

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213期 (決算日 2024年7月10日)

第214期 (決算日 2024年8月13日)

第215期 (決算日 2024年9月10日)

第216期 (決算日 2024年10月10日)

第217期 (決算日 2024年11月11日)

第218期 (決算日 2024年12月10日)

(作成対象期間 2024年6月11日~2024年12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 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)円	税金 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				
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
213期末(2024年7月10日)	10,797	15	3.4	4,947.89	4.7	19,485	3.7	30.0	64.6	-	2,240
214期末(2024年8月13日)	10,042	15	△6.9	4,343.30	△12.2	18,354	△5.8	29.6	64.8	-	2,076
215期末(2024年9月10日)	10,042	40	0.4	4,383.54	0.9	18,040	△1.7	28.9	65.8	-	2,185
216期末(2024年10月10日)	10,370	15	3.4	4,659.00	6.3	18,600	3.1	29.4	65.1	-	2,261
217期末(2024年11月11日)	10,401	15	0.4	4,705.70	1.0	18,755	0.8	30.0	65.2	-	2,241
218期末(2024年12月10日)	10,246	100	△0.5	4,710.38	0.1	18,713	△0.2	31.0	65.2	-	2,143

(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。

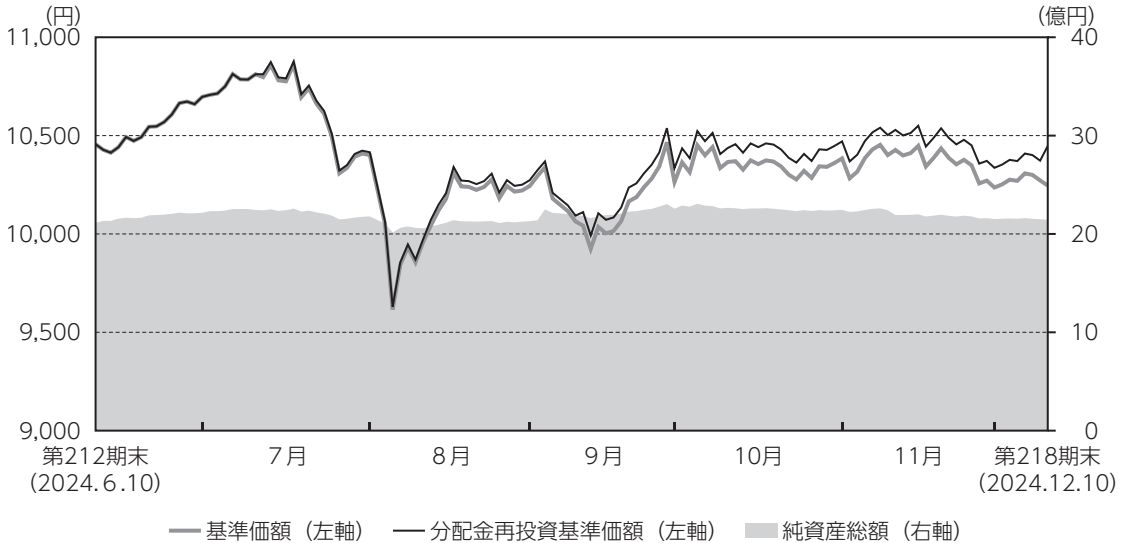
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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213期首：10,456円

第218期末：10,246円（既払分配金200円）

騰落率：△0.1%（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	△0.5%	68.8%

■ 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、投資している債券の価格上昇や保有債券からの利息収入がプラス要因となった一方で、投資対象通貨が円に対して下落（円高）したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。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213期	(期首) 2024年 6月10日	円	%					%	%	%
	6月末	10,456	-	4,727.13	-	18,785	-	31.0	66.3	-
	(期末) 2024年 7月10日	10,697	2.3	4,778.56	1.1	19,300	2.7	30.0	64.3	-
第214期	(期首) 2024年 7月10日	10,812	3.4	4,947.89	4.7	19,485	3.7	30.0	64.6	-
	7月末	10,797	-	4,947.89	-	19,485	-	30.0	64.6	-
	(期末) 2024年 8月13日	10,401	△3.7	4,752.72	△ 3.9	18,889	△3.1	30.5	63.8	-
第215期	(期首) 2024年 8月13日	10,057	△6.9	4,343.30	△12.2	18,354	△5.8	29.6	64.8	-
	8月末	10,042	-	4,343.30	-	18,354	-	29.6	64.8	-
	(期末) 2024年 9月10日	10,244	2.0	4,615.06	6.3	18,221	△0.7	30.9	63.7	-
第216期	(期首) 2024年 9月10日	10,082	0.4	4,383.54	0.9	18,040	△1.7	28.9	65.8	-
	9月末	10,042	-	4,383.54	-	18,040	-	28.9	65.8	-
	(期末) 2024年10月10日	10,264	2.2	4,544.38	3.7	18,207	0.9	29.3	65.2	-
第217期	(期首) 2024年10月10日	10,385	3.4	4,659.00	6.3	18,600	3.1	29.4	65.1	-
	10月末	10,370	-	4,659.00	-	18,600	-	29.4	65.1	-
	(期末) 2024年11月11日	10,384	0.1	4,629.83	△ 0.6	18,906	1.6	29.1	65.5	-
第218期	(期首) 2024年11月11日	10,416	0.4	4,705.70	1.0	18,755	0.8	30.0	65.2	-
	11月末	10,401	-	4,705.70	-	18,755	-	30.0	65.2	-
	(期末) 2024年12月10日	10,236	△1.6	4,606.07	△ 2.1	18,655	△0.5	30.5	64.6	-
		10,346	△0.5	4,710.38	0.1	18,713	△0.2	31.0	65.2	-

(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

(2024.6.11~2024.12.10)

■国内株式市況

国内株式市況は、史上最高値を更新後、乱高下を経てレンジ相場となりました。

国内株式市況は、当作成期首より、海外のAI（人工知能）関連企業の株価急騰や円安進行などが好感されて上昇し、史上最高値を更新しました。しかし2024年7月中旬に入り、米国の対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落すると、7月末には日銀の利上げ決定と植田日銀総裁のタカ派発言で金融政策の不透明感がにわかに強まったことに加え、8月初旬に発表された米国の雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから急速に円高が進行し、株価は数日のうちに当作成期首を下回る水準まで急落しました。歴史的な急落を演じた後は、内田日銀副総裁のハト派発言や米国の経済指標の改善などを受けて株価は急反発し、9月初旬には急落直前の水準をほぼ回復しました。その後は、9月中旬にかけて円高が進行したことや10月下旬の衆議院議員選挙で与党が過半数割れとなったこと、11月初旬の米国大統領選挙でトランプ元大統領が勝利し関税引き上げを巡る不透明感が強まったことなどから、一時的に下落する局面はありましたが、高水準の自社株買いなどが下値を支え、総じてレンジ内での推移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、金利は低下（債券価格は上昇）しました。

当作成期首より、米国などで経済指標が市場予想対比で下振れたことから、主要国の金利は低下しました。その後も、各国中央銀行が利下げに着手する中で景気鈍化懸念が高まったことなどから、金利は低下基調となりました。しかし、米国の雇用統計などの経済指標が底堅さを示す中で過度な景気鈍化懸念が後退したことに加え、米国大統領選挙に関連して財政や関税政策への懸念などから、金利はこれまでの低下幅を縮小しました。当作成期末にかけては、各国中央銀行の追加利下げへの思惑などから、主要国の金利は低下に転じる展開となりました。

■為替相場

為替相場は対円で下落しました。

当作成期首より、米国金利の低下などを背景に円高となりました。その後も、各種経済指標が予想を下振れて景気鈍化懸念が高まったことや日銀による利上げなどを背景に、円高基調となりました。しかし、過度な景気鈍化懸念の後退などを背景に米国金利が上昇したことを受け、日米金利差の拡大が意識されて米ドルは対円で下落幅を縮小し、他の主要通貨もこれに連れる動きとなりました。当作成期末にかけては、各国中央銀行の追加利下げへの思惑などから主要国の金利が再度低下に転じたことや、日銀総裁が利上げを継続する方針を示したことなどから、主要国通貨は対円で下落に転じました。

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

(2024.6.11～2024.12.10)

■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機械や鉄鋼、ゴム製品などの比率が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。

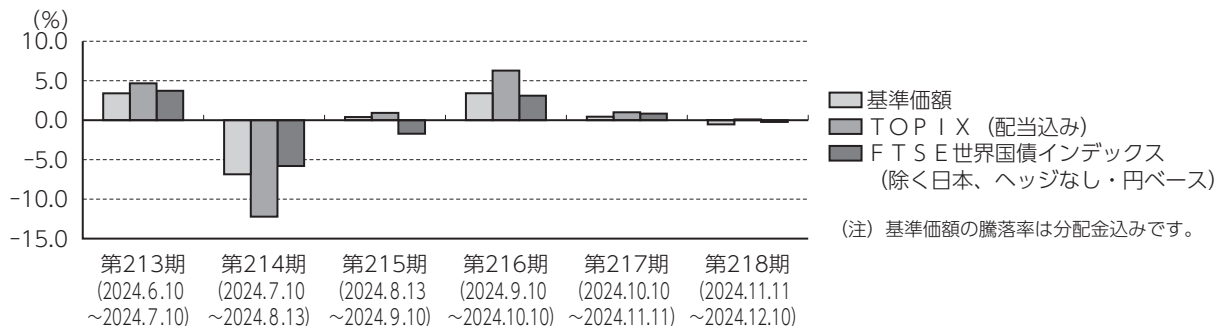
ポートフォリオの修正デュレーションは、5（年）程度～10（年）程度の範囲の中で変動させました。

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213期	第214期	第215期	第216期	第217期	第218期
	2024年6月11日 ～2024年7月10日	2024年7月11日 ～2024年8月13日	2024年8月14日 ～2024年9月10日	2024年9月11日 ～2024年10月10日	2024年10月11日 ～2024年11月11日	2024年11月12日 ～2024年12月10日
当期分配金（税込み）（円）	15	15	40	15	15	100
対基準価額比率（%）	0.14	0.15	0.40	0.14	0.14	0.97
当期の収益（円）	15	3	9	15	12	2
当期の収益以外（円）	-	11	30	-	2	97
翌期繰越分配対象額（円）	3,066	3,055	3,025	3,053	3,051	2,954

(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213期	第214期	第215期	第216期	第217期	第218期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 20.99円	✓ 3.92円	✓ 9.23円	✓ 43.02円	✓ 12.68円	✓ 2.65円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	327.52	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
(c) 収益調整金	1,612.64	1,649.55	1,726.57	1,759.08	1,767.71	1,779.11
(d) 分配準備積立金	1,120.51	✓ 1,417.32	✓ 1,329.46	1,266.54	✓ 1,285.97	✓ 1,272.31
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,081.67	3,070.80	3,065.27	3,068.65	3,066.37	3,054.09
(f) 分配金	15.00	15.00	40.00	15.00	15.00	100.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,066.67	3,055.80	3,025.27	3,053.65	3,051.37	2,954.09

(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213期～第218期 (2024.6.11～2024.12.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	66円	0.634%	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10,355円です。
（投 信 会 社）	(34)	(0.331)	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）	(29)	(0.276)	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）	(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	0	0.000	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)	(0.000)	
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	0.011	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)	(0.007)	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。

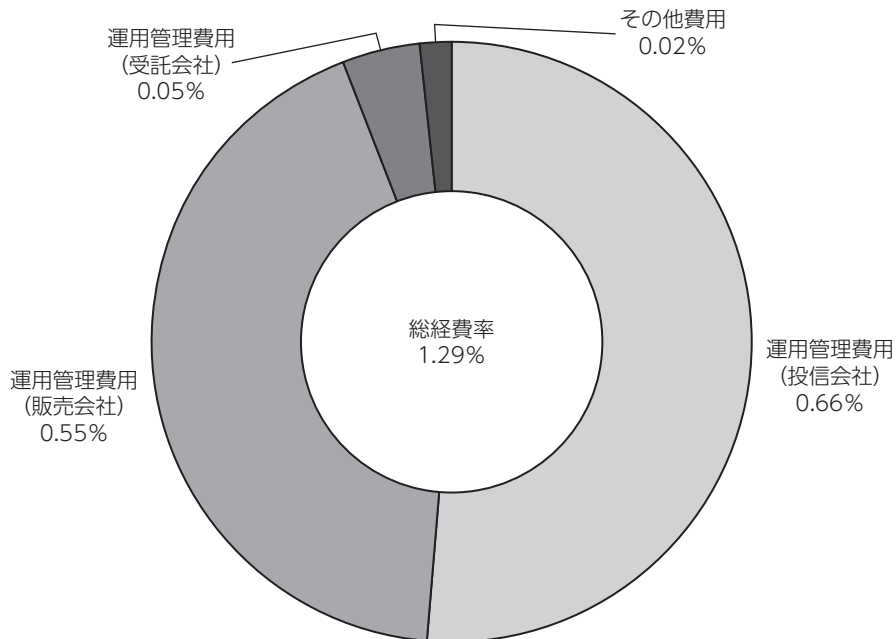
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.29%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

(2024年6月11日から2024年12月10日まで)

決 算 期	第 213 期 ～ 第 218 期			
	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	33.1 (21.9)	78,040 (-)	32.9	78,833

(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

(2024年6月11日から2024年12月10日まで)

決 算 期	第 213 期 ～ 第 218 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	103,995	224,573	96,161	207,450

(注) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2024年6月11日から2024年12月10日まで)

第 213 期					～	第 218 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	
三菱重工業		8.8	16,547	1,880	MonotaRO		12.8	29,007	2,266	
三菱電機		5.6	12,811	2,287	アシックス		10.4	27,139	2,609	
日本製鉄		2.7	8,848	3,277	エイチ・ツー・オーリテイリング		3.3	6,841	2,073	
クボタ		3.2	6,592	2,060	川崎重工業		1.3	6,462	4,971	
塩野義製薬		0.8	5,324	6,655	川崎汽船		1.7	3,530	2,076	
神戸製鋼所		2.9	5,114	1,763	ハイレックスコーポレーション		2	2,821	1,410	
住友電工		2.2	5,100	2,318	関西ペイント		0.5	1,286	2,572	
シスメックス		0.9	2,503	2,781	アルトナー		0.5	916	1,832	
IHI		0.4	2,410	6,026	三ツ星ベルト		0.1	419	4,194	
日油		0.7	1,563	2,233	上組		0.1	332	3,329	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■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

(1) 国内株式

銘柄	第212期末		第218期末		銘柄	第212期末		第218期末		銘柄	第212期末		第218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
食料品 (2.2%)					機械 (14.3%)									
モロゾフ	0.4	0.4	1,820		タクマ	4.3	4.4	7,123		WDBホールディングス	1	1.1	1,868	
六甲バター	1.1	1.1	1,522		日工	2.1	2.1	1,491		大栄環境	5.1	5.3	16,006	
S Foods	1.7	1.7	4,632		クボタ	12.5	15.7	29,280		日本財ホーディング	2.1	2.2	5,693	
フジッコ	1.5	1.6	2,739		帝国電機製作所	1	1	2,730		合計	株数、金額	千株	千株	千円
ロックフィールド	1.4	1.4	2,130		グローリー	3	3.1	7,967		銘柄数<比率>	254.9	277	664,537	
ケンコーマヨネーズ	0.8	0.9	1,949		三菱重工業	9	17.8	40,165		70銘柄	70銘柄	<31.0%>		
繊維製品 (1.4%)					IHI	0.4	0.8	6,580		(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。				
日本毛織	4	4	5,092		電気機器 (11.0%)					(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
ワールド	1.8	1.8	4,446		三菱電機	5.5	11.1	28,993		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
化学 (7.6%)					TOA	1.8	1.8	1,656						
住友精化	0.7	0.7	3,311		古野電気	1.6	1.7	4,482						
多木化学	0.5	0.5	1,755		日本電子材料	0.6	0.7	1,470						
日油	0.6	1.3	2,890		シスメックス	10.5	11.4	35,248						
石原ケミカル	0.8	0.8	1,968		大真空	1.9	1.9	1,033						
関西ペイント	11.6	11.1	23,920		輸送用機器 (7.0%)									
ライオン	0.8	1.5	2,751		ジャパンエンジンコーポ	-	0.3	1,230						
ノエビアホールディングス	1.8	1.8	8,982		川崎重工業	7.9	6.6	40,240						
メック	1	1.1	3,756		新明和工業	3.6	3.7	4,880						
東リ	3.4	3.2	1,468		ハイレックスコーポレーション	2	-	-						
医薬品 (2.3%)					その他製品 (5.7%)									
塩野義製薬	0.8	4.8	10,476		アシックス	5.7	12.4	37,658						
JCRファーマ	6.7	6.8	4,664		陸運業 (0.5%)									
ゴム製品 (8.6%)					山陽電鉄	1.1	1.2	2,432						
TOYO TIRE	7.9	8.1	19,488		神姫バス	0.3	0.3	1,023						
住友ゴム	13.5	13.9	23,894		海運業 (5.0%)									
ニチリン	0.7	0.8	2,840		川崎汽船	17.1	15.4	32,147						
三ツ星ベルト	1.7	1.6	6,560		明海グループ	1.8	1.9	1,276						
バンドー化学	2.3	2.3	4,314		倉庫・運輸関連業 (3.1%)									
ガラス・土石製品 (0.5%)					上組	6	5.9	20,449						
日本山硝硝子	-	0.6	966		卸売業 (8.0%)									
SECカーボン	1	1.1	2,292		神戸物産	7.3	7.5	27,277						
鉄鋼 (11.3%)					兼松	4.3	4.5	11,423						
日本製鉄	2.4	5.1	15,641		トーヨー	0.6	0.6	1,677						
神戸製鋼所	15.6	18.5	28,240		西本WISMETTAC HD	0.7	2.3	4,432						
大和工業	3.3	3.4	25,697		加藤産業	1.8	1.8	8,217						
山陽特殊製鋼	2.8	2.9	5,234		小売業 (2.8%)									
日亜鋼業	-	0.1	30		MonotaRO	15.4	2.6	6,952						
非鉄金属 (3.4%)					G-7ホールディングス	2.3	2.3	3,208						
大阪チタニウム	1.9	1.9	3,421		西松屋チェーン	3.6	3.7	8,661						
住友電工	2	4.2	12,282		関西フードマーケット	3.3	-	-						
AREホールディングス	4.1	4.2	7,173		不動産業 (0.1%)									
金属製品 (1.6%)					ファースト住建	0.9	0.9	878						
トーカロ	3.1	3.2	5,907		サービス業 (3.5%)									
ノーリツ	2.6	2.6	4,417		アルトナー	0.5	-	-						

(2) 親投資信託残高

種類	第212期末		第218期末	
	口数	千口	口数	千口
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	674,415	674,415	682,249	682,249

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月10日現在

項 目	第 218 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 664,537	% 30.7
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	1,473,863	68.0
コール・ローン等、その他	29,214	1.3
投資信託財産総額	2,167,615	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、12月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=151.54円、1カナダ・ドル=106.91円、1オーストラリア・ドル=97.43円、1イギリス・ポンド=193.21円、1デンマーク・クローネ=21.44円、1ノルウェー・クローネ=13.63円、1スウェーデン・クローネ=13.89円、1チェコ・コルナ=6.371円、1ポーランド・ズロチ=37.545円、1ユーロ=159.91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218期末における外貨建純資産（15,342,867千円）の投資信託財産総額（15,497,318千円）に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2024年7月10日)、(2024年8月13日)、(2024年9月10日)、(2024年10月10日)、(2024年11月11日)、(2024年12月10日)現在

項 目	第 213 期 末	第 214 期 末	第 215 期 末	第 216 期 末	第 217 期 末	第 218 期 末
(A) 資産	2,262,442,907円	2,107,993,779円	2,197,040,006円	2,273,288,416円	2,255,196,495円	2,167,615,927円
コール・ローン等	50,256,680	53,846,428	57,066,129	50,035,636	49,774,844	28,795,800
株式(評価額)	671,563,700	615,232,750	630,661,050	665,294,550	671,382,450	664,537,900
ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド(評価額)	1,523,393,727	1,406,777,301	1,508,518,227	1,540,747,030	1,526,660,451	1,473,863,227
未収入金	15,450,000	30,000,000	—	10,000,000	—	—
未収配当金	1,778,800	2,137,300	794,600	7,211,200	7,378,750	419,000
(B) 負債	21,824,014	31,762,688	11,692,505	11,935,282	14,070,313	23,995,327
未払収益分配金	3,112,889	3,101,345	8,705,100	3,271,034	3,232,068	20,922,415
未払解約金	16,408,012	26,081,958	860,051	6,269,975	8,271,461	796,263
未払信託報酬	2,288,202	2,547,875	2,082,277	2,333,987	2,490,276	2,185,896
その他未払費用	14,911	31,510	45,077	60,286	76,508	90,753
(C) 純資産総額(A-B)	2,240,618,893	2,076,231,091	2,185,347,501	2,261,353,134	2,241,126,182	2,143,620,600
元本	2,075,259,753	2,067,563,634	2,176,275,131	2,180,689,381	2,154,712,533	2,092,241,536
次期繰越損益金	165,359,140	8,667,457	9,072,370	80,663,753	86,413,649	51,379,064
(D) 受益権総口数	2,075,259,753口	2,067,563,634口	2,176,275,131口	2,180,689,381口	2,154,712,533口	2,092,241,536口
1万口当り基準価額(C/D)	10,797円	10,042円	10,042円	10,370円	10,401円	10,246円

* 当作成期首における元本額は2,020,502,937円、当作成期間（第213期～第218期）中における追加設定元本額は373,462,737円、同解約元本額は301,724,138円です。

* 第218期末の計算口数当りの純資産額は10,246円です。

兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）

■損益の状況

第213期 自2024年6月11日 至2024年7月10日 第216期 自2024年9月11日 至2024年10月10日
 第214期 自2024年7月11日 至2024年8月13日 第217期 自2024年10月11日 至2024年11月11日
 第215期 自2024年8月14日 至2024年9月10日 第218期 自2024年11月12日 至2024年12月10日

項 目	第 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期	第 218 期
(A) 配当等収益	1,681,433円	403,826円	230,703円	6,883,828円	406,019円	89,858円
受取配当金	1,675,787	397,000	217,192	6,874,286	395,950	83,000
受取利息	4,217	6,818	9,933	9,497	10,069	6,858
その他収益金	1,429	8	3,578	45	-	-
(B) 有価証券売買損益	72,947,137	△149,520,062	7,787,756	69,628,038	12,049,709	△ 9,455,854
売買益	85,482,534	16,788,736	26,603,261	77,681,605	31,923,835	14,154,257
売買損	△ 12,535,397	△166,308,798	△ 18,815,505	△ 8,053,567	△ 19,874,126	△ 23,610,111
(C) 信託報酬等	△ 2,303,113	△ 2,564,474	△ 2,095,844	△ 2,349,196	△ 2,506,498	△ 2,200,141
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	72,325,457	△151,680,710	5,922,615	74,162,670	9,949,230	△ 11,566,137
(E) 前期繰越損益金	232,535,104	293,041,664	137,582,451	131,729,198	198,877,906	197,870,718
(F) 追加信託差損益金	△136,388,532	△129,592,152	△125,727,596	△121,957,081	△119,181,419	△114,003,102
(配当等相当額)	(334,666,657)	(341,055,412)	(375,749,420)	(383,601,080)	(380,892,506)	(372,234,861)
(売買損益相当額)	(△471,055,189)	(△470,647,564)	(△501,477,016)	(△505,558,161)	(△500,073,925)	(△486,237,963)
(G) 合計(D+E+F)	168,472,029	11,768,802	17,777,470	83,934,787	89,645,717	72,301,479
(H) 収益分配金	△ 3,112,889	△ 3,101,345	△ 8,705,100	△ 3,271,034	△ 3,232,068	△ 20,922,415
次期繰越損益金(G+H)	165,359,140	8,667,457	9,072,370	80,663,753	86,413,649	51,379,064
追加信託差損益金	△136,388,532	△129,592,152	△125,727,596	△121,957,081	△119,181,419	△114,003,102
(配当等相当額)	(334,666,657)	(341,055,412)	(375,749,420)	(383,601,080)	(380,892,506)	(372,234,861)
(売買損益相当額)	(△471,055,189)	(△470,647,564)	(△501,477,016)	(△505,558,161)	(△500,073,925)	(△486,237,963)
分配準備積立金	301,747,672	290,752,252	282,633,209	282,306,342	276,591,679	245,832,381
繰越損益金	-	△152,492,643	△147,833,243	△ 79,685,508	△ 70,996,611	△ 80,450,215

(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 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期	第 218 期
(a) 経費控除後の配当等収益	4,356,535円	811,933円	2,010,081円	9,382,599円	2,732,328円	554,857円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	67,968,922	0	0	0	0	0
(c) 収益調整金	334,666,657	341,055,412	375,749,420	383,601,080	380,892,506	372,234,861
(d) 分配準備積立金	232,535,104	293,041,664	289,328,228	276,194,777	277,091,419	266,199,939
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	639,527,218	634,909,009	667,087,729	669,178,456	660,716,253	638,989,657
(f) 分配金	3,112,889	3,101,345	8,705,100	3,271,034	3,232,068	20,922,415
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	636,414,329	631,807,664	658,382,629	665,907,422	657,484,185	618,067,242
(h) 受益権総口数	2,075,259,753□	2,067,563,634□	2,176,275,131□	2,180,689,381□	2,154,712,533□	2,092,241,536□

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ						
	第 213 期	第 214 期	第 215 期	第 216 期	第 217 期	第 218 期
1万口当り分配金（税込み）	15円	15円	40円	15円	15円	100円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

配当込みT O P I X（本書類における「T O P I X（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。

<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10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218期の決算日（2024年12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

(2024年6月11日から2024年12月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
UNITED KINGDOM GILT (イギリス)	4.25% 2034/7/31	685,721	CANADA HOUSING TRUST (カナダ)	2.25% 2025/12/15	471,501
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.375% 2033/5/15	209,125	United Kingdom Gilt (イギリス)	1.625% 2028/10/22	382,920
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	123,303	United Kingdom Gilt (イギリス)	1.5% 2026/7/22	369,616
SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	3.45% 2043/7/30	78,713	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	285,590
			CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	0.5% 2030/12/1	254,908
			UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.25% 2052/2/15	127,289
			SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン)	1.95% 2026/4/30	79,186

(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12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（7,171,213千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2024年12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 32,786	千アメリカ・ドル 25,694	千円 3,893,763	% 25.1	% -	% 25.0	% 0.1	% -
カナダ	千カナダ・ドル 11,100	千カナダ・ドル 10,966	1,172,424	7.6	-	7.6	-	-
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 20,354	1,983,170	12.8	-	10.8	2.0	-
イギリス	千イギリス・ポンド 12,445	千イギリス・ポンド 9,797	1,892,946	12.2	-	10.5	1.1	0.6
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 27,386	587,159	3.8	-	1.0	-	2.8
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 16,887	230,178	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 8,105	112,591	0.7	-	-	-	0.7
チェコ	千チェコ・コルナ 45,000	千チェコ・コルナ 45,108	287,407	1.9	-	-	0.7	1.2
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 16,100	千ポーランド・ズロチ 14,234	534,433	3.4	-	1.1	2.4	0.0
ユーロ（ベルギー）	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,147	343,440	2.2	-	2.2	-	-
ユーロ（フランス）	千ユーロ 500	千ユーロ 410	65,715	0.4	-	0.4	-	-
ユーロ（スペイン）	千ユーロ 20,186	千ユーロ 18,864	3,016,633	19.5	-	10.2	9.2	0.1

2024年12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	
	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%	%
ユーロ (その他)	3,500	3,581	572,770	3.7	—	3.7	—	—	—
ユーロ (小計)	26,136	25,005	3,998,558	25.8	—	16.5	9.2	0.1	
合 計	—	—	14,692,635	94.8	—	72.5	15.4	6.9	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12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12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 617	千円 93,530	2046/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	100	95	14,451	2027/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	7,686	4,841	733,690	2040/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	16,600	13,819	2,094,257	2030/11/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,600	1,696	257,099	2052/02/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	4,900	4,624	700,733	2033/05/15		
通貨小計	銘柄数 金額	6銘柄		32,786	25,694	3,893,763			
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 1,585	169,533	2045/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,054	219,643	2048/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	869	92,946	2030/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	935	100,050	2032/06/01		
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	3.5500	3,000	3,062	327,388	2032/09/15		
	CANADA HOUSING TRUST	特殊債券	3.6500	2,400	2,458	262,862	2033/06/15		
通貨小計	銘柄数 金額	6銘柄		11,100	10,966	1,172,424			
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 9,236	899,914	2033/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,000	3,336	325,055	2051/06/21		
	SWEDISH EXPORT CREDIT	特殊債券	4.3000	800	796	77,633	2028/05/30		
	INTL. FIN. CORP.	特殊債券	1.2500	5,600	4,635	451,665	2031/02/06		
	AFRICAN DEVELOPMENT BK.	特殊債券	1.1000	2,500	2,349	228,902	2026/12/16		
通貨小計	銘柄数 金額	5銘柄		23,900	20,354	1,983,170			
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	500	479	92,716	2026/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,000	918	177,457	2028/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,400	554	107,085	2050/10/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	3,095	2,423	468,334	2031/07/31		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	851	164,425	2051/07/31		
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.2500	3,650	3,643	703,890	2034/07/31		
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	926	179,036	2046/12/07		
通貨小計	銘柄数 金額	7銘柄		12,445	9,797	1,892,946			
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 7,230	155,028	2039/11/15		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	20,200	20,155	432,130	2025/11/15		
通貨小計	銘柄数 金額	2銘柄		25,700	27,386	587,159			

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

2024年12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		
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 16,887	千円 230,178	2025/03/13	
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		17,000	16,887	230,178		
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 8,105	112,591	2026/11/12	
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		8,230	8,105	112,591		
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 28,872 16,235	183,961 103,445	2026/06/26 2029/03/29	
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	2銘柄		45,000	45,108	287,407		
ポーランド	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	0.7500 1.2500 3.7500 2.7500	千ポーランド・ズロチ 100 5,500 500 10,000	千ポーランド・ズロチ 98 4,376 485 9,273	3,700 164,308 18,228 348,195	2025/04/25 2030/10/25 2027/05/25 2028/04/25	
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	4銘柄		16,100	14,234	534,433		
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 2,147	343,440	2045/06/22	
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		1,950	2,147	343,440		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	千ユーロ 500	千ユーロ 410	65,715	2032/05/25	
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		500	410	65,715		
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND 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 国債証券	1.9500 2.9000 1.4000 1.2000 1.9000 3.4500	千ユーロ 100 7,400 9,136 2,600 450 500	千ユーロ 99 7,039 8,891 1,982 336 516	15,944 1,125,670 1,421,813 316,950 53,738 82,515	2026/04/30 2046/10/31 2028/04/30 2040/10/31 2052/10/31 2043/07/30	
国小計	銘 柄 数 額 金 額	6銘柄		20,186	18,864	3,016,633		
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 3,581	572,770	2030/07/30	
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		3,500	3,581	572,770		
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	9銘柄		26,136	25,005	3,998,558		
合 計	銘 柄 数 額 金 額	43銘柄				14,692,635		

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12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39期 (決算日 2024年10月10日)

(作成対象期間 2024年4月11日～2024年10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。

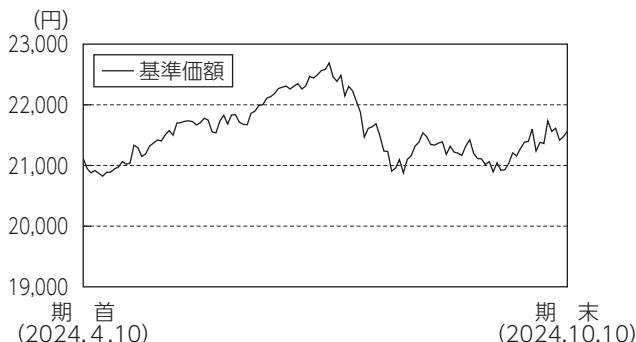
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	内外の公社債等
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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/>

■当作成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2024年4月10日	21,114	-	20,769	-	95.9	-
4月末	21,334	1.0	21,124	1.7	96.0	-
5月末	21,537	2.0	21,267	2.4	95.5	-
6月末	22,309	5.7	21,974	5.8	95.0	-
7月末	21,488	1.8	21,506	3.6	95.3	-
8月末	21,168	0.3	20,746	△0.1	95.6	-
9月末	21,239	0.6	20,730	△0.2	95.0	-
期末2024年10月10日	21,562	2.1	21,177	2.0	95.6	-

- (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：21,114円 期末：21,562円 騰落率：2.1%

【基準価額の主な変動要因】

投資対象通貨が円に対して下落(円高)したことなどはマイナス要因となりましたが、投資している債券からの利息収入や債券価格の上昇などがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。<わくはくは投資環境について>をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

海外債券市場では、主要国を中心に金利は低下(債券価格は上昇)しました。

当作成期首より、経済指標が市場予想を上振れるなど、底堅い米国経済が確認されたことや、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を受け、米国金利は利下

げ織り込みがはか落して上昇(債券価格は下落)する中、主要国も連れて金利は上昇しました。その後は、各国中央銀行の利下げや経済指標の下振れなどを背景に金利は低下に転じました。当作成期末にかけては、米国の雇用統計などの各種経済指標が底堅さを示す中、過度な景気鈍化懸念が後退したことなどを背景に、米国金利はこれまでの低下幅を縮小し、主要国の金利も同様に低下幅を一部巻き戻しました。

○為替相場

為替相場は、おおむね対円で下落(円高)しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、米国金利の上昇に加え、日本の金融市場は他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどを背景に、円安基調となりました。その後は、各種経済指標が予想を下振れ景気鈍化懸念が高まったことや日銀による利上げなどを背景に、米ドルは対円で下落に転じました。当作成期末にかけては、過度な景気鈍化懸念が後退する中、米ドルは対円での下落幅を縮小する展開となりました。その他の主要通貨の対円為替相場も、おおむね米ドル円に連れる展開となりました。なお、サービスインフレの高止まりや堅調な小売りを背景にインフレへの警戒感が残存する英ポンドは、対円で上昇(円安)する展開となりました。

◆前作成期末における「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》

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 (先物・オプション)	0円 (0)
有価証券取引税	-
その他費用 (保管費用) (その他)	2 (2) (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) 公社債

(2024年4月11日から2024年10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 863	千アメリカ・ドル 1,449 (-)
		国債証券	千カナダ・ドル -	千カナダ・ドル 1,386 (-)
国	カナダ	特殊債券	-	3,140 (-)

(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。

(2) オプションの種類別取引状況

(2024年4月11日から2024年10月10日まで)

種類別	コール プット別	買				建				売				建			
		新 買	付 規 額	決 済 額	権 行	利 使	権 放	利 業	新 売	付 規 額	決 済 額	権 被 行	利 使	義 消	務 減		
外 国	債券先物オプション取引	コール	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -	百万円 -		
		プット	-	-	-	-	-	0	0	-	-	-	-	-	-		

(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

公社債

(2024年4月11日から2024年10月10日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘	柄	金	額	銘	柄	金	額
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	千円 123,303		CANADA HOUSING TRUST (カナダ)	2.25% 2025/12/15	千円 363,683	
				CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	0.5% 2030/12/1	158,934	
				UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.25% 2052/2/15	127,289	
				United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	87,353	

(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。

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	当 期		期 末		うちB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 以 下 組 入 比 率		5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額						
アメリカ	千アメリカ・ドル 33,286	千アメリカ・ドル 26,323	千円 3,933,050	% 24.7	% -	% 22.8	% 1.9	% -
カナダ	千カナダ・ドル 14,854	千カナダ・ドル 14,045	1,530,569	9.6	-	8.9	-	0.7
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 20,306	2,038,790	12.8	-	10.8	2.0	-
イギリス	千イギリス・ポンド 13,015	千イギリス・ポンド 10,129	1,978,315	12.4	-	5.9	3.6	3.0
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 27,048	592,641	3.7	-	1.0	-	2.8
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 16,812	232,848	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 8,080	116,033	0.7	-	-	0.7	-
チェコ	千チェコ・コルナ 45,000	千チェコ・コルナ 45,087	290,727	1.8	-	-	0.7	1.2
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 14,370	546,473	3.4	-	1.0	2.3	0.0
ユーロ（ベルギー）	千ユーロ 1,950	千ユーロ 2,069	338,313	2.1	-	2.1	-	-
ユーロ（フランス）	千ユーロ 500	千ユーロ 404	66,166	0.4	-	0.4	-	-
ユーロ（スペイン）	千ユーロ 20,186	千ユーロ 18,284	2,988,615	18.8	-	9.1	9.0	0.6
ユーロ（その他）	千ユーロ 3,500	千ユーロ 3,532	577,458	3.6	-	3.6	-	-
ユーロ（小計）	26,136	24,292	3,970,553	24.9	-	15.3	9.0	0.6
合 計	-	-	15,230,002	95.6	-	65.7	20.2	9.7

(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		期 末		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond United States Treasury Note/Bond United States Treasury Note/Bond United States Treasury Note/Bond UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 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 621	千円 92,924	2046/08/15	
		国債証券	2.2500	2,100	2,005	299,579	2027/08/15	
		国債証券	1.1250	7,686	4,869	727,546	2040/08/15	
		国債証券	0.8750	16,600	13,881	2,074,023	2030/11/15	
		国債証券	2.2500	2,600	1,708	255,315	2052/02/15	
		国債証券	3.3750	3,400	3,237	483,661	2033/05/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		33,286	26,323	3,933,050		
カナダ	CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADIAN GOVERNMENT BOND CANADA HOUSING TRUST CANADA HOUSING TRUST CANADA HOUSING TRUST	国債証券	3.5000	千カナダ・ドル 1,500	千カナダ・ドル 1,533	167,116	2045/12/01	
		国債証券	2.7500	2,200	1,977	215,492	2048/12/01	
		国債証券	0.5000	3,754	3,209	349,774	2030/12/01	
		国債証券	2.0000	1,000	919	100,246	2032/06/01	
		特殊債券	2.2500	1,000	986	107,466	2025/12/15	
		特殊債券	3.5500	3,000	3,002	327,227	2032/09/15	
		特殊債券	3.6500	2,400	2,415	263,246	2033/06/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		14,854	14,045	1,530,569		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND SWEDISH EXPORT CREDIT INTL. FIN. CORP.	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 9,253	929,099	2033/04/21	
		国債証券	1.7500	6,000	3,312	332,548	2051/06/21	
		特殊債券	4.3000	800	796	79,966	2028/05/30	
		特殊債券	1.2500	5,600	4,606	462,464	2031/02/06	

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 2,337	千円 234,710	2026/12/16
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	5銘柄		23,900	20,306	2,038,790	
イギリス	United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt	国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券 国 債 証 券	1.5000 1.6250 0.6250 0.2500 1.2500 4.2500	千イギリス・ポンド 2,520 3,200 1,400 3,095 1,800 1,000	千イギリス・ポンド 2,413 2,935 560 2,415 864 940	471,322 573,336 109,392 471,773 168,853 183,636	2026/07/22 2028/10/22 2050/10/22 2031/07/31 2051/07/31 2046/12/07
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	6銘柄		13,015	10,129	1,978,315	
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 6,947 20,101	152,219 440,422	2039/11/15 2025/11/15
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	2銘柄		25,700	27,048	592,641	
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 16,812	232,848	2025/03/13
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		17,000	16,812	232,848	
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 8,080	116,033	2026/11/12
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		8,230	8,080	116,033	
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 28,738 16,348	185,310 105,416	2026/06/26 2029/03/29
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	2銘柄		45,000	45,087	290,727	
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 98 4,390 485 9,295	3,800 3,734 166,972 18,478 353,488	2024/10/25 2025/04/25 2030/10/25 2027/05/25 2028/04/25
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	5銘柄		16,200	14,370	546,473	
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 2,069	338,313	2045/06/22
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		1,950	2,069	338,313	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	千ユーロ 500	千ユーロ 404	66,166	2032/05/25
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		500	404	66,166	
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 595 6,669 8,814 1,892 312	97,334 1,090,161 1,440,656 309,331 51,132	2026/04/30 2046/10/31 2028/04/30 2040/10/31 2052/10/31
国小計	銘 柄 数 額 金 額	5銘柄		20,186	18,284	2,988,615	
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 3,532	577,458	2030/07/30
国小計	銘 柄 数 額 金 額	1銘柄		3,500	3,532	577,458	
通貨小計	銘 柄 数 額 金 額	8銘柄		26,136	24,292	3,970,553	
合 計	銘 柄 数 額 金 額	43銘柄				15,230,002	

(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10月10日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
	千円	%	
公社債	15,230,002	95.5	
コール・ローン等、その他	720,389	4.5	
投資信託財産総額	15,950,392	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、10月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.41円、1カナダ・ドル=108.97円、1オーストラリア・ドル=100.40円、1イギリス・ポンド=195.31円、1デンマーク・クローネ=21.91円、1ノルウェー・クローネ=13.85円、1スウェーデン・クローネ=14.36円、1チェコ・コルナ=6.448円、1ポーランド・ズロチ=38.027円、1ユーロ=163.45円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(15,877,189千円)の投資信託財産総額(15,950,392千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年10月10日現在

項目	当	期	末
(A) 資産	15,950,392,255円		
コール・ローン等	388,618,485		
公社債(評価額)	15,230,002,262		
未収利息	138,070,503		
前払費用	12,739,396		
差入委託証拠金	180,961,609		
(B) 負債	20,454,453		
未払解約金	20,454,453		
(C) 純資産総額(A-B)	15,929,937,802		
元本	7,387,893,489		
次期繰越損益金	8,542,044,313		
(D) 受益権総口数	7,387,893,489口		
1万口当り基準価額(C/D)	21,562円		

* 期首における元本額は7,734,003,208円、当作成期間中における追加設定元本額は183,852,381円、同解約元本額は529,962,100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)	972,875,884円
ダイワ外債ソブリン・オープン (毎月分配型)	443,043,121円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	142,086,324円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	192,589,564円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	317,088,735円
6資産バランスファンド (分配型)	615,542,527円
6資産バランスファンド (成長型)	99,046,103円
ダイワ海外ソブリン・ファンド (毎月分配型)	2,772,527,901円
ダイワ外債ソブリン・ファンド (毎月分配型)	112,010,531円
兵庫応援バランスファンド (毎月分配型)	714,565,917円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	549,864,272円
ダイワ海外ソブリン・ファンド (1年決算型)	11,331,912円
四国アライアンス 地域創生ファンド (年1回決算型)	373,683,163円
四国アライアンス 地域創生ファンド (年2回決算型)	71,637,535円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,562円です。

■損益の状況

当期 自2024年4月11日 至2024年10月10日

項目	当	期
(A) 配当等収益	180,417,392円	
受取利息	176,850,515	
その他収益金	3,566,877	
(B) 有価証券売買損益	169,782,261	
売買益	366,895,732	
売買損	△ 197,113,471	
(C) 先物取引等損益	1,393	
取引益	1,393	
(D) その他費用	△ 1,695,575	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	348,505,471	
(F) 前期繰越損益金	8,595,629,661	
(G) 解約差損益金	△ 614,547,232	
(H) 追加信託差損益金	212,456,413	
(I) 合計(E+F+G+H)	8,542,044,313	
次期繰越損益金(I)	8,542,044,313	

(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。