

# 茨城ファンド (愛称：コラボいばらき)

## 運用報告書（全体版） 第22期

(決算日 2024年7月29日)  
(作成対象期間 2023年8月1日～2024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			TOPIX(配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
18期末(2020年7月29日)	円 11,652	円 50	% 1.8	2,396.40	% 1.3	% 92.0	% 7.4	百万円 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
22期末(2024年7月29日)	15,851	1,400	20.4	4,693.59	21.5	95.1	3.0	4,230

(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。

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：14,332円

期末：15,851円（分配金1,400円）

騰落率：20.4%（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	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2023年 7月31日	円	%		%	%	%
	14,332	—	3,861.80	—	97.5	2.3
8 月末	14,455	0.9	3,878.51	0.4	96.0	3.1
9 月末	14,282	△ 0.3	3,898.26	0.9	95.7	3.6
10月末	13,939	△ 2.7	3,781.64	△ 2.1	95.3	4.0
11月末	14,640	2.1	3,986.65	3.2	94.3	4.9
12月末	14,688	2.5	3,977.63	3.0	94.5	4.9
2024年 1 月末	15,548	8.5	4,288.36	11.0	94.8	4.4
2 月末	16,031	11.9	4,499.61	16.5	95.1	4.5
3 月末	16,772	17.0	4,699.20	21.7	95.0	3.9
4 月末	16,958	18.3	4,656.27	20.6	95.5	3.9
5 月末	17,009	18.7	4,710.15	22.0	95.3	3.9
6 月末	17,326	20.9	4,778.56	23.7	94.4	5.0
(期末) 2024年 7月29日	17,251	20.4	4,693.59	21.5	95.1	3.0

(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

(2023.8.1～2024.7.29)

### ■国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇などから、上値の重い展開となりました。その後も、2023年8月半ばに発表された2023年4－6月期GDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、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。しかし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月下旬以降は、急ピッチでの上昇が一服し、景況感の悪化や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、国内外の政治情勢の不透明感などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなりました。7月後半以降は、政府関係者による金融政策正常化への前向きな発言などで円高が進行したことや、米国による対中半導体規制の強化報道などを受けて株価は大幅に下落し、当作成期末を迎えました。

## 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

(2023.8.1～2024.7.29)

## ■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。

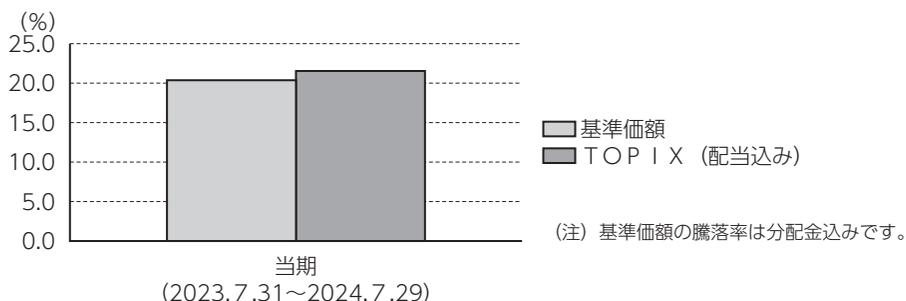
茨城県内に本社を置いている企業の株式に対しては、時価総額に応じた投資比率で、茨城県に進出し雇用を創出している企業の株式に対しては、時価総額と県内従業員数など茨城県との関連度を考慮して銘柄選定を行い、それぞれの時価総額に応じた比率に一定の値を乗じた投資比率で組み入れを行いました。

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。

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	
	2023年8月1日 ～2024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 (%)	8.12	
当期の収益 (円)	1,400	
当期の収益以外 (円)	-	
翌期繰越分配対象額 (円)	5,851	

(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	✓	354.40円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	2,562.21
(c) 収益調整金		1,146.71
(d) 分配準備積立金		3,188.15
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		7,251.48
(f) 分配金		1,400.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		5,851.48

(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 (2023.8.1~2024.7.29)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	167円	1.072%	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15,578円です。
(投 信 会 社)	(85)	(0.547)	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)	(68)	(0.438)	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)	(14)	(0.087)	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	1	0.004	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)	(0.003)	
(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
(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	168	1.081	

(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。

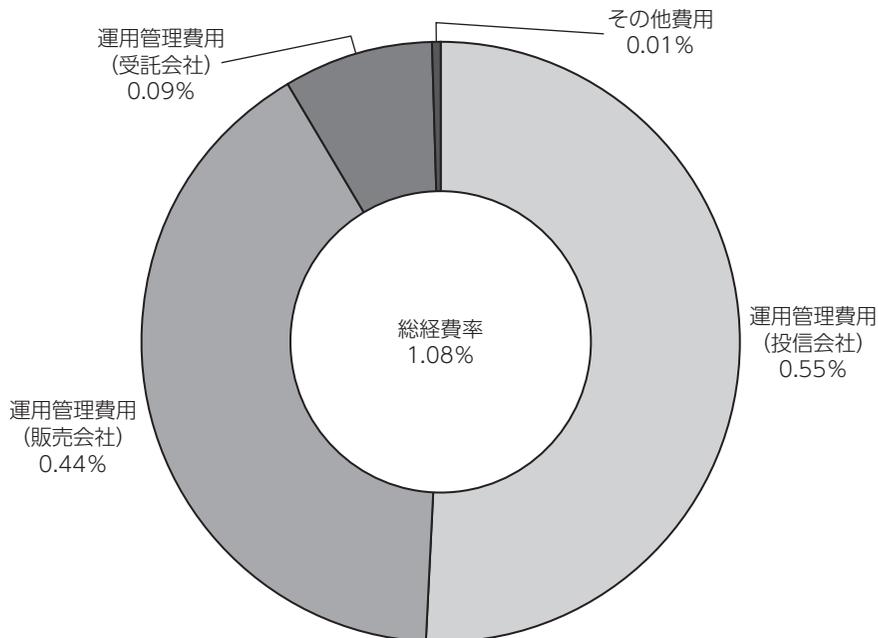
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2023年8月1日から2024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	30,229	112,580	388,073	1,496,040

(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

(2023年8月1日から2024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	2,273,668千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,615,538千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.49

(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

(2023年8月1日から2024年7月29日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	うち利害関係人との取引状況 D	D/C		
株式	百万円 419	百万円 -	% -	百万円 1,853	百万円 1,304	% 70.3
株式先物取引	1,306	-	-	1,332	-	-
コール・ローン	49,470	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合92.8%

\*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の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	1,374,959	1,017,115	4,595,735

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024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	4,595,735	98.8
コール・ローン等、その他	54,375	1.2
投資信託財産総額	4,650,111	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

2024年7月29日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,650,111,676円
コール・ローン等	32,515,949
茨城マザーファンド(評価額)	4,595,735,727
未収入金	21,860,000
(B) 負債	419,162,967
未払収益分配金	373,676,500
未払解約金	21,335,111
未払信託報酬	24,028,851
その他未払費用	122,505
(C) 純資産総額(A-B)	4,230,948,709
元本	2,669,117,863
次期繰越損益金	1,561,830,846
(D) 受益権総口数	2,669,117,863口
1万口当り基準価額(C/D)	15,851円

\*期首における元本額は3,313,757,101円、当作成期間中における追加設定元本額は94,699,893円、同解約元本額は739,339,131円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,851円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年8月1日 至2024年7月29日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,381円
受取利息	7,125
支払利息	△ 2,744
(B) 有価証券売買損益	827,192,898
売買益	875,621,048
売買損	△ 48,428,150
(C) 信託報酬等	△ 48,717,116
(D) 当期損益金(A + B + C)	778,480,163
(E) 前期繰越損益金	850,956,042
(F) 追加信託差損益金	306,071,141
(配当等相当額)	( 290,242,156)
(売買損益相当額)	( 15,828,985)
(G) 合計(D + E + F)	1,935,507,346
(H) 収益分配金	△ 373,676,500
次期繰越損益金(G + H)	1,561,830,846
追加信託差損益金	306,071,141
(配当等相当額)	( 290,242,156)
(売買損益相当額)	( 15,828,985)
分配準備積立金	1,255,759,705

(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	94,593,619円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	683,886,544
(c) 収益調整金	306,071,141
(d) 分配準備積立金	850,956,042
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,935,507,346
(f) 分配金	373,676,500
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,561,830,846
(h) 受益権総口数	2,669,117,863口

## 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 ( 税 込 み )

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22期 (決算日 2024年7月29日)

(作成対象期間 2023年8月1日～2024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。

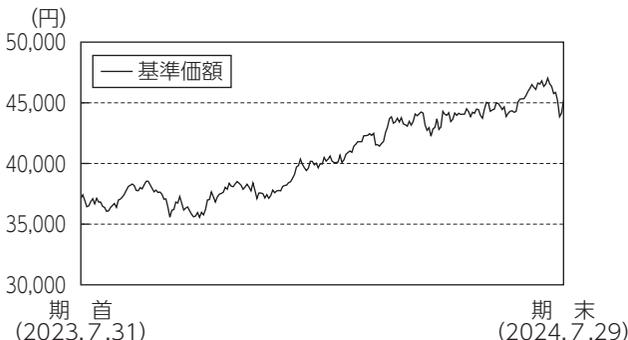
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

## 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		TOPIX(配当込み)		株 式 入 率	株 先 比	式 物 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2023年7月31日	37,119	—	3,861.80	—	90.8	%	2.1
8月末	37,473	1.0	3,878.51	0.4	96.2	%	3.1
9月末	37,055	△ 0.2	3,898.26	0.9	95.8	%	3.6
10月末	36,199	△ 2.5	3,781.64	△ 2.1	95.5	%	4.0
11月末	38,059	2.5	3,986.65	3.2	94.5	%	4.9
12月末	38,217	3.0	3,977.63	3.0	94.6	%	4.9
2024年1月末	40,498	9.1	4,288.36	11.0	95.0	%	4.4
2月末	41,795	12.6	4,499.61	16.5	95.3	%	4.5
3月末	43,767	17.9	4,699.20	21.7	95.2	%	3.9
4月末	44,296	19.3	4,656.27	20.6	95.7	%	3.9
5月末	44,470	19.8	4,710.15	22.0	95.5	%	3.9
6月末	45,337	22.1	4,778.56	23.7	94.6	%	5.0
(期末)2024年7月29日	45,184	21.7	4,693.59	21.5	87.5	%	2.8

(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：37,119円 期末：45,184円 騰落率：21.7%

## 【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

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇などから、上値の重い展開となりました。その後も、2023年8月半ばに発表された2023年4～6月期GDP(国内総生産)成長率が市場予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の

上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、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。しかし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月下旬以降は、急ピッチでの上昇が一服し、景況感の悪化や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、国内外の政治情勢の不透明感などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなりました。7月後半以降は、政府関係者による金融政策正常化への前向きな発言などで円高が進行したことや、米国による対中半導体規制の強化報道などを受けて株価は大幅に下落し、当作成期末を迎えました。

## ◆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 (株式)	2円 (1)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	2

(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

(2023年8月1日から2024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	500.5 (340.1)	419,704 ( )	697	1,853,964

(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

(2023年8月1日から2024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	1,306	1,332	-	-

(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

(2023年8月1日から2024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
めぶきフィナンシャルG		400.6	160,251	400	日立		21.8	186,374	8,549
三菱重工業		13.9	108,534	7,808	信越化学		27	146,240	5,416
アダストリア		20.1	58,835	2,927	ダイキン工業		3.8	88,703	23,342
リコー		25.1	29,283	1,166	めぶきフィナンシャルG		137.4	69,112	503
日本新薬		2.9	18,020	6,213	キャノン		17.4	68,321	3,926
関電工		8.4	10,908	1,298	セブン&アイ・HLDGS		18.2	66,916	3,676
戸田建設		13.3	10,702	804	日本たばこ産業		17.3	65,758	3,801
ニッスイ		12.9	9,816	760	小野薬品		22.5	61,944	2,753
丸千代山岡家		1	6,984	6,984	SMC		0.8	58,550	73,187
A Iメカテック		2.3	6,366	2,767	ファナック		13.3	54,017	4,061

(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			銘柄	期首			銘柄	期首			
	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		千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.2%)</b>				小野薬品	22.5	—	—	ジョイフル本田	29.9	20	43,580	
ニッスイ	—	9.5	8,417	久光製薬	3.7	2.6	10,712	セブ/&アイ・HLDGS	38.6	80.4	142,750	
<b>建設業 (5.5%)</b>				ツムラ	3.3	—	—	丸千代山岡家	—	3.1	10,183	
戸田建設	—	9.9	10,642	サワイグループHD	1.9	—	—	JMホールディングス	11.6	8.1	22,113	
住友林業	8.8	6.3	40,351	<b>石油・石炭製品 (1.0%)</b>				しまむら	1.6	2.3	16,484	
大和ハウス	28.7	20.1	84,942	出光興産	13	42.5	42,087	ヤオコー	1.7	1.3	11,826	
積水ハウス	28.9	20.2	76,760	<b>ゴム製品 (0.4%)</b>				ケースホールディングス	87	58	93,583	
関電工	—	6.3	11,226	横浜ゴム	7.4	5.2	17,633	<b>銀行業 (4.6%)</b>				
日揮ホールディングス	11.3	7.9	10,001	<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				めぶきフィナンシャルG	47.4	310.6	188,472	
晩飯島工業	1	0.8	1,524	AGC	9.9	6.6	34,650	筑波銀行	35.9	25.2	7,761	
<b>食料品 (12.2%)</b>				<b>鉄鋼 (2.5%)</b>				<b>不動産業 (0.0%)</b>				
山崎製パン	9.6	6.7	24,388	日本製鉄	41.4	29.4	94,903	香陵住販	1.2	1	1,530	
カルビー	5.8	4.1	13,759	丸一鋼管	3.7	2.6	9,458					
森永乳業	2.1	2.8	9,839	シンニッタン	23.9	18.6	4,352	合計	株数、金額	1,548.9	1,692.5	4,293,650
ヤクルト	7.4	10.4	30,045	<b>非鉄金属 (1.6%)</b>				銘柄数<比率>	80銘柄	80銘柄	<87.5%>	
明治ホールディングス	12.8	9	34,218	三菱マテリアル	5.7	4	11,146					
日本ハム	4.5	3.1	15,230	住友電工	34.6	24.2	55,599					
伊藤ハム米久HLDGS	12.5	—	—	<b>金属製品 (0.3%)</b>								
アサヒグループホールディングス	22.1	15.5	87,823	東洋製罐グループHD	8	5.4	13,575					
麒麟HD	39.8	27.9	59,050	<b>機械 (18.3%)</b>								
不二製油グループ	3.8	—	—	A Iメカテック	—	1.9	4,124					
キュービー	6.2	4.3	16,494	S M C	2.9	2.1	152,880					
カゴメ	4.1	2.9	10,057	小松製作所	42.4	29.7	134,333					
日清食品HD	4.5	9.4	41,491	日立建機	9.4	6.6	24,842					
日本たばこ産業	58	40.7	179,731	クボタ	51.8	35.9	78,387					
<b>繊維製品 (0.9%)</b>				ダイキン工業	12.8	9	200,430					
東レ	71	49.8	39,018	三菱重工業	—	103	189,211					
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>				<b>電気機器 (19.9%)</b>								
レンゴー	11.8	8.3	8,632	日立	40.8	131	423,654					
<b>化学 (16.5%)</b>				富士電機	6.5	4.6	39,343					
クラレ	15.4	10.8	20,266	安川電機	11.6	8.1	42,176					
住友化学	72.1	50.6	19,101	ファナック	43.7	30.4	129,564					
フレハ	0.9	—	—	キヤノン	58.1	40.7	194,464					
信越化学	88.1	61.1	418,168	リコー	—	18.6	25,956					
エア・ウォーター	10	7	15,246	<b>輸送用機器 (0.3%)</b>								
カネカ	3	2	8,508	N O K	7.5	5.3	11,474					
三菱瓦斯化学	9.7	6.6	18,773	<b>精密機器 (0.8%)</b>								
J S R	9.1	—	—	助川電気工業	2.6	1.8	2,836					
三菱ケミカルグループ	65.6	46	40,585	東京精密	1.8	1.3	13,117					
積水化学	19.7	13.6	30,600	ニゴン	15.3	10.7	18,243					
アイカ工業	2.9	2.1	7,158	<b>その他製品 (1.1%)</b>								
日本化薬	7.4	—	—	大日本印刷	12.7	8.5	42,100					
A D E K A	4.5	3.2	10,230	ビジョン	5.3	3.7	5,605					
日油	3.6	7.4	15,976	日本アイ・エス・ケイ	0.8	0.6	881					
花王	20.3	14.2	96,048	<b>情報・通信業 (0.0%)</b>								
D I C	4.1	2.9	8,972	アクモス	4.4	3.1	1,807					
<b>医薬品 (3.8%)</b>				<b>卸売業 (-)</b>								
アステラス製薬	78.8	55.3	94,590	アズワン	1.8	—	—					
日本新薬	—	2.1	7,249	<b>小売業 (9.1%)</b>								
エーザイ	12.9	9.1	52,488	アダストリア	—	14.9	48,201					

(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	137	—

(注) 単位未満は切捨て。

(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。

■投資信託財産の構成

2024年7月29日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,293,650	86.8
コール・ローン等、その他	654,209	13.2
投資信託財産総額	4,947,859	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

2024年7月29日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,026,130,718円</b>
コール・ローン等	244,236,666
株式(評価額)	4,293,650,380
未収入金	386,560,622
未収配当金	15,152,050
差入委託証拠金	86,531,000
<b>(B) 負債</b>	<b>119,431,800</b>
未払金	2,933,800
未払解約金	38,227,000
差入委託証拠金代用有価証券	78,271,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>4,906,698,918</b>
元本	1,085,937,327
次期繰越損益金	3,820,761,591
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,085,937,327口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>45,184円</b>

\* 期首における元本額は1,468,552,901円、当作成期間中における追加設定元本額は32,803,128円、同解約元本額は415,418,702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) 68,821,594円  
 茨城ファンド 1,017,115,733円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は45,184円です。

■損益の状況

当期 自2023年8月1日 至2024年7月29日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>116,803,957円</b>
受取配当金	116,775,670
受取利息	57,505
その他収益金	669
支払利息	△ 29,887
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>779,681,692</b>
売買益	1,009,444,948
売買損	△ 229,763,256
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>47,889,800</b>
取引益	51,505,800
取引損	△ 3,616,000
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 48</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>944,375,401</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>3,982,606,666</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△1,196,902,348</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>90,681,872</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>3,820,761,591</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>3,820,761,591</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。

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J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社 (以下「J P X」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J P Xが有する。J P X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、J P X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J P Xは責任を負わない。