

茨城ファンド (愛称：コラボいばらき)

運用報告書 (全体版) 第20期

(決算日 2022年7月29日)

(作成対象期間 2021年7月30日~2022年7月29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			T O P I X		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			
16期末(2018年7月30日)	円 13,285	円 200	% 7.7	1,768.15	% 9.2	% 95.7	% 4.4	百万円 4,311
17期末(2019年7月29日)	11,496	0	△13.5	1,568.57	△11.3	92.9	6.7	3,741
18期末(2020年7月29日)	11,652	50	1.8	1,549.04	△ 1.2	92.0	7.4	3,762
19期末(2021年7月29日)	12,962	1,400	23.3	1,927.43	24.4	97.7	2.6	4,124
20期末(2022年7月29日)	13,009	170	1.7	1,940.31	0.7	96.1	3.4	4,185

(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。

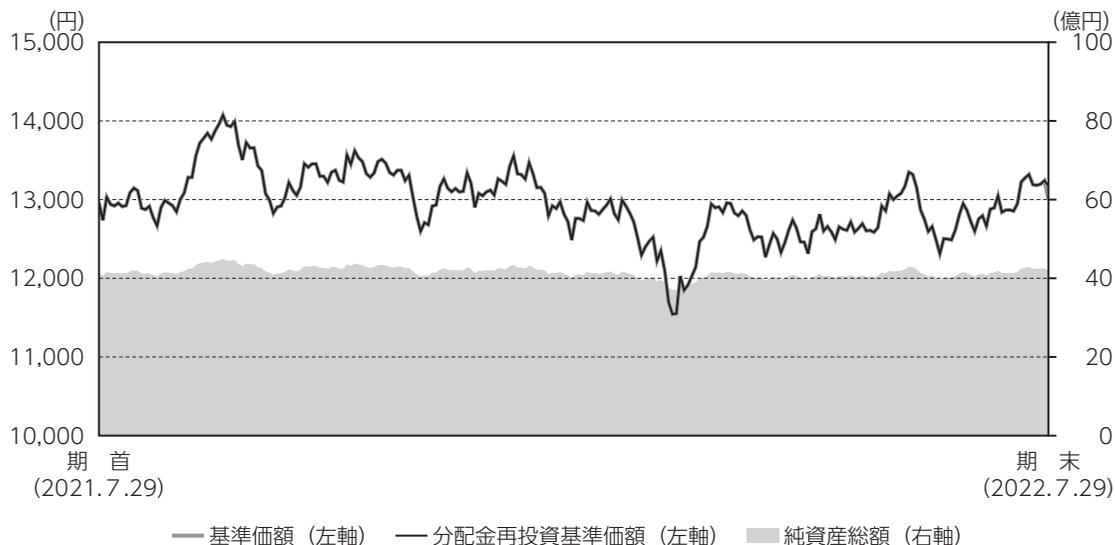
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

東証株価指数（T O P I X）の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。



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：12,962円

期末：13,009円（分配金170円）

騰落率：1.7%（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		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) 2021年 7月29日	円 12,962	% -	1,927.43	% -	% 97.7	% 2.6
7 月末	12,738	△1.7	1,901.08	△1.4	96.4	2.6
8 月末	13,086	1.0	1,960.70	1.7	96.4	3.0
9 月末	13,370	3.1	2,030.16	5.3	96.4	3.1
10月末	13,223	2.0	2,001.18	3.8	95.9	3.5
11月末	12,598	△2.8	1,928.35	0.0	96.0	3.5
12月末	13,194	1.8	1,992.33	3.4	95.7	3.5
2022年 1 月末	12,760	△1.6	1,895.93	△1.6	95.9	3.4
2 月末	12,471	△3.8	1,886.93	△2.1	95.7	3.5
3 月末	12,829	△1.0	1,946.40	1.0	95.0	4.3
4 月末	12,592	△2.9	1,899.62	△1.4	95.2	4.3
5 月末	12,858	△0.8	1,912.67	△0.8	95.3	4.3
6 月末	12,718	△1.9	1,870.82	△2.9	94.9	4.2
(期末) 2022年 7月29日	13,179	1.7	1,940.31	0.7	96.1	3.4

(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

(2021.7.30~2022.7.29)

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染状況が改善したことや自民党総裁選挙への期待感などから、2021年9月半ばにかけて急上昇しました。その後は、新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで反落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感され、11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め加速懸念による金利上昇を受けて世界的に株価が下落する中で、日本株も下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で下落が加速しましたが、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進行したことなどから、3月末にかけて反発しました。その後は、経済活動正常化による内需の回復が鮮明となり反発する局面があった一方、F R Bの利上げペースの加速や景気の先行きに対する懸念などから調整する局面もあり、一進一退の展開となりました。6月半ば以降は、資源価格の上昇が一服してインフレ懸念が後退したことや、F R Bの利上げ幅縮小への期待などから、当作成期末にかけて株価は反発しました。

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

(2021.7.30~2022.7.29)

■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。

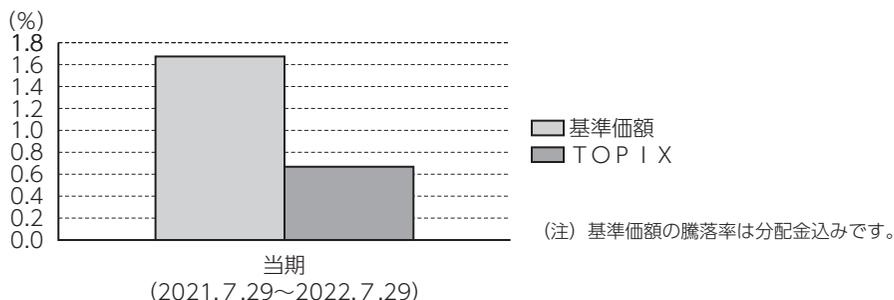
茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

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	
	2021年7月30日 ～2022年7月29日	
当期分配金（税込み） (円)		170
対基準価額比率 (%)		1.29
当期の収益 (円)		170
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		3,011

(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	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	190.70円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		22.54
(c) 収益調整金		863.23
(d) 分配準備積立金		2,105.25
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		3,181.73
(f) 分配金		170.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		3,011.73

(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 (2021.7.30~2022.7.29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	140円	1.078%	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12,952円です。
(投 信 会 社)	(71)	(0.550)	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)	(57)	(0.440)	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)	(11)	(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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(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	140	1.084	

(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。

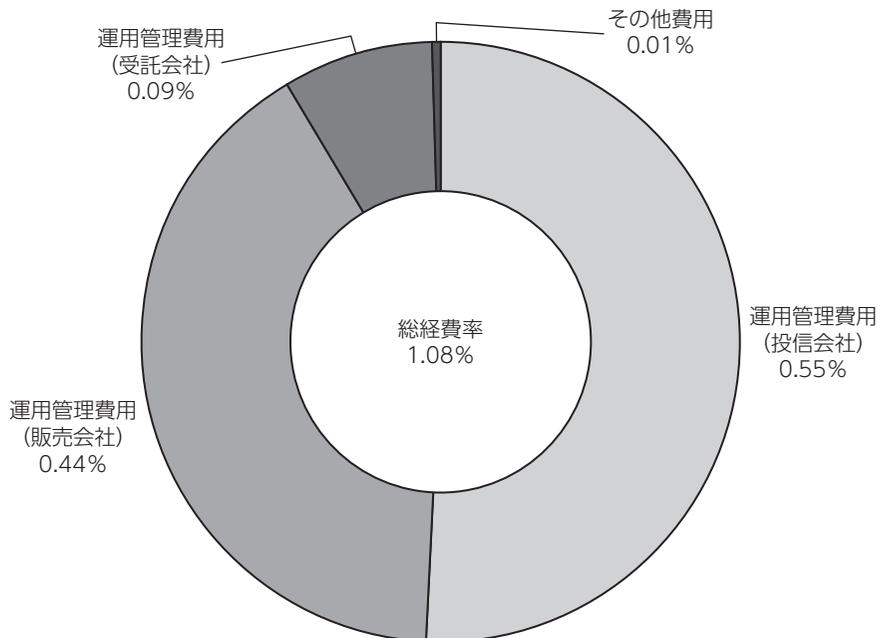
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2021年7月30日から2022年7月29日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
茨城マザーファンド	23,912	72,330	171,244	516,560

(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

(2021年7月30日から2022年7月29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	462,954千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,305,099千円
(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

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年7月30日から2022年7月29日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 219	百万円 219	100.0	百万円 243	百万円 221	90.9
株式先物取引	757	-	-	721	-	-
コール・ローン	39,153	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合91.9%

*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払いはありません。

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
茨城マザーファンド	1,514,949	1,367,616	4,231,406

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年7月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
茨城マザーファンド	4,231,406	99.3
コール・ローン等、その他	30,211	0.7
投資信託財産総額	4,261,618	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

2022年7月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,261,618,313円
コール・ローン等	30,081,430
茨城マザーファンド(評価額)	4,231,406,883
未収入金	130,000
(B) 負債	76,401,729
未払収益分配金	54,693,158
未払解約金	56,916
未払信託報酬	21,540,613
その他未払費用	111,042
(C) 純資産総額(A-B)	4,185,216,584
元本	3,217,244,596
次期繰越損益金	967,971,988
(D) 受益権総口数	3,217,244,596口
1万口当り基準価額(C/D)	13,009円

*期首における元本額は3,181,924,973円、当作成期間中における追加設定元本額は79,625,539円、同解約元本額は44,305,916円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,009円です。

■損益の状況

当期 自2021年7月30日 至2022年7月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,113円
受取利息	77
支払利息	△ 5,190
(B) 有価証券売買損益	113,633,667
売買益	115,783,847
売買損	△ 2,150,180
(C) 信託報酬等	△ 45,021,746
(D) 当期損益金(A + B + C)	68,606,808
(E) 前期繰越損益金	677,311,116
(F) 追加信託差損益金	276,747,222
(配当等相当額)	(277,723,826)
(売買損益相当額)	(△ 976,604)
(G) 合計(D + E + F)	1,022,665,146
(H) 収益分配金	△ 54,693,158
次期繰越損益金(G + H)	967,971,988
追加信託差損益金	276,747,222
(配当等相当額)	(277,723,826)
(売買損益相当額)	(△ 976,604)
分配準備積立金	691,224,766

(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	61,353,223円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	7,253,585
(c) 収益調整金	277,723,826
(d) 分配準備積立金	677,311,116
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,023,641,750
(f) 分配金	54,693,158
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	968,948,592
(h) 受益権総口数	3,217,244,596口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

170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20期 (決算日 2022年7月29日)

(作成対象期間 2021年7月30日～2022年7月29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。

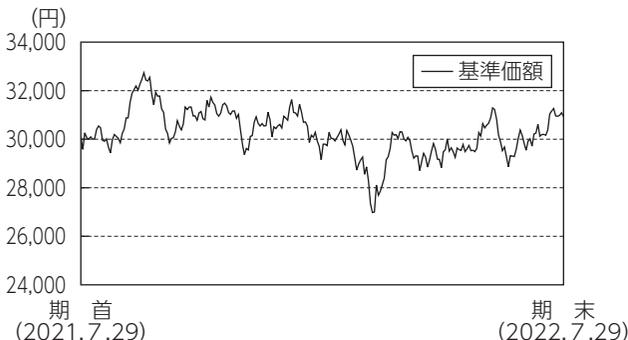
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

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/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額 円	騰 落 率 %	T O P I X (参考指数)		株 式 組 入 率 %	株 先 比 %
			騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2021年7月29日	30,106	-	1,927.43	-	88.3	2.3
7月末	29,582	△1.7	1,901.08	△1.4	97.0	2.6
8月末	30,422	1.0	1,960.70	1.7	96.6	3.0
9月末	31,109	3.3	2,030.16	5.3	96.5	3.1
10月末	30,793	2.3	2,001.18	3.8	96.1	3.5
11月末	29,364	△2.5	1,928.35	0.0	96.2	3.5
12月末	30,782	2.2	1,992.33	3.4	95.9	3.5
2022年1月末	29,796	△1.0	1,895.93	△1.6	96.0	3.4
2月末	29,144	△2.2	1,886.93	△2.1	95.9	3.5
3月末	30,011	△0.3	1,946.40	1.0	95.2	4.4
4月末	29,480	△2.1	1,899.62	△1.4	95.4	4.3
5月末	30,133	0.1	1,912.67	△0.8	95.5	4.3
6月末	29,830	△0.9	1,870.82	△2.9	95.1	4.2
(期末)2022年7月29日	30,940	2.8	1,940.31	0.7	95.1	3.4

(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。

《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：30,106円 期末：30,940円 騰落率：2.8%

【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

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染状況が改善したことや自民党総裁選挙への期待感などから、2021年9月半ばにかけて急上昇しました。その後は、新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで反落しましたが、衆議

院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感され、11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め加速懸念による金利上昇を受けて世界的に株価が下落する中で、日本株も下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で下落が加速しましたが、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進行したことなどから、3月末にかけて反発しました。その後は、経済活動正常化による内需の回復が鮮明となり反発する局面があった一方、F R Bの利上げペースの加速や景気の先行きに対する懸念などから調整する局面もあり、一進一退の展開となりました。6月半ば以降は、資源価格の上昇が一服してインフレ懸念が後退したことや、F R Bの利上げ幅縮小への期待などから、当作成期末にかけて株価は反発しました。

◆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T O P I X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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成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 (株式)	0円 (0)
(先物・オプション)	(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

(2021年7月30日から2022年7月29日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	111.4 (-)	219,132 (-)	127.2	243,822

(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

(2021年7月30日から2022年7月29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	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	757	721	-	-

(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

(2021年7月30日から2022年7月29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
信越化学		0.6	10,841	18,068	日本製鉄		41.5	79,473	1,915
ダイキン工業		0.4	10,565	26,413	日本電気		11.9	66,684	5,603
ADEKA		4.7	10,549	2,244	日立金属		18.7	39,675	2,121
伊藤ハム米久HLDGS		13.4	10,007	746	ジョイフル本田		13.6	21,083	1,550
日立		1.6	9,770	6,106	アルバック		2.2	12,469	5,667
日本化薬		8	9,565	1,195	NOK		7.6	10,018	1,318
東京精密		1.9	8,698	4,578	日本瓦斯		5.2	7,543	1,450
関電工		9.3	8,671	932	シンニッタン		24	5,676	236
ニチアス		3.1	8,484	2,737	ホリイフードサービス		2.5	1,196	478
日本水産		14.1	8,380	594					

(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	
水産・農林業 (0.2%)		千株	千株		千株	千円			千株	千株		千円			千株	千株		千円			
日本水産	-		14.1			8,431	サワイグループHD	1.9	2		8,620	しまむら	1.6	1.7		21,692	ヤオコー	1.7	1.8		11,646
建設業 (5.0%)							横浜ゴム	7.4	7.7		14,914	ケーズホールディングス	98.2	101.7		136,481	銀行業 (1.1%)				
住友林業	8.7	9.1	18,718				ガラス・土石製品 (1.3%)					めびきフィナンシャルG	51.4	53.3		14,284	コソルディア・フィナンシャル	52.8	54.7		24,669
大和ハウス	29.1	30.1	99,119				AGC	9.9	10.3		49,749	筑波銀行	36	37.3		7,310	不動産業 (0.0%)				
積水ハウス	29.9	30.9	72,800				ニチアス	-	3.1		7,334	香陵住販	0.6	0.6		1,172	合計	株数、金額	1,559.2	1,543.4	4,370,777
関電工	-	9.3	7,672				鉄鋼 (0.3%)					銘柄数<比率>	80銘柄	80銘柄	<95.1%>						
日揮ホールディングス	11.3	11.7	19,106				日本製鉄	41.5	-		-	(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。								
暁飯島工業	1	1	1,344				丸一鋼管	4.1	4.2		12,343	(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。								
食料品 (13.9%)							日立金属	18.7	-		-	(注3)	評価額の単位未満は切捨て。								
山崎製パン	9.6	10	16,080				シンニツタン	24	-		-										
カルビー	5.8	6.1	17,409				非鉄金属 (1.5%)														
森永乳業	2.2	2.3	11,270				三菱マテリアル	5.7	5.9		11,859	(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)									
ヤフルト	7.5	7.7	62,370				住友電工	34.6	35.9		52,898	銘柄別	当期末								
明治ホールディングス	6.7	6.9	47,955				金属製品 (0.3%)					国内	買建額	百万円	百万円						
日本ハム	4.5	4.7	18,917				東洋製罐グループHD	8.9	9.2		14,039	国内	売建額	155	-						
伊藤ハム米久HL DGS	-	13.4	8,924				機械 (17.9%)					(注)	単位未満は切捨て。								
アサヒグループホールディング	22.1	22.9	105,798				SMC	2.9	3		196,230										
キリンHD	39.9	41.3	90,261				小松製作所	42.4	44		132,396										
不二製油グループ	3.8	4	9,072				日立建機	9.4	9.7		28,285										
キューピー	6.5	6.8	15,708				クボタ	52.7	54.6		119,765										
カゴメ	4.1	4.3	13,523				ダイキン工業	12.8	13.2		306,900										
日清食品HD	4.6	4.8	46,272				電気機器 (18.0%)														
日本たばこ産業	58.2	60.3	143,966				日立	42.2	43.8		293,635										
繊維製品 (1.2%)							富士電機	6.5	6.7		39,999										
東レ	71.2	73.7	53,992				安川電機	11.6	12.1		55,962										
パルプ・紙 (0.2%)							日本電気	11.9	-		-										
レンゴー	11.8	12.3	9,544				アルバック	2.2	-		-										
化学 (16.9%)							ファナック	8.8	9.1		207,707										
クラレ	15.5	16	17,072				キヤノン	58.2	60.3		189,402										
住友化学	72.2	74.8	39,045				輸送用機器 (0.4%)														
信越化学	18.2	18.8	318,848				日野自動車	25.1	26		17,862										
エア・ウォーター	10	10.4	18,564				NOK	7.6	-		-										
カネカ	3	3.1	11,129				精密機器 (0.9%)														
三菱瓦斯化学	9.8	10.2	19,624				助川電気工業	2.6	2.7		3,213										
J S R	9.9	10.2	37,383				東京精密	-	1.9		8,730										
三菱ケミカルグループ	65.7	68.1	50,714				ニコン	16.5	17.1		26,026										
積水化学	20.6	21.3	39,703				その他製品 (1.4%)														
アイカ工業	2.9	3.1	9,517				大日本印刷	13.8	14.3		41,899										
日本化薬	-	8	8,920				ビジョン	5.3	5.5		10,642										
ADEKA	-	4.7	11,247				日本アイ・エス・ケイ	0.8	0.8		960										
日油	3.7	3.8	19,912				オカムラ	-	4.5		5,949										
花王	21	21.5	124,377				情報・通信業 (0.0%)														
D I C	4.2	4.3	10,539				アクモス	4.5	4.6		1,628										
医薬品 (8.7%)							小売業 (10.5%)														
アステラス製薬	81.2	84.2	175,767				ホリイフードサービス	2.5	-		-										
エーザイ	12.9	13.4	81,431				ジョイフル本田	45	33.1		51,967										
小野薬品	23.1	23.9	89,338				セブ&アイ・HL DGS	38.7	40.1		217,702										
久光製薬	3.7	3.8	13,148				J Mホールディングス	11.6	12.1		19,456										
ツムラ	3.3	3.5	10,902				日本瓦斯	5.2	-		-										

■投資信託財産の構成

2022年7月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,370,777	95.1
コール・ローン等、その他	227,317	4.9
投資信託財産総額	4,598,095	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

2022年7月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,733,179,688円
コール・ローン等	208,503,598
株式(評価額)	4,370,777,940
未収配当金	18,464,150
差入委託証拠金	135,434,000
(B) 負債	136,466,600
未払金	1,236,600
未払解約金	146,000
差入委託証拠金代用有価証券	135,084,000
(C) 純資産総額(A - B)	4,596,713,088
元本	1,485,678,798
次期繰越損益金	3,111,034,290
(D) 受益権総口数	1,485,678,798口
1万口当り基準価額(C/D)	30,940円

* 期首における元本額は1,647,988,482円、当作成期間中における追加設定元本額は23,968,037円、同解約元本額は186,277,721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) 118,061,835円
 茨城ファンド 1,367,616,963円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は30,940円です。

■損益の状況

当期 自2021年7月30日 至2022年7月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	110,478,084円
受取配当金	110,519,170
受取利息	650
その他収益金	936
支払利息	△ 42,672
(B) 有価証券売買損益	13,061,094
売買益	235,045,573
売買損	△ 221,984,479
(C) 先物取引等損益	3,288,200
取引益	24,910,600
取引損	△ 21,622,400
(D) 当期損益金(A + B + C)	126,827,378
(E) 前期繰越損益金	3,313,373,228
(F) 解約差損益金	△ 377,692,279
(G) 追加信託差損益金	48,525,963
(H) 合計(D + E + F + G)	3,111,034,290
次期繰越損益金(H)	3,111,034,290

(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。

東証株価指数 (TOPIX) の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」といいます。) 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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。