

# 茨城ファンド (愛称：コラボいばらき)

## 運用報告書 (全体版) 第19期

(決算日 2021年7月29日)

(作成対象期間 2020年7月30日~2021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	
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			
15期末(2017年7月31日)	円 12,519	円 600	% 22.7	1,618.61	% 22.4	% 93.7	% 5.8	百万円 4,042
16期末(2018年7月30日)	13,285	200	7.7	1,768.15	9.2	95.7	4.4	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

(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。

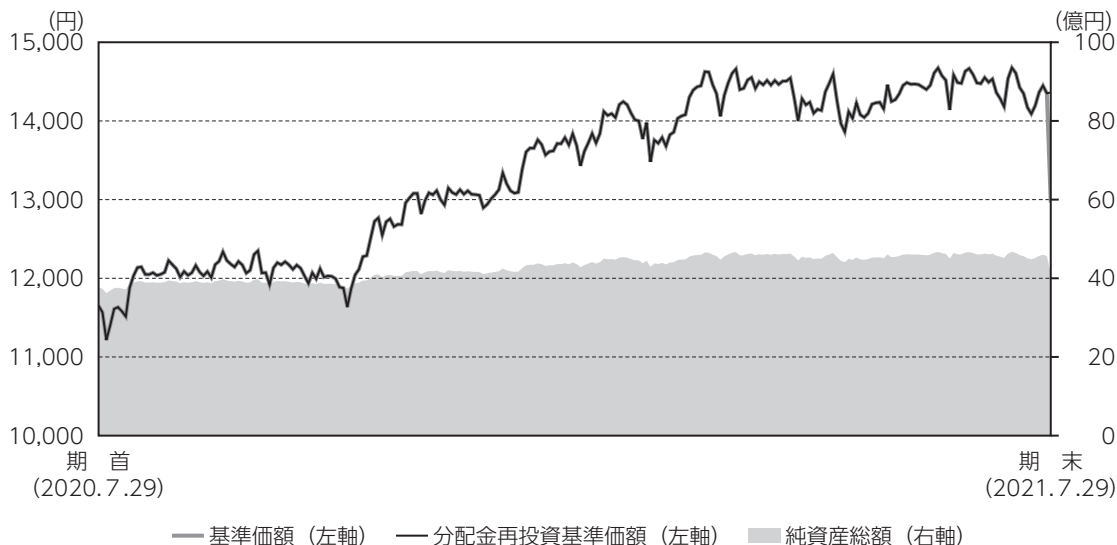
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\* 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

期首：11,652円

期末：12,962円（分配金1,400円）

騰落率：23.3%（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。

※ 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		(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2020年 7月29日	円	%		%	%	%
	11,652	—	1,549.04	—	92.0	7.4
7 月末	11,215	△ 3.8	1,496.06	△ 3.4	91.8	7.5
8 月末	12,087	3.7	1,618.18	4.5	92.0	7.5
9 月末	12,068	3.6	1,625.49	4.9	91.8	7.6
10月末	11,634	△ 0.2	1,579.33	2.0	92.1	7.6
11月末	12,817	10.0	1,754.92	13.3	95.1	4.7
12月末	13,202	13.3	1,804.68	16.5	95.4	3.9
2021年 1 月末	13,430	15.3	1,808.78	16.8	95.9	3.5
2 月末	13,480	15.7	1,864.49	20.4	96.1	3.2
3 月末	14,398	23.6	1,954.00	26.1	95.9	3.5
4 月末	14,133	21.3	1,898.24	22.5	95.9	3.5
5 月末	14,247	22.3	1,922.98	24.1	95.9	3.5
6 月末	14,483	24.3	1,943.57	25.5	95.8	3.5
(期末) 2021年 7月29日	14,362	23.3	1,927.43	24.4	97.7	2.6

(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

(2020.7.30~2021.7.29)

### 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、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことが好感され、株価は強含みで推移しました。その後、5月は米国においてインフレ懸念が高まったこと、6月にはFOMC（米国連邦公開市場委員会）が発表した政策金利見直しから早期の利上げ観測が強まり米国金利が不安定化したことにより、株価が下落する場面があったものの、国内におけるワクチンの接種が順調に進展し始めたこともあり、株価は底堅く推移しました。

## 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

(2020.7.30~2021.7.29)

## ■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。

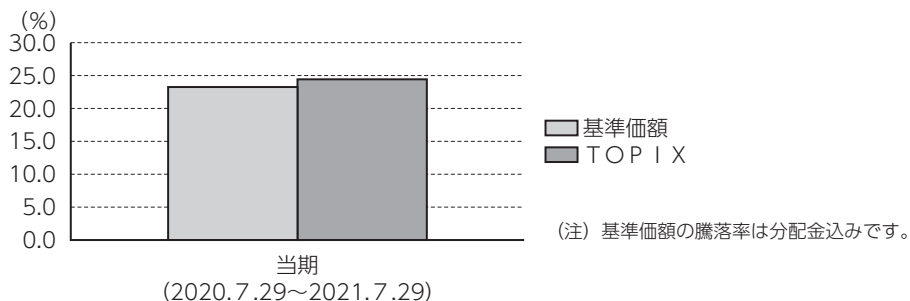
茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

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	
	2020年7月30日 ～2021年7月29日	
<b>当期分配金（税込み）</b> (円)	<b>1,400</b>	
対基準価額比率 (%)	9.75	
当期の収益 (円)	833	
当期の収益以外 (円)	566	
翌期繰越分配対象額 (円)	2,968	

(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	✓	259.17円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	573.95
(c) 収益調整金		809.77
(d) 分配準備積立金	✓	2,725.14
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		4,368.04
(f) 分配金		1,400.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		2,968.04

(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 (2020.7.30~2021.7.29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	144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13,390円です。
(投 信 会 社)	(74)	(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)	(59)	(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)	(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	0.002	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)	(0.002)	
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	0.006	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)	(0.006)	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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	145	1.085	

(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。

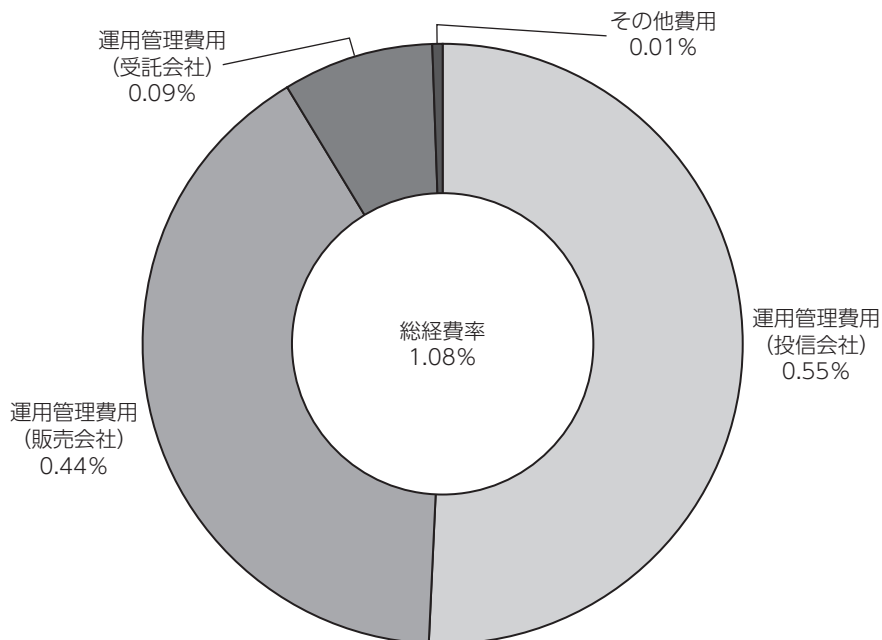
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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。

## 茨城ファンド

### ■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

(2020年7月30日から2021年7月29日まで)

項目	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	16,817	46,060	63,166	169,810

(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

(2020年7月30日から2021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	711,732千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,349,548千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.16

(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	評 価 額
	千□	千□	千円
茨城マザーファンド	1,561,297	1,514,949	4,560,905

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2021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	4,560,905	99.3
コール・ローン等、その他	33,562	0.7
投資信託財産総額	4,594,468	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

2021年7月29日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>4,594,468,394円</b>
コール・ローン等	33,372,935
茨城マザーファンド(評価額)	4,560,905,459
未収入金	190,000
<b>(B) 負債</b>	<b>469,903,250</b>
未払収益分配金	445,469,496
未払解約金	54,617
未払信託報酬	24,255,477
その他未払費用	123,660
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>4,124,565,144</b>
元本	3,181,924,973
次期繰越損益金	942,640,171
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,181,924,973口</b>
<b>1万口当り基準価額(C ÷ D)</b>	<b>12,962円</b>

\* 期首における元本額は3,228,875,918円、当作成期間中における追加設定元本額は37,158,171円、同解約元本額は84,109,116円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,962円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年7月30日 至2021年7月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,332円
受取利息	186
支払利息	△ 6,518
(B) 有価証券売買損益	901,225,231
売買益	913,811,520
売買損	△ 12,586,289
(C) 信託報酬等	△ 46,298,540
(D) 当期損益金(A + B + C)	854,920,359
(E) 前期繰越損益金	277,295,011
(F) 追加信託差損益金	255,894,297
(配当等相当額)	( 257,663,393)
(売買損益相当額)	(△ 1,769,096)
(G) 合計(D + E + F)	1,388,109,667
(H) 収益分配金	△ 445,469,496
次期繰越損益金(G + H)	942,640,171
追加信託差損益金	255,894,297
(配当等相当額)	( 257,663,393)
(売買損益相当額)	(△ 1,769,096)
分配準備積立金	686,745,874

(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	82,466,300円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	182,629,561
(c) 収益調整金	257,663,393
(d) 分配準備積立金	867,119,509
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,389,878,763
(f) 分配金	445,469,496
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	944,409,267
(h) 受益権総口数	3,181,924,973口

## 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

1,400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19期 (決算日 2021年7月29日)

(作成対象期間 2020年7月30日～2021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。

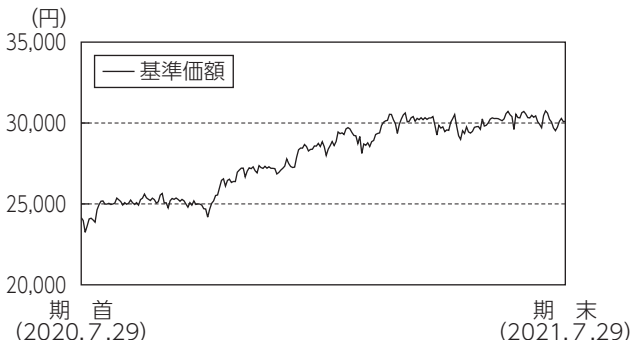
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

## 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		T O P I X		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)2020年7月29日	24,152	% -	1,549.04	% -	%	%	%	%
7月末	23,245	△ 3.8	1,496.06	△ 3.4	92.0	91.8	92.0	7.5
8月末	25,080	3.8	1,618.18	4.5	92.1	92.1	92.1	7.5
9月末	25,061	3.8	1,625.49	4.9	92.0	92.0	92.0	7.6
10月末	24,181	0.1	1,579.33	2.0	92.3	92.3	92.3	7.6
11月末	26,668	10.4	1,754.92	13.3	95.3	95.3	95.3	4.7
12月末	27,496	13.8	1,804.68	16.5	95.6	95.6	95.6	3.9
2021年1月末	27,996	15.9	1,808.78	16.8	96.1	96.1	96.1	3.5
2月末	28,124	16.4	1,864.49	20.4	96.3	96.3	96.3	3.2
3月末	30,073	24.5	1,954.00	26.1	96.1	96.1	96.1	3.5
4月末	29,544	22.3	1,898.24	22.5	96.1	96.1	96.1	3.5
5月末	29,812	23.4	1,922.98	24.1	96.1	96.1	96.1	3.5
6月末	30,333	25.6	1,943.57	25.5	96.0	96.0	96.0	3.5
(期末)2021年7月29日	30,106	24.7	1,927.43	24.4	88.3	88.3	88.3	2.3

(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：24,152円 期末：30,106円 騰落率：24.7%

## 【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ぐっ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、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移

しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確定となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことなどで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことが好感され、株価は強含みで推移しました。その後、5月は米国においてインフレ懸念が高まったこと、6月にはFOMC（米国連邦公開市場委員会）が発表した政策金利見直しから早期の利上げ観測が強まり米国金利が不安定化したことにより、株価が下落する場面があったものの、国内におけるワクチンの接種が順調に進展し始めたこともあり、株価は底堅く推移しました。

## ◆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。

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 (先物・オプション)	1円 (1)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	1

(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

(2020年7月30日から2021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	82.8 ( 6.1)	207,891 ( -)	188.3	503,841

(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

(2020年7月30日から2021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	1,283	1,535	-	-

(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

(2020年7月30日から2021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
小野薬品		25.1	79,421	3,164	信越化学		2.1	36,116	17,198
住友電工		37.7	46,769	1,240	ダイキン工業		1.1	25,234	22,940
富士電機		7.1	23,960	3,374	日本新薬		3.3	25,044	7,589
ヤオコー		1.9	13,544	7,128	日立		3.8	24,716	6,504
森永乳業		2.4	12,417	5,174	ファナック		0.9	22,834	25,371
日本瓦斯		2	10,950	5,475	SMC		0.3	19,646	65,489
アルバック		2.3	8,899	3,869	ケーズホールディングス		13.8	17,985	1,303
アサヒグループホールディング		1.1	4,459	4,054	エフピコ		4.2	17,980	4,281
日本電気		0.6	3,307	5,512	セブン&アイ・HLDGS		3.4	16,985	4,995
エア・ウォーター		1.5	2,657	1,771	アステラス製薬		8.5	15,869	1,866

(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		
	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			千円			千株	千株			千円
<b>建設業 (4.4%)</b>							<b>ゴム製品 (0.4%)</b>						
NIPPON	5.7	—	—				横浜ゴム	8.1	7.4	16,243			
住友林業	8.7	8.7	17,652				<b>ガラス・土石製品 (1.1%)</b>						
大和ハウス	31.7	29.1	98,940				AGC	10.8	9.9	47,025			
積水ハウス	32.8	29.9	65,062				<b>鉄鋼 (3.1%)</b>						
日揮ホールディングス	12.3	11.3	11,435				日本製鉄	45.2	41.5	78,538			
暁飯島工業	1	1	1,668				丸一鋼管	4.5	4.1	11,020			
<b>食料品 (12.5%)</b>							日立金属	20.4	18.7	40,055			
山崎製パン	10.5	9.6	14,515				シンニツタン	26.1	24	6,048			
カルビー	6.4	5.8	14,853				<b>非鉄金属 (1.5%)</b>						
森永乳業	—	2.2	13,332				三菱マテリアル	6.2	5.7	13,092			
ヤフート	8.1	7.5	47,250				住友電工	—	34.6	54,408			
明治ホールディングス	7.3	6.7	45,694				<b>金属製品 (0.3%)</b>						
日本ハム	4.9	4.5	20,002				東洋製罐グループHD	9.6	8.9	13,127			
アサヒグループホールディングス	23	22.1	111,207				<b>機械 (17.2%)</b>						
キリンHD	43.4	39.9	81,415				SMC	3.2	2.9	189,892			
不二製油グループ	4.2	3.8	9,583				小松製作所	46.2	42.4	121,582			
キューピー	7.1	6.5	16,165				日立建機	10.2	9.4	29,281			
カゴメ	4.7	4.1	11,746				クボタ	58.5	52.7	121,447			
日清食品HD	5	4.6	36,248				ダイキン工業	13.9	12.8	293,120			
日本たばこ産業	63.4	58.2	125,653				<b>電気機器 (18.8%)</b>						
<b>繊維製品 (1.2%)</b>							日立	46	42.2	270,544			
東レ	77.5	71.2	51,961				富士電機	—	6.5	33,800			
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>							安川電機	12.7	11.6	63,104			
レンゴー	12.9	11.8	11,021				日本電気	12.4	11.9	68,901			
<b>化学 (17.2%)</b>							アルパック	—	2.2	11,770			
クラレ	16.9	15.5	15,949				ファナック	9.7	8.8	228,756			
住友化学	78.6	72.2	41,803				キヤノン	63.4	58.2	145,558			
信越化学	20.3	18.2	324,233				<b>輸送用機器 (0.8%)</b>						
エア・ウォーター	9.4	10	16,400				日野自動車	27.3	25.1	23,995			
カネカ	3.2	3	13,215				NOK	8.2	7.6	11,096			
三菱瓦斯化学	11	9.8	22,775				<b>精密機器 (0.4%)</b>						
J S R	10.7	9.9	36,333				助川電気工業	2.8	2.6	2,347			
三菱ケミカルHDGS	71.6	65.7	60,772				ニコン	19.1	16.5	17,077			
積水化学	23	20.6	39,407				<b>その他製品 (1.2%)</b>						
アイカ工業	3.2	2.9	11,310				大日本印刷	15.4	13.8	35,631			
日本化薬	8.4	—	—				ビジョン	5.8	5.3	16,138			
日油	4.1	3.7	20,757				日本アイ・エス・ケイ	0.8	0.8	1,128			
花王	23.2	21	139,902				<b>情報・通信業 (0.0%)</b>						
D I C	4.5	4.2	12,440				アコム	4.9	4.5	1,759			
エフピコ	2.1	—	—				<b>小売業 (10.1%)</b>						
<b>医薬品 (8.5%)</b>							ホリイフードサービス	2.7	2.5	1,212			
アステラス製薬	89.7	81.2	154,848				ジョイフル本田	49.1	45	63,000			
日本新薬	3.3	—	—				セブン&アイ・HDGS	42.1	38.7	189,591			
エーザイ	14.1	12.9	120,086				J Mホールディングス	12.7	11.6	23,524			
小野薬品	—	23.1	58,408				ライトオン	14.1	—	—			
久光製薬	4.5	3.7	18,333				日本瓦斯	—	5.2	9,718			
ツムラ	3.6	3.3	11,550				しまむら	1.8	1.6	17,136			
沢井製薬	2.1	—	—				ヤオコー	—	1.7	11,169			
サワイグループHD	—	1.9	9,034				ケーズホールディングス	111.8	98.2	127,169			

銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
		千株	千株			千円
<b>銀行業 (0.9%)</b>						
めぶきフィナンシャルG	56	51.4	12,130			
コソルディア・フィナンシャル	59.1	52.8	20,908			
筑波銀行	39.2	36	6,156			
<b>不動産業 (0.0%)</b>						
香陵住販	0.5	0.6	1,230			
<b>合計</b>		千株	千株		千円	
株数、金額	1,658.6	1,559.2	4,382,406			
銘柄数<比率>	78銘柄	80銘柄	<88.3%>			

(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。  
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。  
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (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 TOPIX	百万円 115	百万円 —

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,382,406	88.2
コール・ローン等、その他	584,255	11.8
投資信託財産総額	4,966,662	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

2021年7月29日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,101,746,310円</b>
コール・ローン等	558,960,100
株式(評価額)	4,382,406,460
未収配当金	17,085,750
差入委託証拠金	143,294,000
<b>(B) 負債</b>	<b>140,384,600</b>
未払金	5,098,600
未払解約金	202,000
差入委託証拠金代用有価証券	135,084,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>4,961,361,710</b>
元本	1,647,988,482
次期繰越損益金	3,313,373,228
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,647,988,482口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	30,106円

\* 期首における元本額は1,725,692,683円、当作成期間中における追加設定元本額は18,536,106円、同解約元本額は96,240,307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は、(FOFs専用) ダイワいばらきファンド(適格機関投資家専用) 133,039,482円、茨城ファンド1,514,949,000円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は30,106円です。

■損益の状況

当期 自2020年7月30日 至2021年7月29日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>95,816,555円</b>
受取配当金	95,892,890
受取利息	2,555
その他収益金	1,350
支払利息	△ 80,240
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>851,899,324</b>
売買益	993,968,407
売買損	△ 142,069,083
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>58,147,200</b>
取引益	63,615,000
取引損	△ 5,467,800
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 2,731</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>1,005,860,348</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>2,442,180,679</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 167,348,693</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>32,680,894</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>3,313,373,228</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>3,313,373,228</b>

(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。