

日本健康社会 応援ファンド (愛称：ワクワク・イキイキ)

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2021年6月21日)

(作成対象期間 2020年6月23日～2021年6月21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、わが国の株式の中から、「健康社会」の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、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	約10年2カ月間 (2018年4月16日～2028年6月20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	日本健康社会応援マザーファンドの受益証券	
	日本健康社会応援マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。)	
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		
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、信託財産の成長に資することを目的に、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。		

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株式組入 比 率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2018年 6 月20日)	10,195	10	2.1	1,752.75	1.4	93.9	—	15
2 期末 (2019年 6 月20日)	8,672	0	△ 14.9	1,559.90	△ 11.0	95.0	—	245
3 期末 (2020年 6 月22日)	9,387	0	8.2	1,579.09	1.2	96.0	—	179
4 期末 (2021年 6 月21日)	10,623	10	13.3	1,899.45	20.3	97.9	—	157

(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。

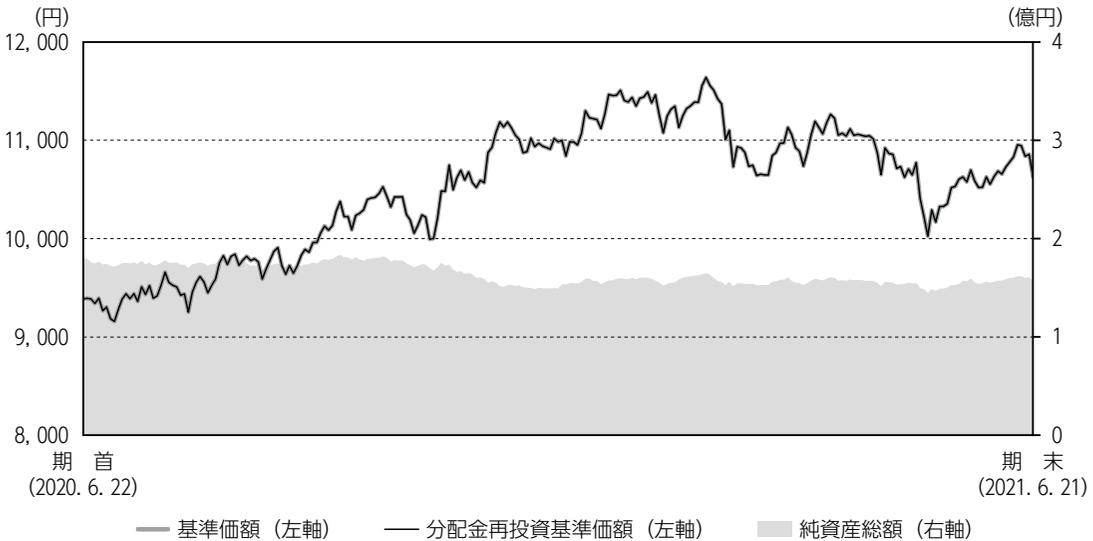
(注 3) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



- * 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

基準価額・騰落率

期首：9,387円

期末：10,623円（分配金10円）

騰落率：13.3%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「日本健康社会応援マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、国内株式市況の上昇を反映し、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。

日本健康社会応援ファンド

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期 首) 2020年 6月22日	円	%		%	%	%
	9,387	—	1,579.09	—	96.0	—
6月末	9,304	△ 0.9	1,558.77	△ 1.3	97.4	—
7月末	9,252	△ 1.4	1,496.06	△ 5.3	97.2	—
8月末	9,694	3.3	1,618.18	2.5	99.4	—
9月末	10,224	8.9	1,625.49	2.9	98.8	—
10月末	9,993	6.5	1,579.33	0.0	97.7	—
11月末	11,136	18.6	1,754.92	11.1	99.1	—
12月末	11,230	19.6	1,804.68	14.3	97.8	—
2021年 1月末	11,076	18.0	1,808.78	14.5	99.2	—
2月末	10,731	14.3	1,864.49	18.1	98.2	—
3月末	11,065	17.9	1,954.00	23.7	97.4	—
4月末	10,624	13.2	1,898.24	20.2	97.8	—
5月末	10,590	12.8	1,922.98	21.8	99.3	—
(期 末) 2021年 6月21日	10,633	13.3	1,899.45	20.3	97.9	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2020. 6. 23 ~ 2021. 6. 21)

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことなどを背景に、株価は上昇しました。2021年1月には、米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現が現実味を帯び、3月に米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。しかし4月に入ると、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落しました。5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、当作成期末にかけて株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「日本健康社会応援マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

日本健康社会応援マザーファンド

当ファンドは、「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、信託財産の成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、「国民の健康維持・増進に貢献している企業」、「従業員の活力向上や効率的な労働環境の整備に取り組んでいる企業」、「社会システム全般の自動化・効率化により生産性の向上を推進している企業」、「快適な社会インフラや娯楽サービスの提供等を行っている企業」の4つのテーマに着目し、投資候補銘柄を選定します。

投資候補銘柄の中から徹底したボトムアップ・アプローチを重視した個別企業の分析および投資環境の分析を行い、業績拡大が期待できる企業を決定し、流動性や株価水準等を考慮して投資していきます。

ポートフォリオについて

(2020. 6. 23 ~ 2021. 6. 21)

■当ファンド

「日本健康社会応援マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

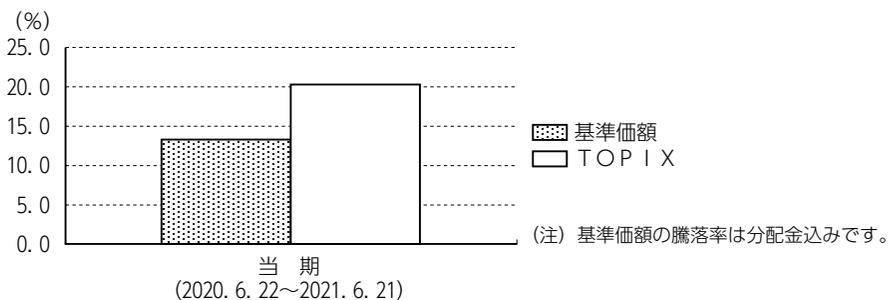
■日本健康社会応援マザーファンド

「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、サービス業や電気機器、医薬品などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、テルモ、協和キリン、リクルートホールディングスなどを組入上位としました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当期	
	2020年6月23日 ～2021年6月21日	
当期分配金（税込み）	（円）	10
対基準価額比率	（%）	0.09
当期の収益	（円）	10
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,287

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	109.32円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		607.07
(c) 収益調整金		222.05
(d) 分配準備積立金		359.15
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		1,297.61
(f) 分配金		10.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		1,287.61

(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

「日本健康社会応援マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

日本健康社会応援マザーファンド

当ファンドは、「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、信託財産の成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、「従業員の活力向上や効率的な労働環境の整備に取り組んでいる企業」であることを前提に、「国民の健康維持・増進に貢献している企業」、「社会システム全般の自動化・効率化により生産性の向上を推進している企業」、「快適な社会インフラや娯楽サー

ビスの提供等を行っている企業」のテーマに着目し、投資候補銘柄を選定します。

投資候補銘柄の中から徹底したボトムアップ・アプローチを重視した個別企業の分析および投資環境の分析を行い、業績拡大が期待できる企業を決定し、流動性や株価水準等を考慮して投資していきます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 6. 23~2021. 6. 21)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	165円	1.568%	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10,521円です。
(投 信 会 社)	(81)	(0.768)	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)	(81)	(0.768)	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)	(0.033)	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	29	0.279	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)	(29)	(0.279)	
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	195	1.853	

(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。

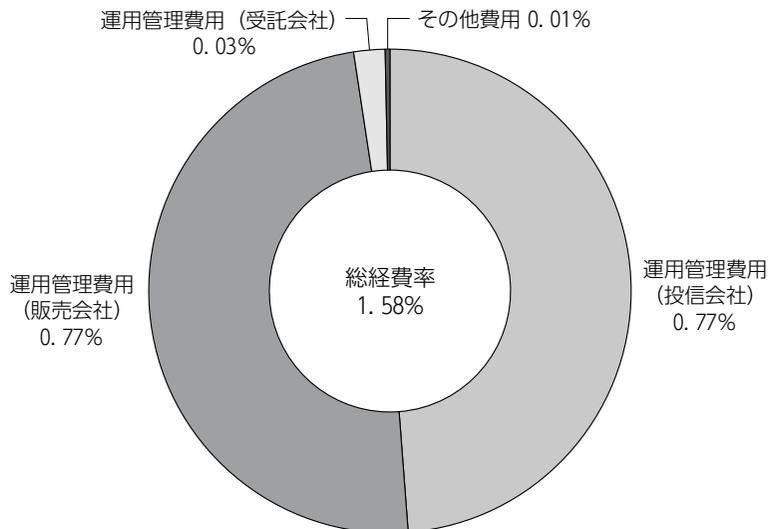
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.58%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

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本健康社会応援 マザーファンド	41,697	53,423	79,587	99,986

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

項 目	当 期
	日本健康社会応援マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	7,132,200千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,641,662千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.95

(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

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B / A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D / C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	3,554	988	27.8	3,577	1,084	30.3
コール・ローン	13,532	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.4%

※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

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	461千円
うち利害関係人への支払額(B)	127千円
(B) / (A)	27.5%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている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。

※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
日本健康社会応援 マザーファンド	160,866	122,975	157,298

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本健康社会応援マザーファンド	157,298	99.1
コール・ローン等、その他	1,403	0.9
投資信託財産総額	158,701	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

日本健康社会応援ファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年6月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	158,701,329円
コール・ローン等	1,403,302
日本健康社会応援マザー ファンド（評価額）	157,298,027
(B) 負債	1,390,825
未払収益分配金	148,079
未払解約金	18,001
未払信託報酬	1,220,559
その他未払費用	4,186
(C) 純資産総額（A－B）	157,310,504
元本	148,079,529
次期繰越損益金	9,230,975
(D) 受益権総口数	148,079,529口
1万口当り基準価額（C／D）	10,623円

* 期首における元本額は191,431,090円、当作成期間中における追加設定元本額は66,638,268円、同解約元本額は109,989,829円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,623円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 110円
受取利息	46
支払利息	△ 156
(B) 有価証券売買損益	13,183,237
売買益	22,509,663
売買損	△ 9,326,426
(C) 信託報酬等	△ 2,574,694
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	10,608,433
(E) 前期繰越損益金	5,318,315
(F) 追加信託差損益金	△ 6,547,694
（配当等相当額）	（ 3,288,243）
（売買損益相当額）	（△ 9,835,937）
(G) 合計（D＋E＋F）	9,379,054
(H) 収益分配金	△ 148,079
次期繰越損益金（G＋H）	9,230,975
追加信託差損益金	△ 6,547,694
（配当等相当額）	（ 3,288,243）
（売買損益相当額）	（△ 9,835,937）
分配準備積立金	15,778,669

（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	1,618,840円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	8,989,593
(c) 収益調整金	3,288,243
(d) 分配準備積立金	5,318,315
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	19,214,991
(f) 分配金	148,079
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	19,066,912
(h) 受益権総口数	148,079,529口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

10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。

日本健康社会応援マザーファンド

運用報告書 第4期 (決算日 2021年6月21日)

(作成対象期間 2020年6月23日～2021年6月21日)

日本健康社会応援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（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

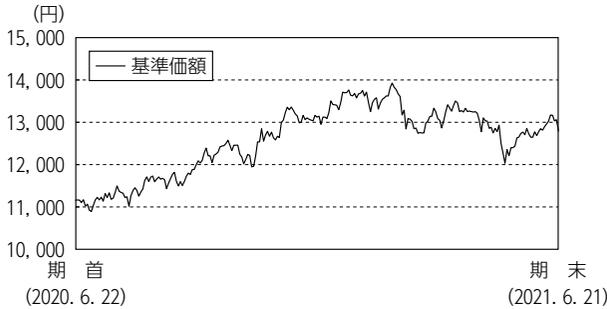
大和アセットマネジメント

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		株式 組入 率	株式 先物 比率
	円	騰落率 %	(参考指数)	騰落率 %		
(期首) 2020年6月22日	11,159	—	1,579.09	—	96.1	—
6月末	11,065	△ 0.8	1,558.77	△ 1.3	97.5	—
7月末	11,018	△ 1.3	1,496.06	△ 5.3	97.3	—
8月末	11,560	3.6	1,618.18	2.5	99.5	—
9月末	12,207	9.4	1,625.49	2.9	98.9	—
10月末	11,947	7.1	1,579.33	0.0	97.8	—
11月末	13,297	19.2	1,754.92	11.1	99.1	—
12月末	13,420	20.3	1,804.68	14.3	97.9	—
2021年1月末	13,251	18.7	1,808.78	14.5	99.0	—
2月末	12,842	15.1	1,864.49	18.1	98.3	—
3月末	13,262	18.8	1,954.00	23.7	97.5	—
4月末	12,749	14.2	1,898.24	20.2	97.9	—
5月末	12,727	14.1	1,922.98	21.8	97.8	—
(期末) 2021年6月21日	12,791	14.6	1,899.45	20.3	97.9	—

(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：11,159円 期末：12,791円 騰落率：14.6%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況の上昇を反映し、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。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバ

イデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことなどを背景に、株価は上昇しました。2021年1月には、米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現が現実味を帯び、3月に米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。しかし4月に入ると、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落しました。5月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、当作成期末にかけて株価は反発しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドは、「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、信託財産の成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、「国民の健康維持・増進に貢献している企業」、「従業員の活力向上や効率的な労働環境の整備に取り組んでいる企業」、「社会システム全般の自動化・効率化により生産性の向上を推進している企業」、「快適な社会インフラや娯楽サービスの提供等を行っている企業」の4つのテーマに着目し、投資候補銘柄を選定します。

投資候補銘柄の中から徹底したボトムアップ・アプローチを重視した個別企業の分析および投資環境の分析を行い、業績拡大が期待できる企業を決定し、流動性や株価水準等を考慮して投資していきます。

◆ポートフォリオについて

「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、サービス業や電気機器、医薬品などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、テルモ、協和キリン、リクルートホールディングスなどを組入上位としました。

◆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》

当ファンドは、「健康社会」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）の維持・発展に寄与し、その恩恵を享受できると考えられる企業に投資し、信託財産の成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、「従業員の活力向上や効率的な労働環境の整備に取り組んでいる企業」であることを前提に、「国民の健康維持・増進に貢献している企業」、「社会システム全般の自動化・効率化により生産性の向上を推進している企業」、「快適な社会インフラや娯楽サービスの提供等を行っている企業」のテーマに着目し、投資候補銘柄を選定します。

投資候補銘柄の中から徹底したボトムアップ・アプローチを重視した個別企業の分析および投資環境の分析を行い、業績拡大が期待できる企業を決定し、流動性や株価水準等を考慮して投資していきます。

日本健康社会応援マザーファンド

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	36円 (36)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	36

(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 株 式

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 722 (76)	千円 3,554,573 (—)	千株 1,228.5	千円 3,577,626

(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。

■主要な売買銘柄 株 式

(2020年6月23日から2021年6月21日まで)

銘 柄	当 期			期 付			
	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
オリエンタルランド	千株 14.3	千円 226,696	円 15,852	ソニーグループ	千株 16.7	千円 164,213	円 9,833
S M C	3.3	203,713	61,731	任天堂	2.5	152,147	60,859
ファナック	8.5	197,755	23,265	東京エレクトロン	3.4	139,365	40,989
リクルートホールディングス	37	166,064	4,488	ファナック	5	136,091	27,218
テルモ	37	161,305	4,359	積水化学	69	135,830	1,968
ソニーグループ	14.8	155,637	10,516	テルモ	30	123,323	4,110
東京エレクトロン	4.8	147,692	30,769	電通国際情報S	21	122,858	5,850
朝日インテック	40	138,992	3,474	総医研ホールディングス	169	122,114	722
任天堂	2.1	131,209	62,480	日本光電工業	34	108,688	3,196
キーエンス	2.7	126,763	46,949	ヤクルト	16.6	104,228	6,278

(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 国内株式

銘 柄	期 首	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
食料品 (一)			
ヤクルト	16.6	—	—
ニチレイ	35	—	—
化学 (7.3%)			
積水化学	69	13	23,257
花王	13.5	16	104,864
タカラバイオ	15.5	—	—
ユニ・チャーム	26	32.5	141,862
医薬品 (14.3%)			
協和キリン	36.5	44	166,320
武田薬品	26	29	106,053
日本新薬	9.7	9.7	87,106

銘 柄	期 首	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一三共	12.5	48	117,120
ペプチドリーム	—	10	53,000
機械 (11.5%)			
ディスコ	4.1	2.4	82,080
ナプテスコ	15	15	63,225
S M C	—	1.7	107,117
ダイキン工業	7	5.1	104,575
ダイフク	13.5	7.3	70,299
電気機器 (14.5%)			
ソニーグループ	15.7	13.8	145,452
日本光電工業	30	—	—
キーエンス	—	1.9	104,709

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シスメックス	—	7	81,585
ファナック	—	3.5	90,527
村田製作所	16.6	6	49,890
東京エレクトロン	—	1.4	66,598
精密機器 (12.0%)			
テルモ	33	40	174,840
オリンパス	—	44	99,440
H O Y A	11.3	6.5	93,665
朝日インテック	—	31.1	78,465
その他製品 (5.1%)			
バンダイナムコH L D G S	—	8.8	66,580
任天堂	2.3	1.9	122,987
情報・通信業 (10.4%)			
テクマトリックス	28	30	52,500
GMOペイメントゲートウェイ	—	4.9	68,355
N T Tデータインフラマート	20	—	—
イトレッド	14	—	—
野村総合研究所	—	24	85,080
Zホールディングス	—	50	26,230
電通国際情報S	21	—	—
日本ユニシス	32	17	53,805
日本電信電話	40.5	—	—
N T Tデータ	—	59	99,415
卸売業 (3.4%)			
シップヘルスケアHD	—	28	71,708
アズワン	—	4	53,960
小売業 (1.7%)			
MonotaRO	—	25.5	64,209
銀行業 (—)			
三菱UFJフィナンシャルG	150	—	—
保険業 (—)			
アイペット損害保険	15	—	—
サービス業 (19.7%)			
リンクアンドモチベーション	70	—	—
エス・エム・エス	—	22	68,970
総医研ホールディングス	169	—	—
ベネフィット・ワン	24	20	68,900
エムスリー	11.5	9.5	69,388
オリエンタルランド	—	10	159,900
エフアンドエム	58.5	20.3	27,161
パリュウHR	35	—	—
リクルートホールディングス	—	30	161,700
ベルシステム24H L D G S	75	30	51,120
アドバンテッジリスクマネ	60	—	—
リログループ	30	48	124,272
合計	株数、金額	株数	金額
	1,262.3	831.8	3,708,292
	銘柄数 < 比率 >	37銘柄	42銘柄 < 97.9% >

(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

2021年6月21日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 3,708,292	% 97.9
コール・ローン等、その他	79,785	2.1
投資信託財産総額	3,788,077	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年6月21日現在

項目	当期末
(A) 資産	3,788,077,014円
コール・ローン等	63,691,234
株式(評価額)	3,708,292,000
未収配当金	16,093,780
(B) 負債	560,000
未払解約金	560,000
(C) 純資産総額 (A - B)	3,787,517,014
元本	2,960,992,720
次期繰越損益金	826,524,294
(D) 受益権総口数	2,960,992,720口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,791円

* 期首における元本額は3,065,709,287円、当作成期間中における追加設定元本額は42,431,479円、同解約元本額は147,148,046円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、日本健康社会応援ファンド122,975,551円、日本健康社会応援ファンド(適格機関投資家専用)2,838,017,169円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,791円です。

■損益の状況

当期 自2020年6月23日 至2021年6月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	47,490,848円
受取配当金	47,508,180
受取利息	822
その他収益金	131
支払利息	△ 18,285
(B) 有価証券売買損益	443,210,090
売買益	718,563,883
売買損	△ 275,353,793
(C) その他費用	△ 291
(D) 当期損益金 (A + B + C)	490,700,647
(E) 前期繰越損益金	355,290,080
(F) 解約差損益金	△ 31,277,954
(G) 追加信託差損益金	11,811,521
(H) 合計 (D + E + F + G)	826,524,294
次期繰越損益金 (H)	826,524,294

(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。