にかかる権限をウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッドへ委託します。

ヘ．資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
(以下略)

[次へ](#)

3 投資リスク

<その他の留意点>

下線部は訂正部分を示します。

<訂正前>

(2) 繰上償還について

当ファンドは、信託財産の受益権の残存口数が30億口を下回ることとなった場合等には、繰上償還されることがあります。

(3) 換金請求の受付に関する留意点

(以下略)

(4) クーリング・オフについて

(以下略)

(5) 法令・税制・会計等の変更可能性について

(以下略)

(6) その他

委託会社は投資顧問会社(ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッド)に対して、マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

信託約款変更が成立した場合、2020年4月28日以降、以下が追加されます。

・ベンチマークに関する留意点

当ファンドは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとします。当ファンドの投資成果は、ベンチマークを上回る場合がある一方で下回る場合もあります。したがって、当ファンドはベンチマークに対して一定の成果をあげることを保証するものではありません。

<訂正後>

(2) 繰上償還について

当ファンドは、信託財産の受益権の残存口数が30億口を下回ることとなった場合等には、繰上償還されることがあります。

(3) ベンチマークに関する留意点

当ファンドは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算)をベンチマークとします。当ファンドの投資成果は、ベンチマークを上回る場合がある一方で下回る場合もあります。したがって、当ファンドはベンチマークに対して一定の成果をあげることを保証するものではありません。

(4) 換金請求の受付に関する留意点

(以下略)

(5) クーリング・オフについて

(以下略)

(6) 法令・税制・会計等の変更可能性について

(以下略)

(7) その他

委託会社は投資顧問会社(ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーおよびウエリントン・マネージメント・インターナショナル・リミテッド)に対して、マザーファンドの運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

[次へ](#)

5 運用状況

(参考情報)

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

2019年11月29日現在

基準価額・純資産の推移 (設定日～2019年11月29日)



分配の推移

2019年5月	0円
2018年5月	0円
2017年5月	0円
2016年5月	0円
設定来累計	0円

* 分配金は1万口当たり、税引前

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
ワールド・ボンド・マザーファンド	100.1%

■参考情報

ワールド・ボンド・マザーファンド
上位10銘柄

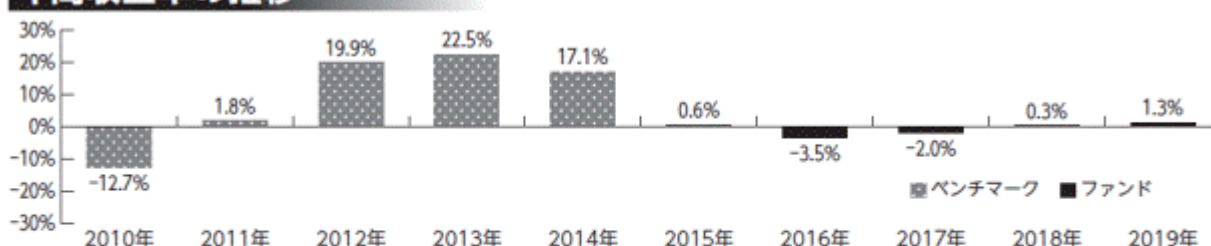
	投資銘柄	種別	投資比率
1	KINGDOM OF DENMARK 0.25 11/15/20	国債証券	9.6%
2	US TREASURY N/B 1.375 04/30/20	国債証券	5.1%
3	NEW ZEALAND GOVERNMENT 2.75 04/15/25	国債証券	5.0%
4	CANADIAN GOVERNMENT 2.25 03/01/24	国債証券	4.9%
5	860 国庫短期証券	国債証券	3.9%
6	SWEDISH GOVERNMENT 0.75 11/12/29	国債証券	3.8%
7	CANADIAN GOVERNMENT 1.5 06/01/26	国債証券	3.3%
8	DENMARK TREASURY BILL 0 12/02/19	国債証券	3.2%
9	CANADIAN GOVERNMENT 0.75 03/01/21	国債証券	3.1%
10	US TREASURY N/B 2.125 07/31/24	国債証券	3.0%

* 投資比率は全て純資産総額対比

債券種別構成

種別	投資比率
国債証券	78.7%
社債券	10.2%
特殊債券	0.6%
地方債証券	0.2%

年間収益率の推移



* ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2015年は当初設定日(2015年5月12日)から年末までの収益率、2019年は11月末までの収益率です。

* ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したものと計算しております。

* 2010年から2014年はベンチマークの年間収益率を表示しております。

* ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

(注) 当ファンドは、2020年4月28日を適用日として投資方針の変更を行っており、上記は変更前の投資方針による運用実績となります。また、ベンチマークは変更後の投資方針のものとなります。

- ・ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

以上

前へ