

茨城ファンド (愛称：コラボいばらき)

運用報告書 (全体版) 第21期

(決算日 2023年7月31日)

(作成対象期間 2022年7月30日~2023年7月31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。

当ファンドは、茨城企業の株式に投資し、中長期的な信託財産の成長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/>

★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/国内/株式	
信託期間	無期限 (設定日: 2002年7月30日)	
運用方針	信託財産の成長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	茨城マザーファンドの受益証券
	茨城マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
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
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
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、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、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。	

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX(配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
17期末(2019年7月29日)	円 11,496	円 0	% △13.5	2,365.16	% △ 9.2	% 92.9	% 6.7	百万円 3,741
18期末(2020年7月29日)	11,652	50	1.8	2,396.40	1.3	92.0	7.4	3,762
19期末(2021年7月29日)	12,962	1,400	23.3	3,045.52	27.1	97.7	2.6	4,124
20期末(2022年7月29日)	13,009	170	1.7	3,140.07	3.1	96.1	3.4	4,185
21期末(2023年7月31日)	14,332	1,100	18.6	3,861.80	23.0	97.5	2.3	4,749

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 株式および株式先物の組入比率は、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4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

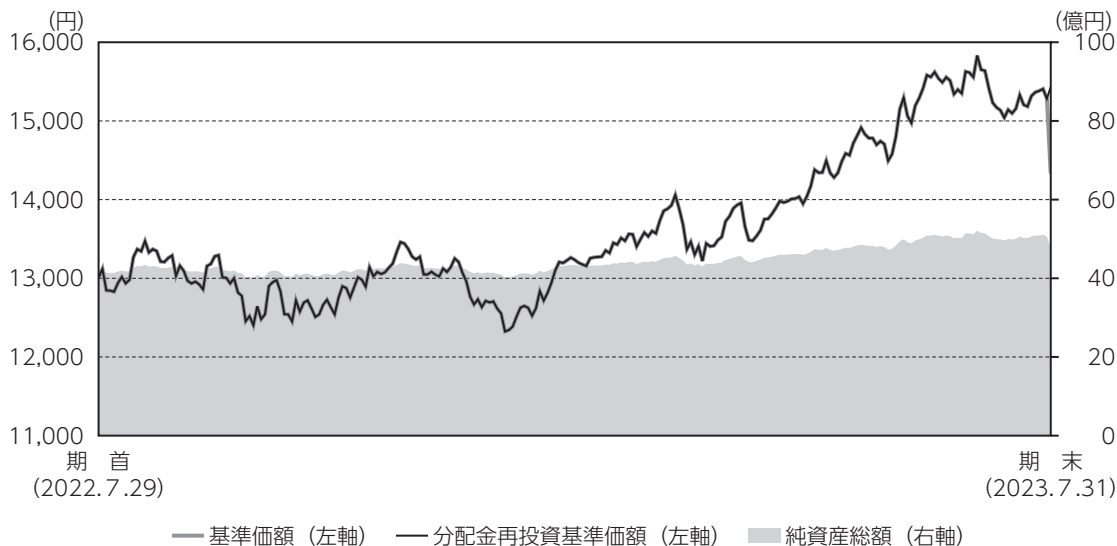
※参考指数を「TOPIX」から「TOPIX (配当込み)」に変更しました。

配当込みTOPIX（本書類における「TOPIX (配当込み)」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負わない。



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はありません。

*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

期首：13,009円

期末：14,332円（分配金1,100円）

騰落率：18.6%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

茨城企業（※）の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行った結果、国内株式市況の上昇を反映して、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。

※株式公開企業に限る。茨城県内に本社を置いている企業と、茨城県に進出し雇用を創出している企業。

茨城ファンド

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2022年 7月29日	円 13,009	% -	3,140.07	% -	% 96.1	% 3.4
8月末	13,094	0.7	3,177.98	1.2	96.0	3.4
9月末	12,480	△ 4.1	3,003.39	△ 4.4	95.1	4.2
10月末	12,754	△ 2.0	3,156.44	0.5	94.5	4.7
11月末	13,239	1.8	3,249.61	3.5	94.4	4.7
12月末	12,553	△ 3.5	3,101.25	△ 1.2	94.2	5.1
2023年 1月末	13,235	1.7	3,238.48	3.1	94.1	5.1
2月末	13,532	4.0	3,269.12	4.1	94.7	4.6
3月末	13,890	6.8	3,324.74	5.9	94.1	5.3
4月末	14,171	8.9	3,414.45	8.7	93.2	6.1
5月末	14,494	11.4	3,537.93	12.7	94.3	5.0
6月末	15,557	19.6	3,805.00	21.2	93.9	5.4
(期末) 2023年 7月31日	15,432	18.6	3,861.80	23.0	97.5	2.3

(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

(2022.7.30~2023.7.31)

■国内株式市況

国内株式市況は、一進一退で推移した後、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、コロナ禍からの経済活動再開や米国のインフレ率ピークアウトへの期待感などを受けて堅調に始まりましたが、2022年9月には、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化の動きが本格化したこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見通しにより日本株見直しの動きが強まったこと、仕入れ価格上昇の一服や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたことなどから、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■茨城マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

ポートフォリオについて

(2022.7.30~2023.7.31)

■当ファンド

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率は、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。

■茨城マザーファンド

運用の基本方針に基づき、茨城企業に投資を行いました。

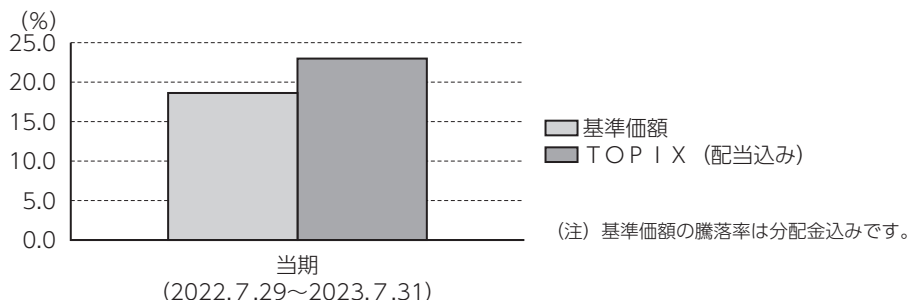
茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

株式の業種別構成は、食料品や機械、化学の組入比率がTOPIXに比べて高くなっております。また、当作成期を通じて通常の状態での株式の実質組入比率（株式先物を含む。）を98~100%程度としました。

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を設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



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	当 期	
	2022年7月30日 ～2023年7月31日	
当期分配金（税込み）	(円)	1,100
対基準価額比率	(%)	7.13
当期の収益	(円)	1,100
当期の収益以外	(円)	-
翌期繰越分配対象額	(円)	4,332

(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。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	344.04円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	2,017.66
(c) 収益調整金		1,049.58
(d) 分配準備積立金		2,020.88
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		5,432.17
(f) 分配金		1,100.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		4,332.17

(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

「茨城マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■茨城マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.7.30~2023.7.31)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	148円	1.084%	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13,640円です。
(投 信 会 社)	(75)	(0.553)	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)	(60)	(0.442)	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)	(12)	(0.088)	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	0	0.001	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
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	0.005	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
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	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
合 計	149	1.091	

(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。

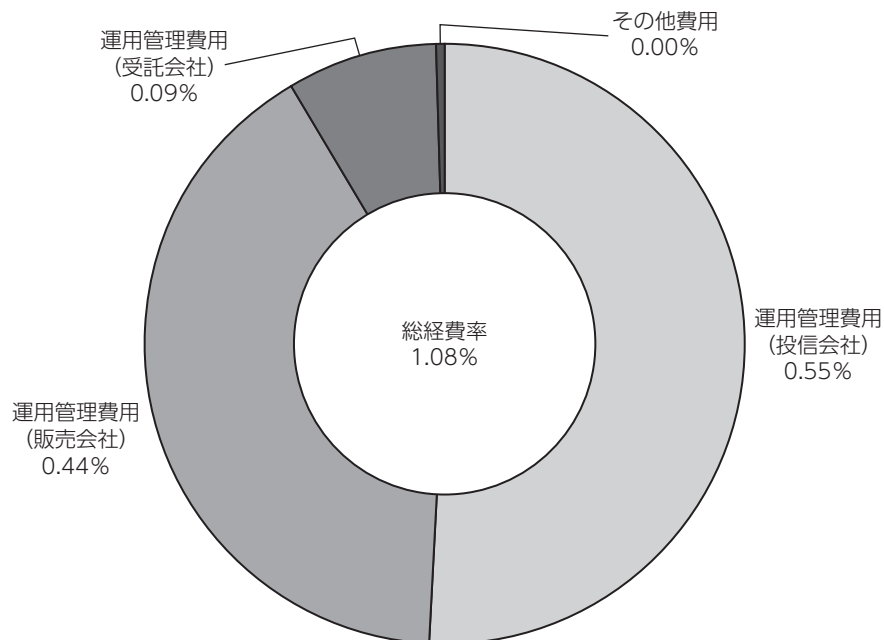
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.08%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。

■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

(2022年7月30日から2023年7月31日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
茨城マザーファンド	67,140	225,210	59,798	196,160

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年7月30日から2023年7月31日まで)

項 目	当 期
	茨 城 マ ザ ー フ ァ ン ド
(a) 期中の株式売買金額	491,835千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,530,899千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.10

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 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	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千□	千円
茨城マザーファンド	1,367,616	1,374,959	5,103,713	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月31日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
茨城マザーファンド	5,103,713	99.3
コール・ローン等、その他	35,487	0.7
投資信託財産総額	5,139,200	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,139,200,776円
コール・ローン等	35,487,294
茨城マザーファンド(評価額)	5,103,713,482
(B) 負債	389,866,809
未払収益分配金	364,513,281
未払信託報酬	25,224,261
その他未払費用	129,267
(C) 純資産総額(A - B)	4,749,333,967
元本	3,313,757,101
次期繰越損益金	1,435,576,866
(D) 受益権総口数	3,313,757,101口
1万口当り基準価額(C/D)	14,332円

*期首における元本額は3,217,244,596円、当作成期間中における追加設定元本額は200,109,436円、同解約元本額は103,596,931円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は14,332円です。

■損益の状況

当期 自2022年7月30日 至2023年7月31日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 9,616円
受取利息	180
支払利息	△ 9,796
(B) 有価証券売買損益	830,985,778
売買益	843,444,424
売買損	△ 12,458,646
(C) 信託報酬等	△ 48,363,030
(D) 当期損益金(A + B + C)	782,613,132
(E) 前期繰越損益金	669,670,987
(F) 追加信託差損益金	347,806,028
(配当等相当額)	(328,747,050)
(売買損益相当額)	(19,058,978)
(G) 合計(D + E + F)	1,800,090,147
(H) 収益分配金	△ 364,513,281
次期繰越損益金(G + H)	1,435,576,866
追加信託差損益金	347,806,028
(配当等相当額)	(328,747,050)
(売買損益相当額)	(19,058,978)
分配準備積立金	1,087,770,838

(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。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	114,007,769円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	668,605,363
(c) 収益調整金	347,806,028
(d) 分配準備積立金	669,670,987
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,800,090,147
(f) 分配金	364,513,281
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,435,576,866
(h) 受益権総口数	3,313,757,101口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	1,100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。

茨城マザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2023年7月31日)

(作成対象期間 2022年7月30日～2023年7月31日)

茨城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。

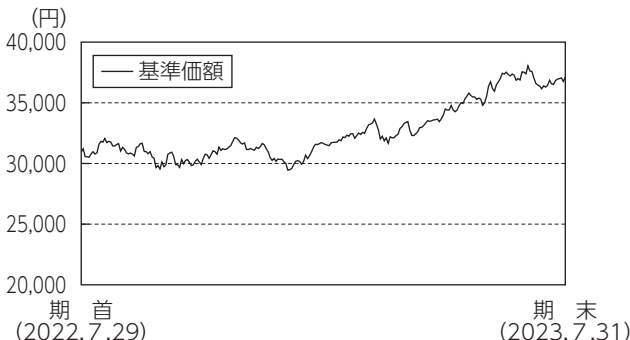
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

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/>

■当学期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		TOPIX(配当込み)		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
(期首)2022年7月29日	30,940	-	3,140.07	-	%	95.1	%	3.4
8月末	31,174	0.8	3,177.98	1.2	%	96.2	%	3.4
9月末	29,736	△ 3.9	3,003.39	△ 4.4	%	95.2	%	4.2
10月末	30,417	△ 1.7	3,156.44	0.5	%	94.7	%	4.7
11月末	31,604	2.1	3,249.61	3.5	%	94.6	%	4.7
12月末	29,990	△ 3.1	3,101.25	△ 1.2	%	94.4	%	5.1
2023年1月末	31,653	2.3	3,238.48	3.1	%	94.3	%	5.1
2月末	32,392	4.7	3,269.12	4.1	%	94.9	%	4.6
3月末	33,281	7.6	3,324.74	5.9	%	94.3	%	5.3
4月末	33,984	9.8	3,414.45	8.7	%	93.4	%	6.1
5月末	34,794	12.5	3,537.93	12.7	%	94.5	%	5.0
6月末	37,385	20.8	3,805.00	21.2	%	94.1	%	5.4
(期末)2023年7月31日	37,119	20.0	3,861.80	23.0	%	90.8	%	2.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

※参考指数を「TOPIX」から「TOPIX(配当込み)」に変更しました。

《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：30,940円 期末：37,119円 騰落率：20.0%

【基準価額の主な変動要因】

茨城企業(※)の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行った結果、国内株式市況の上昇を反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご覧ください。

※株式公開企業に限る。茨城県内に本社を置いている企業と、茨城県に進出し雇用を創出している企業。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、一進一退で推移した後、当学期末にかけて大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当学期期首より、コロナ禍からの経済活動再開や米国のインフレ率ピークアウトへの期待感などを受けて堅調に始まりましたが、2022年9月には、英国の財政悪化や欧米の金利上

昇などが嫌気され、月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化の動きが本格化したこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見直しにより日本株見直しの動きが強まったこと、仕入れ価格上昇や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたことなどから、当学期末にかけて大幅に上昇しました。

◆前学期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

運用の基本方針に基づき、茨城企業に投資を行いました。

茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

株式の業種別構成は、食料品や機械、化学の組入比率がTOPIXに比べて高くなっております。また、当学期を通じて通常の状態での株式の実質組入比率(株式先物を含む。)を98~100%程度としました。

◆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を設けておりません。

当学期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当学期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、茨城企業の株式へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)
有価証券取引税	-
その他費用	-
合 計	0

(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

(1) 株 式

(2022年7月30日から2023年7月31日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 89.9 (116.4)	千円 175,520 (-)	千株 200.8	千円 316,314

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2022年7月30日から2023年7月31日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 1,193	百万円 1,293	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2022年7月30日から2023年7月31日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
日本製鉄		42	91,771	2,185	コンコルディア・フィナンシャル		54.7	24,293	444
出光興産		13.2	48,656	3,686	信越化学		4.3	24,271	5,644
アズワン		1.8	11,540	6,411	日立		3	24,229	8,076
NOK		7.7	9,412	1,222	ケーズホールディングス		14.7	19,078	1,297
クレハ		0.9	8,731	9,701	日野自動車		26	16,343	628
シンニッタン		24.3	5,408	222	アステラス製薬		5.4	10,881	2,015
					ダイキン工業		0.4	10,497	26,243
					セブン&アイ・HLDGS		1.5	8,551	5,701
					ファナック		1	8,230	8,230
					ニッセイ		14.1	8,038	570

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
		千株	千株		千株	千円			千株	千株		千株	千円			千株	千株		千株	千円
水産・農林業 (-)							ツムラ	3.5	3.3	8,730				しまむら	1.7	1.6	22,536			
ニッスイ	14.1	-	-				サワイグループHD	2	1.9	6,735				ヤオコー	1.8	1.7	12,744			
建設業 (5.0%)							石油・石炭製品 (0.8%)							ケーズホールディングス	101.7	87	113,535			
住友林業	9.1	8.8	30,175				出光興産	-	13	39,000				銀行業 (0.5%)						
大和ハウス	30.1	28.7	110,839				ゴム製品 (0.5%)							めびきフィナンシャルG	53.3	47.4	17,888			
積水ハウス	30.9	28.9	83,781				横浜ゴム	7.7	7.4	23,554				コソルディア・フィナンシャル	54.7	-	-			
関電工	9.3	-	-				ガラス・土石製品 (1.0%)							筑波銀行	37.3	35.9	7,933			
日揮ホールディングス	11.7	11.3	22,498				AGC	10.3	9.9	50,846				不動産業 (0.0%)						
暁飯島工業	1	1	1,429				ニチアス	3.1	-	-				香陵住販	0.6	1.2	1,599			
食料品 (13.2%)							鉄鋼 (3.1%)							合計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数 80銘柄	株数 80銘柄	金額 4,948,228	金額 <90.8%>	
山崎製パン	10	9.6	19,699				日本製鉄	-	41.4	134,384				(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。						
カルビー	6.1	5.8	16,016				丸一鋼管	4.2	3.7	12,454				(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。						
森永乳業	2.3	2.1	10,073				シンニッタン	-	23.9	6,142				(注3) 評価額の単位未満は切捨て。						
ヤマト	7.7	7.4	58,452				非鉄金属 (1.6%)													
明治ホールディングス	6.9	12.8	42,086				三菱マテリアル	5.9	5.7	14,483										
日本ハム	4.7	4.5	18,468				住友電工	35.9	34.6	62,972										
伊藤ハム米久HLDGS	13.4	12.5	9,025				金属製品 (0.4%)													
アサヒグループホールディング	22.9	22.1	123,649				東洋製罐グループHD	9.2	8	18,492										
キリンHD	41.3	39.8	83,679				機械 (18.2%)													
不二製油グループ	4	3.8	7,620				SMC	3	2.9	215,035										
キューピー	6.8	6.2	14,306				小松製作所	44	42.4	168,073										
カゴメ	4.3	4.1	12,997				日立建機	9.7	9.4	40,015										
日清食品HD	4.8	4.5	54,000				クボタ	54.6	51.8	111,085										
日本たばこ産業	60.3	58	182,874				ダイキン工業	13.2	12.8	367,232										
繊維製品 (1.1%)							電気機器 (18.1%)													
東レ	73.7	71	56,459				日立	43.8	40.8	379,358										
パルプ・紙 (0.2%)							富士電機	6.7	6.5	41,717										
レンゴー	12.3	11.8	10,684				安川電機	12.1	11.6	71,583										
化学 (16.9%)							ファナック	9.1	43.7	190,007										
クラレ	16	15.4	22,014				キヤノン	60.3	58.1	213,401										
住友化学	74.8	72.1	31,587				輸送用機器 (0.3%)													
フレハ	-	0.9	7,641				日野自動車	26	-	-										
信越化学	18.8	88.1	412,219				NOK	-	7.5	16,035										
エア・ウォーター	10.4	10	20,000				精密機器 (0.9%)													
カネカ	3.1	3	12,546				助川電気工業	2.7	2.6	3,224										
三菱瓦斯化学	10.2	9.7	20,646				東京精密	1.9	1.8	14,166										
J S R	10.2	9.1	37,055				ニコン	17.1	15.3	28,702										
三菱ケミカルグループ	68.1	65.6	55,727				その他製品 (1.3%)													
積水化学	21.3	19.7	42,532				大日本印刷	14.3	12.7	51,295										
アイカ工業	3.1	2.9	9,790				ビジョン	5.5	5.3	10,176										
日本化薬	8	7.4	9,697				日本アイ・エス・ケイ	0.8	0.8	1,005										
A D E K A	4.7	4.5	12,948				オカムラ	4.5	-	-										
日油	3.8	3.6	22,071				情報・通信業 (0.0%)													
花王	21.5	20.3	109,660				アクモス	4.6	4.4	1,716										
D I C	4.3	4.1	10,992				卸売業 (0.2%)													
医薬品 (7.5%)							アズワン	-	1.8	10,168										
アステラス製薬	84.2	78.8	163,943				小売業 (9.1%)													
エーザイ	13.4	12.9	115,790				ジョイフル本田	33.1	29.9	49,215										
小野薬品	23.9	22.5	58,533				セブン&アイ・HLDGS	40.1	38.6	227,469										
久光製薬	3.8	3.7	16,805				JMホールディングス	12.1	11.6	22,492										

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	116	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月31日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,948,228	90.6
コール・ローン等、その他	511,863	9.4
投資信託財産総額	5,460,091	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,586,255,567円
コール・ローン等	330,390,153
株式(評価額)	4,948,228,470
未収入金	160,782,844
未収配当金	20,690,100
差入委託証拠金	126,164,000
(B) 負債	135,096,000
未払解約金	12,000
差入委託証拠金代用有価証券	135,084,000
(C) 純資産総額(A - B)	5,451,159,567
元本	1,468,552,901
次期繰越損益金	3,982,606,666
(D) 受益権総口数	1,468,552,901口
1万口当り基準価額(C/D)	37,119円

* 期首における元本額は1,485,678,798円、当作成期間中における追加設定元本額は67,594,849円、同解約元本額は84,720,746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：
 (FOFs専用) ダイワいばらきファンド (適格機関投資家専用) 93,593,047円
 茨城ファンド 1,374,959,854円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は37,119円です。

■損益の状況

当期 自2022年7月30日 至2023年7月31日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	130,844,653円
受取配当金	130,947,024
受取利息	58
その他収益金	661
支払利息	△ 103,090
(B) 有価証券売買損益	718,244,276
売買益	803,087,521
売買損	△ 84,843,245
(C) 先物取引等損益	61,100,550
取引益	61,100,550
(D) 当期損益金(A + B + C)	910,189,479
(E) 前期繰越損益金	3,111,034,290
(F) 解約差損益金	△ 197,864,254
(G) 追加信託差損益金	159,247,151
(H) 合計(D + E + F + G)	3,982,606,666
次期繰越損益金(H)	3,982,606,666

(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。

配当込みTOPIX (本書類における「TOPIX (配当込み)」をいう。)の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有する。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負わない。