

兵庫応援バランスファンド (毎月分配型)

運用報告書 (全体版)

第207期 (決算日 2024年1月10日)

第208期 (決算日 2024年2月13日)

第209期 (決算日 2024年3月11日)

第210期 (決算日 2024年4月10日)

第211期 (決算日 2024年5月10日)

第212期 (決算日 2024年6月10日)

(作成対象期間 2023年12月12日~2024年6月10日)

★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／内外／資産複合		
信託期間	2006年9月26日~2026年12月10日		
運用方針	安定した収益の確保および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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券およびわが国の金融商品取引所上場株式	
	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	内外の公社債等	
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	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の50%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
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、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。3、6、9、12月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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、兵庫県企業の株式および海外のソブリン債等に投資し、安定した収益の確保および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/>

最近30期の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X (配当込み)		F T S E 世界国債 インデックス (除く日本、 ヘッジなし・ 円ベース)		株式 組入比率	公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期 騰落率	(参考指数)	期 騰落率	(参考指数)	期 騰落率				
	円	円	%		%		%	%	%	%	百万円
183期末(2022年1月11日)	9,109	15	△0.5	3,170.49	0.7	15,877	△0.4	29.5	68.3	-	1,885
184期末(2022年2月10日)	8,969	15	△1.4	3,132.11	△1.2	15,708	△1.1	29.5	68.0	-	1,856
185期末(2022年3月10日)	8,697	15	△2.9	2,921.72	△6.7	15,455	△1.6	28.7	68.4	-	1,812
186期末(2022年4月11日)	8,918	15	2.7	3,050.43	4.4	15,856	2.6	29.3	68.1	-	1,816
187期末(2022年5月10日)	8,703	15	△2.2	3,006.57	△1.4	15,902	0.3	29.5	68.6	-	1,763
188期末(2022年6月10日)	9,133	15	5.1	3,139.89	4.4	16,265	2.3	30.6	66.7	-	1,870
189期末(2022年7月11日)	9,063	15	△0.6	3,098.28	△1.3	16,164	△0.6	31.0	67.0	-	1,854
190期末(2022年8月10日)	9,277	15	2.5	3,129.28	1.0	16,428	1.6	31.3	66.6	-	1,877
191期末(2022年9月12日)	9,199	15	△0.7	3,205.59	2.4	16,483	0.3	31.4	66.2	-	1,851
192期末(2022年10月11日)	8,658	15	△5.7	3,061.15	△4.5	15,966	△3.1	31.0	66.3	-	1,763
193期末(2022年11月10日)	8,891	15	2.9	3,168.27	3.5	16,306	2.1	30.8	66.6	-	1,799
194期末(2022年12月12日)	8,950	15	0.8	3,203.40	1.1	16,073	△1.4	31.6	66.4	-	1,800
195期末(2023年1月10日)	8,588	15	△3.9	3,083.51	△3.7	15,532	△3.4	31.7	65.6	-	1,718
196期末(2023年2月10日)	8,720	15	1.7	3,257.65	5.6	15,410	△0.8	32.9	64.7	-	1,756
197期末(2023年3月10日)	8,846	15	1.6	3,331.93	2.3	15,626	1.4	34.4	63.1	-	1,776
198期末(2023年4月10日)	8,915	15	0.9	3,279.99	△1.6	15,818	1.2	33.0	64.9	-	1,782
199期末(2023年5月10日)	9,184	15	3.2	3,461.63	5.5	16,105	1.8	34.6	63.1	-	1,819
200期末(2023年6月12日)	9,358	15	2.1	3,717.50	7.4	16,379	1.7	31.8	65.5	-	1,810
201期末(2023年7月10日)	9,462	15	1.3	3,729.74	0.3	16,591	1.3	31.6	65.7	-	1,843
202期末(2023年8月10日)	9,788	15	3.6	3,830.12	2.7	16,935	2.1	30.3	64.1	-	1,854
203期末(2023年9月11日)	9,812	15	0.4	3,925.86	2.5	17,062	0.7	31.3	66.2	-	1,840
204期末(2023年10月10日)	9,615	15	△1.9	3,879.47	△1.2	16,724	△2.0	28.5	68.1	-	1,953
205期末(2023年11月10日)	9,756	15	1.6	3,920.91	1.1	17,344	3.7	27.7	69.8	-	1,970
206期末(2023年12月11日)	9,841	15	1.0	3,959.16	1.0	17,143	△1.2	28.7	67.0	-	1,947
207期末(2024年1月10日)	10,119	15	3.0	4,108.89	3.8	17,465	1.9	30.4	66.3	-	1,927
208期末(2024年2月13日)	10,247	15	1.4	4,390.78	6.9	17,871	2.3	30.4	65.5	-	1,981
209期末(2024年3月11日)	10,217	150	1.2	4,484.64	2.1	17,914	0.2	31.4	65.8	-	1,963
210期末(2024年4月10日)	10,423	15	2.2	4,655.37	3.8	18,241	1.8	31.0	64.9	-	2,034
211期末(2024年5月10日)	10,577	15	1.6	4,630.87	△0.5	18,589	1.9	31.0	65.3	-	2,085
212期末(2024年6月10日)	10,456	250	1.2	4,727.13	2.1	18,785	1.1	31.0	66.3	-	2,112

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 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5) 公社債および債券先物の組入比率は、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6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券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



(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

第207期首：9,841円

第212期末：10,456円（既払分配金460円）

騰落率：11.0%（分配金再投資ベース）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	9.0%	69.3%

■ 基準価額の主な変動要因

国内株式に30%程度、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の受益証券に70%程度投資した結果、国内株式市況が上昇したことや債券からの利息収入がプラス要因となり、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。

兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）

	年 月 日	基準価額		T O P I X (配当込み)		F T S E 世界国債 インデックス (除く日本、 ヘッジなし・円ベース)		株 式 組入比率	公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率	(参考指数)	騰落率				
第207期	(期首) 2023年12月11日	円 9,841	% -	3,959.16	% -	17,143	% -	% 28.7	% 67.0	% -
	12月末	10,071	2.3	3,977.63	0.5	17,377	1.4	29.2	67.6	-
	(期末) 2024年 1 月10日	10,134	3.0	4,108.89	3.8	17,465	1.9	30.4	66.3	-
第208期	(期首) 2024年 1 月10日	10,119	-	4,108.89	-	17,465	-	30.4	66.3	-
	1 月末	10,241	1.2	4,288.36	4.4	17,814	2.0	30.8	64.7	-
	(期末) 2024年 2 月13日	10,262	1.4	4,390.78	6.9	17,871	2.3	30.4	65.5	-
第209期	(期首) 2024年 2 月13日	10,247	-	4,390.78	-	17,871	-	30.4	65.5	-
	2 月末	10,407	1.6	4,499.61	2.5	18,036	0.9	31.1	65.2	-
	(期末) 2024年 3 月11日	10,367	1.2	4,484.64	2.1	17,914	0.2	31.4	65.8	-
第210期	(期首) 2024年 3 月11日	10,217	-	4,484.64	-	17,914	-	31.4	65.8	-
	3 月末	10,497	2.7	4,699.20	4.8	18,253	1.9	31.3	64.1	-
	(期末) 2024年 4 月10日	10,438	2.2	4,655.37	3.8	18,241	1.8	31.0	64.9	-
第211期	(期首) 2024年 4 月10日	10,423	-	4,655.37	-	18,241	-	31.0	64.9	-
	4 月末	10,520	0.9	4,656.27	0.0	18,553	1.7	30.5	65.3	-
	(期末) 2024年 5 月10日	10,592	1.6	4,630.87	△0.5	18,589	1.9	31.0	65.3	-
第212期	(期首) 2024年 5 月10日	10,577	-	4,630.87	-	18,589	-	31.0	65.3	-
	5 月末	10,641	0.6	4,710.15	1.7	18,679	0.5	30.4	64.5	-
	(期末) 2024年 6 月10日	10,706	1.2	4,727.13	2.1	18,785	1.1	31.0	66.3	-

(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

(2023.12.12~2024.6.10)

■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、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方、円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。2024年1月以降は、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。3月下旬からは、米国の利下げ開始の後ずれ観測、市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇などが上値を抑えて高値圏での保ち合いとなり、当作成期末を迎えました。

■海外債券市況

海外債券市場では、金利は主要国を中心に上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、FRB（米国連邦準備制度理事会）が政策金利やインフレの見通しを引き下げたことなどから、グローバルで金利は低下（債券価格は上昇）しました。2024年に入ってから、米国を中心に経済指標が市場予想を上振れたことや、FRB高官からの早期利下げをけん制する発言などを受けて米国での利下げ織り込みがはく落し、金利は上昇基調となりました。当作成期末にかけては、経済指標の下振れなどを背景に、主要国の金利は上昇幅を縮小する展開となりました。

■為替相場

為替相場は、主要国を中心に対円で上昇（円安）しました。

当作成期首より、米国の経済指標が市場予想を軒並み下回ったことなどから米国金利が低下したことに加え、日銀による政策修正などを受け、米ドルは対円で下落（円高）しました。2024年に入ってから、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に、円安米ドル高に転じました。その後も、FRB（米国連邦準備制度理事会）高官からの早期利下げをけん制する発言に加え、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、マイナス金利解除後も日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、米ドルは対円で上昇基調で推移しました。なお、過度な円安米ドル高進行に対し、政府・日銀が為替介入を行いました。影響は限定的なものに止まりました。その他の通貨も米ドル円に連れる展開となり、対円で堅調な推移となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドの運用方針に従い、信託財産の純資産総額に対する兵庫県企業（※）の株式の組入比率は30%程度とすることを基本とし、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の受益証券の組入比率は70%程度とすることを基本とします。株式については、兵庫県企業に対して、兵庫県との関連度や時価総額、市場流動性、投資リスク等を考慮した銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築して運用を行います。

※兵庫県内に本社またはこれに準ずるものを置いている企業（県内企業）と、雇用の創出などの観点から兵庫県で事業活動を行っている、金融業を除く企業（進出企業）。

■ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

債券は、取得時に信用格付A格相当以上の海外の国債を中心に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの修正デュレーションは、5（年）程度～10（年）程度の範囲で、各国の市場動向や経済見通しに基づく金利見通しに応じて変動させます。通貨の投資割合は各通貨の市場動向や経済環境などの評価に応じて変動させます。ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度とします。

ポートフォリオについて

(2023.12.12～2024.6.10)

■当ファンド

兵庫県企業の株式に30%程度、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の受益証券に70%程度の比率で投資を行いました。

株式の業種構成は、兵庫県を本拠地とする企業、もしくは兵庫県への進出企業が多いゴム製品や鉄鋼などの比率がTOPIXと比較して高くなっております。

株式の個別銘柄では、県内企業の株式に対しては時価総額に応じた投資比率で、進出企業の株式に対しては時価総額と県内従業員数など兵庫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。

■ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

債券は、海外の国債を中心に投資しました。

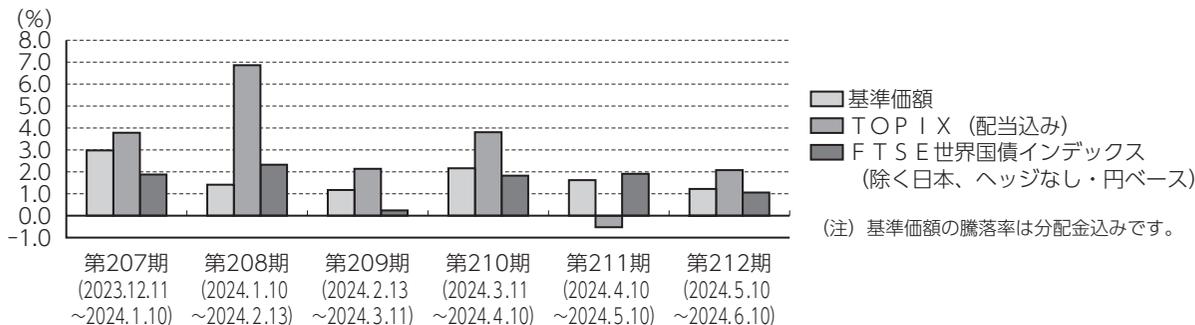
ポートフォリオの修正デュレーションは、5（年）程度～10（年）程度の範囲の中で変動させました。

通貨の投資割合は、ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度としつつ、実質外貨比率を高位に保ちました。

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	第207期	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期
	2023年12月12日 ~2024年1月10日	2024年1月11日 ~2024年2月13日	2024年2月14日 ~2024年3月11日	2024年3月12日 ~2024年4月10日	2024年4月11日 ~2024年5月10日	2024年5月11日 ~2024年6月10日
当期分配金（税込み）（円）	15	15	150	15	15	250
対基準価額比率（%）	0.15	0.15	1.45	0.14	0.14	2.34
当期の収益（円）	15	15	115	15	15	127
当期の収益以外（円）	-	-	34	-	-	122
翌期繰越分配対象額（円）	2,403	2,528	2,494	2,698	2,854	2,732

(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	第207期	第208期	第209期	第210期	第211期	第212期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 22.20円	✓ 13.53円	✓ 13.12円	✓ 40.18円	✓ 15.53円	✓ 14.05円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	269.19	✓ 126.35	✓ 102.13	179.11	155.25	✓ 113.55
(c) 収益調整金	1,343.84	1,387.46	1,436.59	1,469.79	1,506.09	1,549.03
(d) 分配準備積立金	783.34	1,016.32	✓ 1,092.34	1,024.75	1,193.00	✓ 1,306.14
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,418.58	2,543.67	2,644.19	2,713.84	2,869.90	2,982.78
(f) 分配金	15.00	15.00	150.00	15.00	15.00	250.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	2,403.58	2,528.67	2,494.19	2,698.84	2,854.90	2,732.78

(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

当ファンドの運用方針に従い、信託財産の純資産総額に対する兵庫県企業の株式の組入比率は30%程度とすることを基本とし、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の受益証券の組入比率は70%程度とすることを基本とします。株式については、兵庫県企業に対して、兵庫県との関連度や時価総額、市場流動性、投資リスク等を考慮した銘柄選定を行い、ポートフォリオを構築して運用を行います。

■ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

債券は、取得時に信用等级付A格相当以上の海外の国債を中心に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの修正デュレーションは、5（年）程度～10（年）程度の範囲で、各国の市場動向や経済見通しに基づく金利見通しに応じて変動させます。通貨の投資割合は各通貨の市場動向や経済環境などの評価に応じて変動させます。ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度とします。

1万口当りの費用の明細

項 目	第207期～第212期 (2023.12.12～2024.6.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	65円	0.629%	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10,332円です。
（投 信 会 社）	(34)	(0.328)	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）	(28)	(0.274)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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）	(3)	(0.027)	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	－	－	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
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	2	0.016	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
（保 管 費 用）	(1)	(0.012)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(0)	(0.004)	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	67	0.644	

(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。

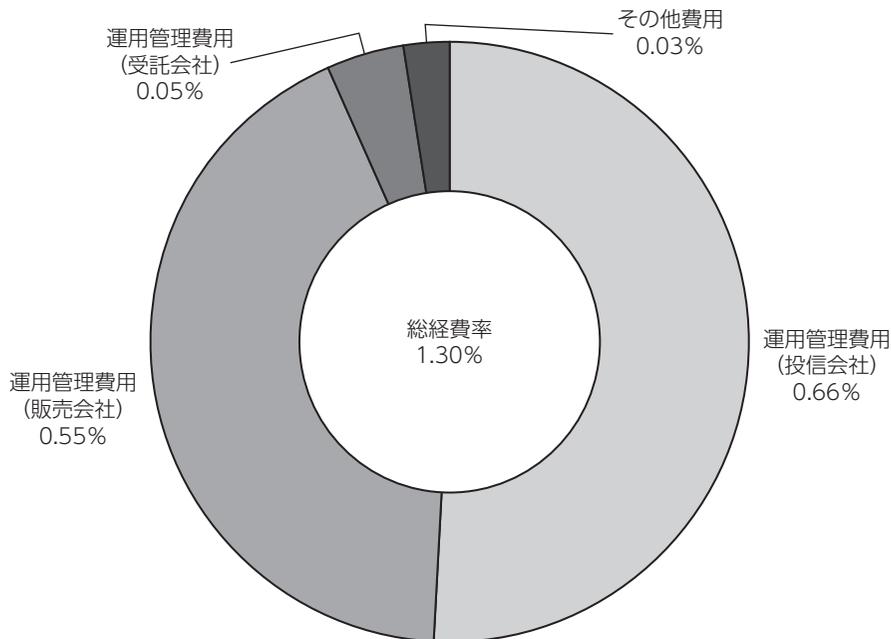
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.30%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

(1) 株 式

(2023年12月12日から2024年6月10日まで)

決算期	第 207 期 ~ 第 212 期			
	買 付 額		売 付 額	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	- (27.7)	- (-)	-	-

(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) 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年12月12日から2024年6月10日まで)

決算期	第 207 期 ~ 第 212 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	79,059	165,000	84,771	174,500

(注) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	第206期末		第 212 期 末		銘柄	第206期末		第 212 期 末		銘柄	第206期末		第 212 期 末		
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株	評価額
食料品 (2.3%)					非鉄金属 (2.9%)					卸売業 (7.5%)					
モロゾフ	0.4	0.4	1,760		大阪チタニウム	1.9	1.9	5,567		神戸物産	7.3	7.3	25,199		
六甲バター	1.1	1.1	1,613		住友電工	2	2	5,319		兼松	4.3	4.3	11,700		
S Foods	1.7	1.7	4,957		AREホールディングス	4.1	4.1	8,372		トーホー	0.6	0.6	1,878		
フジッコ	1.5	1.5	2,790		金属製品 (1.6%)					西本WISMETTAC HD	0.7	0.7	2,947		
ロックフィールド	1.4	1.4	2,115		トーカロ	3.1	3.1	5,948		加藤産業	1.8	1.8	7,542		
ケンコーマヨネーズ	0.8	0.8	1,530		ノーリツ	2.6	2.6	4,594		小売業 (7.0%)					
繊維製品 (1.4%)					機械 (9.4%)					MonotaRO	15.4	15.4	25,279		
日本毛織	4	4	5,348		タクマ	4.3	4.3	7,168		G-7ホールディングス	2.3	2.3	3,608		
ワールド	1.8	1.8	3,690		日工	2.1	2.1	1,554		西松屋チェーン	3.6	3.6	8,244		
化学 (8.7%)					クボタ	12.5	12.5	27,687		関西フードマーケティング	3.3	3.3	8,471		
住友精化	0.7	0.7	3,556		帝国電機製作所	1	1	2,401		不動産業 (0.1%)					
多木化学	0.5	0.5	2,025		グローリー	3	3	8,278		ファースト住建	0.9	0.9	968		
日油	0.2	0.6	1,237		三菱重工業	0.9	9	12,645		サービス業 (3.2%)					
石原ケミカル	0.8	0.8	1,621		IHI	0.4	0.4	1,548		アルトナー	0.5	0.5	1,052		
関西ペイント	11.6	11.6	31,737		電気機器 (7.7%)					WDBホールディングス	1	1	1,790		
ライオン	0.8	0.8	1,021		三菱電機	5.5	5.5	14,775		大栄環境	5.1	5.1	12,678		
ノビアホールディングス	1.8	1.8	9,864		TOA	1.8	1.8	1,956		日本官財ホールディング	2.1	2.1	5,491		
メック	1	1	4,255		古野電気	1.6	1.6	3,398		合計	株数、金額	227.2	254.9	655,032	
東リ	3.4	3.4	1,349		日本電子材料	0.6	0.6	1,989		銘柄数<比率>	<70銘柄	<70銘柄	<31.0%>		
医薬品 (1.4%)					シスメックス	3.5	10.5	27,300							
塩野義製薬	0.8	0.8	5,028		大真空	1.9	1.9	1,322							
JCRファーマ	6.7	6.7	3,879		輸送用機器 (8.1%)										
ゴム製品 (9.1%)					川崎重工業	7.9	7.9	45,314							
TOYO TIRE	7.9	7.9	21,922		新明和工業	3.6	3.6	5,047							
住友ゴム	13.5	13.5	23,166		ハイレックスコーポレーション	2	2	2,890							
ニチリン	0.7	0.7	2,618		その他製品 (8.2%)										
三ツ星ベルト	1.7	1.7	7,446		アシックス	5.7	5.7	53,426							
パソナー化学	2.3	2.3	4,330		陸運業 (0.5%)										
ガラス・土石製品 (0.4%)					山陽電鉄	1.1	1.1	2,285							
SECカーボン	0.2	1	2,438		神姫バス	0.3	0.3	1,024							
鉄鋼 (11.1%)					海運業 (6.5%)										
日本製鉄	2.4	2.4	8,172		川崎汽船	5.7	17.1	41,433							
神戸製鋼所	15.6	15.6	31,254		明海グループ	1.8	1.8	1,303							
大和工業	3.3	3.3	26,987		倉庫・運輸関連業 (3.0%)										
山陽特殊製鋼	2.8	2.8	6,025		上組	6	6	19,890							

(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) 親投資信託残高

種類	第206期末		第 212 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評価額
	千口	千口	千円	千円
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	680,126	674,415	1,464,291	

(注) 単位未満は切捨て。

兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）

■投資信託財産の構成

2024年6月10日現在

項 目	第 212 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 655,032	% 30.2
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	1,464,291	67.4
コール・ローン等、その他	52,029	2.4
投資信託財産総額	2,171,353	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=157.01円、1カナダ・ドル=114.06円、1オーストラリア・ドル=103.23円、1イギリス・ポンド=199.72円、1デンマーク・クローネ=22.68円、1ノルウェー・クローネ=14.63円、1スウェーデン・クローネ=14.87円、1チェコ・コルナ=6.865円、1ポーランド・ズロチ=39.245円、1ユーロ=169.23円です。

(注3) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドにおいて、第212期末における外貨建純資産（16,453,000千円）の投資信託財産総額（16,512,598千円）に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年1月10日)、(2024年2月13日)、(2024年3月11日)、(2024年4月10日)、(2024年5月10日)、(2024年6月10日)現在

項 目	第 207 期 末	第 208 期 末	第 209 期 末	第 210 期 末	第 211 期 末	第 212 期 末
(A) 資産	1,939,221,963円	1,990,406,326円	2,002,126,323円	2,041,429,705円	2,103,506,370円	2,171,353,275円
コール・ローン等	14,854,294	30,579,506	34,946,502	26,127,873	22,667,708	47,039,005
株式(評価額)	586,739,350	601,801,650	616,026,600	631,473,350	646,540,800	655,032,650
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド(評価額)	1,325,360,119	1,355,869,720	1,348,636,871	1,377,817,582	1,414,845,912	1,464,291,170
未収入金	10,000,000	—	—	—	13,000,000	—
未収配当金	2,268,200	2,155,450	2,516,350	6,010,900	6,451,950	4,990,450
(B) 負債	11,871,867	8,671,863	38,872,512	6,751,553	18,429,292	58,656,604
未払収益分配金	2,857,093	2,901,000	28,824,178	2,928,040	2,956,982	50,512,573
未払解約金	6,980,951	3,461,375	8,131,293	1,662,249	13,284,048	5,778,915
未払信託報酬	2,020,657	2,281,461	1,876,787	2,107,280	2,120,459	2,282,443
その他未払費用	13,166	28,027	40,254	53,984	67,803	82,673
(C) 純資産総額(A-B)	1,927,350,096	1,981,734,463	1,963,253,811	2,034,678,152	2,085,077,078	2,112,696,671
元本	1,904,728,790	1,934,000,192	1,921,611,894	1,952,027,232	1,971,321,980	2,020,502,937
次期繰越損益金	22,621,306	47,734,271	41,641,917	82,650,920	113,755,098	92,193,734
(D) 受益権総口数	1,904,728,790口	1,934,000,192口	1,921,611,894口	1,952,027,232口	1,971,321,980口	2,020,502,937口
1万口当り基準価額(C/D)	10,119円	10,247円	10,217円	10,423円	10,577円	10,456円

* 当作成期首における元本額は1,979,000,041円、当作成期間（第207期～第212期）中における追加設定元本額は383,173,362円、同解約元本額は341,670,466円です。

* 第212期末の計算口数当りの純資産額は10,456円です。

■損益の状況

第207期 自2023年12月12日 至2024年1月10日 第210期 自2024年3月12日 至2024年4月10日
 第208期 自2024年1月11日 至2024年2月13日 第211期 自2024年4月11日 至2024年5月10日
 第209期 自2024年2月14日 至2024年3月11日 第212期 自2024年5月11日 至2024年6月10日

項 目	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期	第 212 期
(A) 配当等収益	1,955,532円	117,109円	471,717円	5,692,367円	587,811円	246,219円
受取配当金	1,954,331	114,250	471,818	5,690,989	586,000	243,900
受取利息	—	—	—	1,423	1,803	2,286
その他収益金	1,418	2,988	6	26	8	33
支払利息	△ 217	△ 129	△ 107	△ 71	—	—
(B) 有価証券売買損益	55,582,212	29,233,027	23,565,077	39,235,234	35,216,048	27,834,433
売買益	62,746,850	42,449,145	35,810,888	52,867,627	42,724,280	49,995,203
売買損	△ 7,164,638	△ 13,216,118	△ 12,245,811	△ 13,632,393	△ 7,508,232	△ 22,160,770
(C) 信託報酬等	△ 2,033,823	△ 2,296,322	△ 1,889,014	△ 2,121,010	△ 2,134,278	△ 2,297,313
(D) 当期損益(A+B+C)	55,503,921	27,053,814	22,147,780	42,806,591	33,669,581	25,783,339
(E) 前期繰越損益金	149,206,436	196,557,771	209,906,854	200,034,794	235,179,999	263,907,518
(F) 追加信託差損益金	△179,231,958	△172,976,314	△161,588,539	△157,262,425	△152,137,500	△146,984,550
(配当等相当額)	(255,965,153)	(268,335,842)	(276,057,851)	(286,908,309)	(296,900,150)	(312,982,497)
(売買損益相当額)	(△435,197,111)	(△441,312,156)	(△437,646,390)	(△444,170,734)	(△449,037,650)	(△459,967,047)
(G) 合計(D+E+F)	25,478,399	50,635,271	70,466,095	85,578,960	116,712,080	142,706,307
(H) 収益分配金	△ 2,857,093	△ 2,901,000	△ 28,824,178	△ 2,928,040	△ 2,956,982	△ 50,512,573
次期繰越損益金(G+H)	22,621,306	47,734,271	41,641,917	82,650,920	113,755,098	92,193,734
追加信託差損益金	△179,231,958	△172,976,314	△161,588,539	△157,262,425	△152,137,500	△146,984,550
(配当等相当額)	(255,965,153)	(268,335,842)	(276,057,851)	(286,908,309)	(296,900,150)	(312,982,497)
(売買損益相当額)	(△435,197,111)	(△441,312,156)	(△437,646,390)	(△444,170,734)	(△449,037,650)	(△459,967,047)
分配準備積立金	201,853,264	220,710,585	203,230,456	239,913,345	265,892,598	239,178,284

(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	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期	第 212 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,229,271円	2,617,464円	2,522,172円	7,843,558円	3,063,188円	2,839,736円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	51,274,650	24,436,350	19,625,608	34,963,033	30,606,393	22,943,603
(c) 収益調整金	255,965,153	268,335,842	276,057,851	286,908,309	296,900,150	312,982,497
(d) 分配準備積立金	149,206,436	196,557,771	209,906,854	200,034,794	235,179,999	263,907,518
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	460,675,510	491,947,427	508,112,485	529,749,694	565,749,730	602,673,354
(f) 分配金	2,857,093	2,901,000	28,824,178	2,928,040	2,956,982	50,512,573
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	457,818,417	489,046,427	479,288,307	526,821,654	562,792,748	552,160,781
(h) 受益権総口数	1,904,728,790口	1,934,000,192口	1,921,611,894口	1,952,027,232口	1,971,321,980口	2,020,502,937口

兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
	第 207 期	第 208 期	第 209 期	第 210 期	第 211 期	第 212 期
1万口当り分配金（税込み）	15円	15円	150円	15円	15円	250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。

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。

<補足情報>

当ファンド（兵庫応援バランスファンド（毎月分配型））が投資対象としている「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の決算日（2024年4月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの第212期の決算日（2024年6月10日）現在におけるダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2023年12月12日から2024年6月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	2.9% 2046/10/31	1,049,235	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	3.25% 2045/5/25	1,010,639
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.375% 2033/5/15	419,868	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	559,206
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	2.75% 2028/11/21	306,401	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	387,237
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	290,423	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	2.75% 2028/11/21	312,109
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	4.5% 2033/4/21	251,902	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.95% 2026/4/30	260,900
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND (ノルウェー)	1.75% 2025/3/13	231,363	Poland Government Bond (ポーランド)	0.75% 2025/4/25	206,134
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND (ノルウェー)	3% 2024/3/14	169,327	United Kingdom Gilt (イギリス)	4.25% 2032/6/7	175,322
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.25% 2052/2/15	97,054	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	5% 2025/9/30	162,101
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2046/8/15	91,016	POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド)	3.75% 2027/5/25	159,243
SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.9% 2052/10/31	48,739	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	0.5% 2030/12/1	158,934

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年6月10日現在におけるダイワ・外債ソブリン・マザーファンド（7,605,010千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2024年6月10日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちB B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 33,686	千アメリカ・ドル 25,334	千円 3,977,815	% 24.1	% -	% 23.0	% 1.1	% -
カナダ	千カナダ・ドル 18,084	千カナダ・ドル 16,905	1,928,262	11.7	-	8.8	-	2.8
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 23,900	千オーストラリア・ドル 20,166	2,081,763	12.6	-	10.7	1.9	-
イギリス	千イギリス・ポンド 13,015	千イギリス・ポンド 9,983	1,993,854	12.1	-	5.7	6.4	-
デンマーク	千デンマーク・クローネ 25,700	千デンマーク・クローネ 26,529	601,682	3.6	-	0.9	-	2.7
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 17,000	千ノルウェー・クローネ 16,675	243,957	1.5	-	-	-	1.5
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 8,230	千スウェーデン・クローネ 7,925	117,856	0.7	-	-	0.7	-
チェコ	千チェコ・コルナ 45,000	千チェコ・コルナ 44,188	303,379	1.8	-	-	1.8	-
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 16,200	千ポーランド・ズロチ 14,035	550,826	3.3	-	1.0	2.3	0.0
ユーロ（ベルギー）	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,025	342,762	2.1	-	2.1	-	-

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

2024年6月10日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 500	千ユーロ 395	千円 66,884	% 0.4	% -	% 0.4	% -	% -	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 20,186	千ユーロ 17,724	千円 2,999,520	18.2	-	8.8	8.8	0.6	
ユーロ (その他)	千ユーロ 3,500	千ユーロ 3,454	千円 584,569	3.5	-	3.5	-	-	
ユーロ (小計)	26,136	23,599	3,993,737	24.2	-	14.8	8.8	0.6	
合 計	-	-	15,793,135	95.6	-	65.0	23.0	7.7	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2024年6月10日現在									
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	千アメリカ・ドル 900	千アメリカ・ドル 599	千円 94,168	2046/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,200	1,116	175,281	2027/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,686	4,672	733,625	2040/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	16,600	13,330	2,093,066	2030/11/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,480	389,527	2052/02/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	3,400	3,134	492,146	2033/05/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		33,686	25,334	3,977,815			
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千カナダ・ドル 1,500	千カナダ・ドル 1,510	172,249	2045/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	1,956	223,126	2048/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,754	3,119	355,792	2030/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	899	102,550	2032/06/01		
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	2.2500	4,230	4,108	468,612	2025/12/15		
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	3.5500	3,000	2,947	336,191	2032/09/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		18,084	16,905	1,928,262			
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千オーストラリア・ドル 9,000	千オーストラリア・ドル 9,209	950,708	2033/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,000	3,360	346,927	2051/06/21		
	SWEDISH EXPORT CREDIT	特殊債券	4.3000	800	789	81,524	2028/05/30		
	INTL. FIN. CORP.	特殊債券	1.2500	5,600	4,504	465,019	2031/02/06		
	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	特殊債券	1.1000	2,500	2,301	237,583	2026/12/16		
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		23,900	20,166	2,081,763			
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	千イギリス・ポンド 2,520	千イギリス・ポンド 2,375	474,339	2026/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	3,200	2,885	576,196	2028/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,400	554	110,758	2050/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	3,095	2,362	471,909	2031/07/31		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	864	172,633	2051/07/31		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	941	188,016	2046/12/07		
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		13,015	9,983	1,993,854			

2024年6月10日現在															
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日								
					外 債 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額									
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券	% 4.5000 1.7500	千デンマーク・クローネ 5,500 20,200	千デンマーク・クローネ 6,686 19,842	千円 151,655 450,026	2039/11/15 2025/11/15								
								2銘柄	25,700	26,529	601,682				
通貨小計	銘柄数 金 額														
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	千ノルウェー・クローネ 17,000	千ノルウェー・クローネ 16,675	243,957	2025/03/13								
								1銘柄	17,000	16,675	243,957				
通貨小計	銘柄数 金 額														
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	千スウェーデン・クローネ 8,230	千スウェーデン・クローネ 7,925	117,856	2026/11/12								
								1銘柄	8,230	7,925	117,856				
通貨小計	銘柄数 金 額														
チェコ	Czech Republic Government Bond CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券	1.0000 5.7500	千チェコ・コルナ 30,000 15,000	千チェコ・コルナ 28,155 16,032	193,305 110,074	2026/06/26 2029/03/29								
								2銘柄	45,000	44,188	303,379				
通貨小計	銘柄数 金 額														
ポーランド	Poland Government Bond Poland Government Bond Poland Government Bond POLAND GOVERNMENT BOND Poland Government Bond	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	2.2500 0.7500 1.2500 3.7500 2.7500	千ポーランド・ズロチ 100 100 5,500 500 10,000	千ポーランド・ズロチ 99 96 4,259 479 9,101	3,888 3,787 167,172 18,803 357,174	2024/10/25 2025/04/25 2030/10/25 2027/05/25 2028/04/25								
								5銘柄	16,200	14,035	550,826				
								通貨小計	銘柄数 金 額						
								ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,025	342,762	2045/06/22
国小計	銘柄数 金 額														
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	千ユーロ 500	千ユーロ 395	66,884	2032/05/25								
								1銘柄	500	395	66,884				
国小計	銘柄数 金 額														
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND SPANISH GOVERNMENT BOND SPANISH GOVERNMENT BOND SPANISH GOVERNMENT BOND SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	1.9500 2.9000 1.4000 1.2000 1.9000	千ユーロ 600 7,400 9,136 2,600 450	千ユーロ 586 6,440 8,582 1,814 300	99,182 1,089,865 1,452,500 307,043 50,927	2026/04/30 2046/10/31 2028/04/30 2040/10/31 2052/10/31								
								5銘柄	20,186	17,724	2,999,520				
								通貨小計	銘柄数 金 額						
								ユーロ (その他)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	2.7500	千ユーロ 3,500	千ユーロ 3,454	584,569	2030/07/30
国小計	銘柄数 金 額														
通貨小計	銘柄数 金 額														
合計	銘柄数 金 額														
						15,793,135									

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

運用報告書 第38期 (決算日 2024年4月10日)

(作成対象期間 2023年10月11日～2024年4月10日)

ダイワ・外債ソブリン・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。

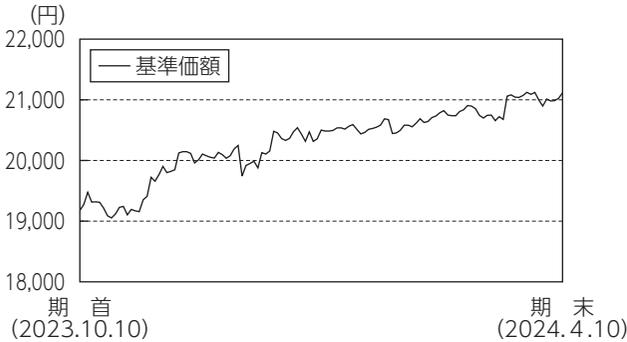
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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		FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 比率
	円	騰落率 %	(参考指数)	騰落率 %		
期首 (2023.10.10)	19,175	-	19,041	-	%	%
10月末	19,156	△ 0.1	19,140	0.5	97.4	-
11月末	20,133	5.0	19,917	4.6	96.0	-
12月末	20,435	6.6	19,786	3.9	96.6	-
2024年1月末	20,549	7.2	20,283	6.5	95.7	-
2月末	20,738	8.2	20,535	7.8	96.1	-
3月末	21,090	10.0	20,782	9.1	96.0	-
期末 (2024年4月10日)	21,114	10.1	20,769	9.1	95.9	-

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 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5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。
- (注6) 債券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：19,175円 期末：21,114円 騰落率：10.1%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券の価格上昇や債券からの利息収入、投資対象通貨が円に対して上昇(円安)したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外債券市況

海外債券市場では、金利は低下(債券価格は上昇)しました。

当学期首より、米国を中心に景気の底堅さが確認されたことや、米国における国債の増発に伴う需給の悪化などが嫌気され、グローバルで金利は上昇(債券価格は下落)しました。しかし2023年11月以降は、米国国債の過度な需給悪化懸念が後退したことや、米国

の経済指標が市場予想を軒並み下回ったことなどから、金利低下圧力が強まりました。当学期末にかけては、米国を中心に経済指標が市場予想を上振れたことや、FRB(米国連邦準備制度理事会)高官から早期の利下げをけん制する発言を受け、金利はこれまでの低下幅を縮小しました。

○為替相場

為替相場は対円で上昇しました。

米ドル対円為替相場は、当学期首より、堅調な米国経済などを背景に米国金利が上昇基調となったことで、上昇しました。2023年11月以降は、米国国債の過度な需給悪化懸念が後退したことや、米国の経済指標が市場予想を軒並み下回ったことなどから米国金利が大きく低下したことに加え、リスク回避による円買い需要の高まりなどから、米ドルは対円で下落(円高)しました。当学期末にかけては、米国を中心に経済指標が市場予想を上振れたことや、FRB(米国連邦準備制度理事会)高官による早期の利下げをけん制する発言に加え、マイナス金利解除後も日本の金融政策が相対的に緩行的であることなどから、米ドルは対円で上昇しました。

その他の通貨も米ドル円に連れる展開となり、対円で堅調な推移となりました。

◆前学期末における「今後の運用方針」

債券は、取得時に信用格付A格相当以上の海外の国債を中心に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの修正デュレーションは、5(年)程度~10(年)程度の範囲で、各国の市場動向や経済見通しに基づく金利見通しに応じて変動させます。通貨の投資割合は各通貨の市場動向や経済環境などの評価に応じて変動させます。ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度とします。

◆ポートフォリオについて

債券は、海外の国債を中心に投資しました。ポートフォリオの修正デュレーションは、5(年)程度~10(年)程度の範囲の中で変動させました。通貨の投資割合は、ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度としつつ、実質外貨比率を高位に保ちました。

◆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。

当ファンドは、運用方針により、参考指数と比較して米ドルおよびユーロの組入比率が低いことや、信用格付けがA格相当に満たない一部の国が投資対象に含まれないという特徴があります。参考指数は先進国の海外債券市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

当学期中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》

債券は、取得時に信用格付A格相当以上の海外の国債を中心に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざします。ポートフォリオの修正デュレーションは、5(年)程度~10(年)程度の範囲で、各国の市場動向や経済見通しに基づく金利見通しに応じて変動させます。通貨の投資割合は各通貨の市場動向や経済環境などの評価に応じて変動させます。ドル通貨圏、欧州通貨圏をそれぞれ50%程度とし、ドル通貨圏内では米ドル、欧州通貨圏内ではユーロを50%程度とします。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	－円
有価証券取引税	－
その他費用 (保管費用)	4 (4)
(その他)	(0)
合計	4

(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

公社債

(2023年10月11日から2024年4月10日まで)

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 7,545	千アメリカ・ドル 8,997 (－)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル －	千カナダ・ドル 1,261 (－)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 5,738	千オーストラリア・ドル 3,633 (－)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド －	千イギリス・ポンド 935 (－)

■ 主要な売買銘柄

公社債

(2023年10月11日から2024年4月10日まで)

当			期		
買		付	売		付
銘柄	柄	金額	銘柄	柄	金額
		千円			千円
SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	2.9% 2046/10/31	1,049,235	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	3.25% 2045/5/25	1,010,639
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.375% 2033/5/15	419,868	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	693,781
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	2.75% 2028/11/21	306,401	Poland Government Bond (ポーランド)	2.75% 2028/4/25	501,679
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	290,423	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	2.75% 2028/11/21	312,109
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND (オーストラリア)	4.5% 2033/4/21	251,902	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	299,883
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND (ノルウェー)	1.75% 2025/3/13	231,363	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.95% 2026/4/30	260,900
Czech Republic Government Bond (チェコ)	1% 2026/6/26	182,502	Poland Government Bond (ポーランド)	0.75% 2025/4/25	206,134
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND (ノルウェー)	3% 2024/3/14	169,327	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.25% 2052/2/15	177,414
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	5% 2025/9/30	164,126	United Kingdom Gilt (イギリス)	4.25% 2032/6/7	175,322
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.25% 2052/2/15	155,244	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	5% 2025/9/30	162,101

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

			買付額	売付額
外	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 28,572	千ノルウェー・クローネ － (17,000)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ －	千スウェーデン・クローネ － (13,630)
	チェコ	国債証券	千チェコ・コルナ 43,341	千チェコ・コルナ － (－)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ －	千ポーランド・ズロチ 24,800 (－)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 590	千ユーロ 8,432 (100)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ －	千ユーロ 681 (－)
国	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 6,726	千ユーロ 1,630 (－)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	国債証券	千ユーロ 7,316	千ユーロ 10,745 (100)

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期 区分	当 期				末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちB格 以下組入比率	残存期間	別組入	比率	
	外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 34,393	千アメリカ・ドル 25,917	3,934,735	24.1	—	23.1	1.0	—
カナダ	千カナダ・ドル 19,776	千カナダ・ドル 18,156	2,031,933	12.4	—	9.6	—	2.8
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 23,900	千オーストラリア・ドル 20,236	2,036,644	12.5	—	10.6	1.9	—
イギリス	千イギリス・ポンド 13,015	千イギリス・ポンド 10,096	1,943,212	11.9	—	5.7	6.2	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 25,700	千デンマーク・クローネ 26,725	590,638	3.6	—	0.9	—	2.7
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 17,000	千ノルウェー・クローネ 16,609	236,353	1.4	—	—	—	1.4
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 8,230	千スウェーデン・クローネ 7,862	113,144	0.7	—	—	0.7	—
チェコ	千チェコ・コルナ 45,000	千チェコ・コルナ 44,449	288,246	1.8	—	—	1.8	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 16,200	千ポーランド・ズロチ 14,036	542,319	3.3	—	1.0	2.3	0.0
ユーロ（ベルギー）	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,092	344,872	2.1	—	2.1	—	—
ユーロ（フランス）	千ユーロ 500	千ユーロ 401	66,135	0.4	—	0.4	—	—
ユーロ（スペイン）	千ユーロ 20,186	千ユーロ 17,940	2,957,562	18.1	—	8.8	9.3	—
ユーロ（その他）	千ユーロ 3,500	千ユーロ 3,493	575,896	3.5	—	3.5	—	—
ユーロ（小計）	26,136	23,927	3,944,466	24.2	—	14.8	9.3	—
合計	—	—	15,661,695	95.9	—	65.7	23.2	7.0

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区分	銘柄	種類	年 利 率	当 期			末		償 還 年 月 日
				額面金額	評価額	組入比率	外貨建金額	邦貨換算金額	
				千円	千円	%	千円	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	千アメリカ・ドル 900	千アメリカ・ドル 603	—	91,598	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,200	1,116	—	169,454	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,686	4,663	—	708,009	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	17,307	13,888	—	2,108,551	2030/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,498	—	379,286	2052/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	3,400	3,147	—	477,835	2033/05/15	
通貨小計	銘柄数 6銘柄			34,393	25,917	—	3,934,735		
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千カナダ・ドル 1,500	千カナダ・ドル 1,496	—	167,465	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	1,931	—	216,140	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,446	4,479	—	501,325	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	891	—	99,719	2032/06/01	
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	2.2500	4,230	4,088	—	457,502	2025/12/15	
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	3.5500	3,000	2,923	—	327,202	2032/09/15	
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	3.6500	2,400	2,346	—	262,578	2033/06/15	
	通貨小計	銘柄数 7銘柄			19,776	18,156	—	2,031,933	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千オーストラリア・ドル 9,000	千オーストラリア・ドル 9,252	—	931,202	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,000	3,399	—	342,153	2051/06/21	
	SWEDISH EXPORT CREDIT	特殊債券	4.3000	800	791	—	79,607	2028/05/30	
	INTL. FIN. CORP.	特殊債券	1.2500	5,600	4,495	—	452,462	2031/02/06	

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	特殊債券	1.1000	千オーストラリア・ドル 2,500	千オーストラリア・ドル 2,297	千円 231,217	2026/12/16
通貨小計	銘柄数 5銘柄			23,900	20,236	2,036,644	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	千イギリス・ポンド 2,520	千イギリス・ポンド 2,378	457,781	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	3,200	2,906	559,396	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,400	570	109,825	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	3,095	2,386	459,324	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	890	171,339	2051/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	964	185,544	2046/12/07
通貨小計	銘柄数 6銘柄			13,015	10,096	1,943,212	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 5,500	千デンマーク・クローネ 6,864	151,700	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	20,200	19,861	438,938	2025/11/15
通貨小計	銘柄数 2銘柄			25,700	26,725	590,638	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	千ノルウェー・クローネ 17,000	千ノルウェー・クローネ 16,609	236,353	2025/03/13
通貨小計	銘柄数 1銘柄			17,000	16,609	236,353	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	千スウェーデン・クローネ 8,230	千スウェーデン・クローネ 7,862	113,144	2026/11/12
通貨小計	銘柄数 1銘柄			8,230	7,862	113,144	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	千チェコ・コルナ 30,000	千チェコ・コルナ 28,199	182,867	2026/06/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	15,000	16,250	105,378	2029/03/29
通貨小計	銘柄数 2銘柄			45,000	44,449	288,246	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	千ポーランド・ズロチ 100	千ポーランド・ズロチ 98	3,806	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	100	95	3,695	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	5,500	4,266	164,829	2030/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	479	18,522	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	10,000	9,096	351,466	2028/04/25
通貨小計	銘柄数 5銘柄			16,200	14,036	542,319	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,092	344,872	2045/06/22
国小計	銘柄数 1銘柄			1,950	2,092	344,872	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	千ユーロ 500	千ユーロ 401	66,135	2032/05/25
国小計	銘柄数 1銘柄			500	401	66,135	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	千ユーロ 600	千ユーロ 587	96,785	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	7,400	6,568	1,082,786	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	9,136	8,635	1,423,491	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	2,600	1,843	303,923	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	450	306	50,576	2052/10/31
国小計	銘柄数 5銘柄			20,186	17,940	2,957,562	
ユーロ (その他)	EUROPEAN INVESTMENT BANK	特殊債券	2.7500	千ユーロ 3,500	千ユーロ 3,493	575,896	2030/07/30
国小計	銘柄数 1銘柄			3,500	3,493	575,896	
通貨小計	銘柄数 8銘柄			26,136	23,927	3,944,466	
合計	銘柄数 43銘柄					15,661,695	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年4月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	15,661,695	95.9
コール・ローン等、その他	673,949	4.1
投資信託財産総額	16,335,644	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、4月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.82円、1カナダ・ドル=111.91円、1オーストラリア・ドル=100.64円、1イギリス・ポンド=192.46円、1デンマーク・クローネ=22.10円、1ノルウェー・クローネ=14.23円、1スウェーデン・クローネ=14.39円、1チェコ・コルナ=6.484円、1ポーランド・ズロチ=38.635円、1ユーロ=164.85円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(16,300,506千円)の投資信託財産総額(16,335,644千円)に対する比率は、99.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年4月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,335,644,979円
コール・ローン等	341,327,179
公社債(評価額)	15,661,695,166
未収利息	131,852,067
前払費用	21,191,157
差入委託証拠金	179,579,410
(B) 負債	6,012,110
未払解約金	6,012,110
(C) 純資産総額(A-B)	16,329,632,869
元本	7,734,003,208
次期繰越損益金	8,595,629,661
(D) 受益権総口数	7,734,003,208口
1万口当り基準価額(C/D)	21,114円

- * 期首における元本額は8,508,095,237円、当作成期間中における追加設定元本額は109,892,200円、同解約元本額は883,984,229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：
 ダイワFOFs用外債ソブリン・オープン (適格機関投資家専用) 1,036,428,448円
 ダイワ外債ソブリン・オープン (毎月分配型) 471,089,788円
 安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 154,825,506円
 インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 202,648,612円
 成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 324,884,827円
 6資産バランスファンド (分配型) 631,108,008円
 6資産バランスファンド (成長型) 99,928,406円
 ダイワ海外ソブリン・ファンド (毎月分配型) 2,942,537,267円
 世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型) 35,032,054円
 ダイワ外債ソブリン・ファンド (毎月分配型) 119,466,457円
 兵庫応援バランスファンド (毎月分配型) 652,561,136円
 ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型) 580,641,172円
 ダイワ海外ソブリン・ファンド (1年決算型) 11,123,176円
 四国アライアンス 地域創生ファンド (年1回決算型) 394,939,182円
 四国アライアンス 地域創生ファンド (年2回決算型) 76,789,169円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は21,114円です。

■損益の状況

当期 自2023年10月11日 至2024年4月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	187,398,368円
受取利息	183,781,320
その他収益金	3,619,554
支払利息	△ 2,506
(B) 有価証券売買損益	1,395,108,760
売買益	1,463,529,353
売買損	△ 68,420,593
(C) その他費用	△ 3,080,485
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,579,426,643
(E) 前期繰越損益金	7,805,978,021
(F) 解約差損益金	△ 905,618,099
(G) 追加信託差損益金	115,843,096
(H) 合計(D+E+F+G)	8,595,629,661
次期繰越損益金(H)	8,595,629,661

- (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。