

★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。以下同じ。)
ベビーファンドの運用方法	①マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態 で 高位に維持することを基本とします。 ②株式以外の資産 (他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。) への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。	
マザーファンドの運用方法	①主として、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、国民が長期的に健康的な生活を営める社会 (以下「健康社会」といいます。) 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。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ. 「健康社会」に関連した以下のような企業を投資候補銘柄とします。なお、投資候補銘柄の選定にあたっては、高齢化や労働人口の減少にも着目します。 ⅰ. 国民の健康維持・増進に貢献している企業 ⅱ. 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 ⅲ. 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 ⅳ. 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 ロ. 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ない、投資魅力の高い銘柄を選定します。 ハ. 個別銘柄の流動性、株価水準等を考慮し、ポートフォリオを構築します。 ニ. 投資候補銘柄およびポートフォリオの組入銘柄については、適宜見直しを行ないます。 ③株式の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。	
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 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、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。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド (当ファンド) とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

日本健康社会
応援ファンド

運用報告書 (全体版)
第 1 期
(決算日 2018年 6 月20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。

さて、「日本健康社会応援ファンド」は、このたび、第1期の決算を行ないました。ここに、期中の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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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 0 1 2 0 - 1 0 6 2 1 2
(営業日の 9 : 00 ~ 17 : 00)
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

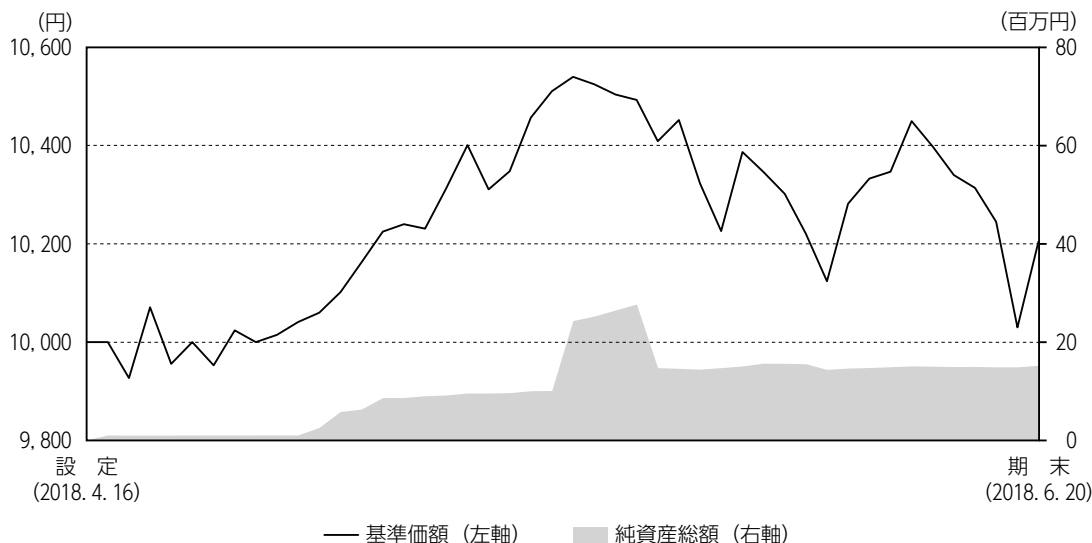
決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株式組入 比 率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2018年 6 月20日)	10, 195	10	2. 1	1, 752. 75	1. 4	93. 9	—	15

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 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 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



(注) 期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,195円 (分配金10円)

騰落率：2.1% (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		
(設 定) 2018年 4 月16日	円	%	(4/13)	%	%	%
	10,000	—	1,729.36	—	—	—
4 月末	10,041	0.4	1,777.23	2.8	94.8	—
5 月末	10,387	3.9	1,747.45	1.0	94.7	—
(期 末) 2018年 6 月20日	10,205	2.1	1,752.75	1.4	93.9	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

投資環境について

(2018. 4. 16 ~ 2018. 6. 20)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、米中貿易摩擦への懸念の後退や米国金利上昇による円安進行を受け上昇したものの、2018年5月後半には、米国が自動車・同部品への関税引き上げを検討する調査を開始したことやイタリアにおける政治不安の高まりが懸念されて、下落しました。しかし、期を通してはTOPIXは若干上昇しました。

ポートフォリオについて

(2018. 4. 16 ~ 2018. 6. 20)

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ないました。

日本健康社会応援マザーファンド

設定当初と期末の比較では、業種構成は小売業の組入比率を引き上げた一方で、医薬品の比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しやバリュエーション指標などを考慮し、ビジョナリーHLDGSや歯愛メディカルなどの組入比率を引き上げました。

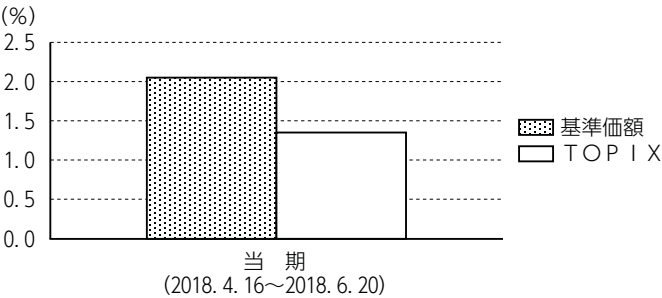
ベンチマークとの差異について

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。

当ファンドは、参考指数としてＴＯＰＩＸを用いています。当期におけるＴＯＰＩＸの騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.1%となりました。

ビジョナリーＨＬＤＧＳやファンケルの株価上昇がプラスに寄与しました。一方、ノーリツ鋼機やリミックスポイントの株価下落がマイナス要因となりました。



分配金について

当期の1万口当り分配金（税込み）は10円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「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
		2018年4月16日 ～2018年6月20日
当期分配金（税込み）	(円)	10
対基準価額比率	(%)	0.10
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	10
翌期繰越分配対象額	(円)	195

- (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	0.00円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	205.34
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	205.34
(f) 分配金	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	195.34

(注) 下線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ないます。

■日本健康社会応援マザーファンド

株価が大幅に上昇し割安感の薄れた銘柄が増えてきました。また、経済統計の一部に成長鈍化の兆しを見せている統計もあり、株式市場については楽観し難い状況だと認識しております。一方で、個別企業をつぶさに見ていけば、自助努力を行なう企業や、独自の成長要因を有する企業は多く存在しております。こうした見通しのもと、株価が上昇するポテンシャルを有している銘柄に適切なタイミングで投資を行なうことで、基準価額の上昇をめざします。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018. 4. 16～2018. 6. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	29円	0. 279%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10, 247円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0. 137)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価
(販 売 会 社)	(14)	(0. 137)	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 銀 行)	(1)	(0. 006)	受託銀行分は、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	25	0. 248	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／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)	(25)	(0. 248)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／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	0	0. 002	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0. 001)	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. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	54	0. 529	

(注 1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

(注 2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注 3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2018年 4月16日から2018年 6月20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	24, 173	29, 162	11, 464	13, 926

(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

(2018年 4月16日から2018年 6月20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	5, 479, 874千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3, 350, 634千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1. 63

(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

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当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期中の利害関係人との取引状況

(2018年 4月16日から2018年 6月20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	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	2, 662	755	28. 4	2, 817	779	27. 7
コール・ローン	2, 437	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0. 2%

※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) 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

(2018年 4月16日から2018年 6月20日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	19千円
うち利害関係人への支払額 (B)	7千円
(B)／(A)	35. 8%

(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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注 1) 金額は元本ベース。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
日本健康社会応援マザーファンド	12, 709	15, 179

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年 6月20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	15, 179	98. 4
コール・ローン等、その他	252	1. 6
投資信託財産総額	15, 432	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

2018年 6 月20日現在		
項 目	当 期 末	
(A)資産	15,432,017円	
コール・ローン等	252,277	
日本健康社会応援マザー ファンド（評価額）	15,179,740	
(B)負債	237,630	
未払収益分配金	14,903	
未払解約金	194,401	
未払信託報酬	28,222	
その他未払費用	104	
(C)純資産総額（A－B）	15,194,387	
元本	14,903,264	
次期繰越損益金	291,123	
(D)受益権総口数	14,903,264口	
1万口当り基準価額（C／D）	10,195円	

* 設定時における元本額は1,000,000円、当中における追加設定元本額は28,152,875円、同解約元本額は14,249,611円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,195円です。

■損益の状況

当期 自2018年 4 月16日 至2018年 6 月20日		
項 目	当 期	
(A)有価証券売買損益	△	193,963円
売買益		131,710
売買損	△	325,673
(B)信託報酬等	△	28,331
(C)当期損益金（A＋B）	△	222,294
(D)追加信託差損益金		528,320
（配当等相当額）	(	5,258)
（売買損益相当額）	(	523,062)
(E)合計（C＋D）		306,026
(F)収益分配金	△	14,903
次期繰越損益金（E＋F）		291,123
追加信託差損益金		513,417
（配当等相当額）	(	5,258)
（売買損益相当額）	(	508,159)
繰越損益金	△	222,294

（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「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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	0円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c)収益調整金	306,026
(d)分配準備積立金	0
(e)当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	306,026
(f)分配金	14,903
(g)翌期繰越分配対象額（e－f）	291,123
(h)受益権総口数	14,903,264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、6月20日現在の基準価額（1万口当り10,195円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・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。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

日本健康社会応援マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2018年6月20日）

（計算期間 2017年7月21日～2018年6月20日）

日本健康社会応援マザーファンドの第1期にかかる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ないます。
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。以下同じ。）
運用方法	①主として、わが国の金融商品取引所上場株式の中から、国民が長期的に健康的な生活を営める社会（以下「健康社会」といいます。）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。 ②ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。 イ．「健康社会」に関連した以下のような企業を投資候補銘柄とします。なお、投資候補銘柄の選定にあたっては、高齢化や労働人口の減少にも着目します。 ⅰ．国民の健康維持・増進に貢献している企業 ⅱ．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 ⅲ．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 ⅳ．快適な社会インフラや娯楽サービスの提供等を行なっている企業 ロ．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ない、投資魅力の高い銘柄を選定します。 ハ．個別銘柄の流動性、株価水準等を考慮し、ポートフォリオを構築します。 ニ．投資候補銘柄およびポートフォリオの組入銘柄については、適宜見直しを行ないます。 ③株式の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。

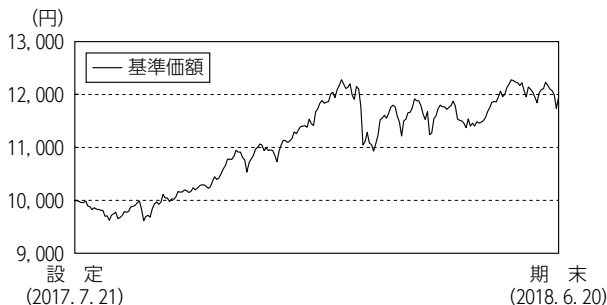
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		TOPIX		株 式 組 入 率	株 式 先 行 比 率
	円	騰落率 (%)	(参考指数) (7/20)	騰落率 (%)	%	%
(設定) 2017年7月21日	10,000	—	1,633.01	—	—	—
7月末	9,881	△ 1.2	1,618.61	△ 0.9	95.9	—
8月末	9,955	△ 0.5	1,617.41	△ 1.0	98.7	—
9月末	10,156	1.6	1,674.75	2.6	96.5	—
10月末	10,658	6.6	1,765.96	8.1	96.8	—
11月末	10,942	9.4	1,792.08	9.7	94.2	—
12月末	11,415	14.2	1,817.56	11.3	95.6	—
2018年1月末	11,911	19.1	1,836.71	12.5	98.0	—
2月末	11,763	17.6	1,768.24	8.3	98.2	—
3月末	11,800	18.0	1,716.30	5.1	94.9	—
4月末	11,508	15.1	1,777.23	8.8	95.0	—
5月末	12,145	21.5	1,747.45	7.0	94.9	—
(期末) 2018年6月20日	11,944	19.4	1,752.75	7.3	94.0	—

(注 1) 騰落率は設定比。

(注 2) 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】

設定時：10,000円 期末：11,944円 騰落率：19.4%

【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、設定時より、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、横ばい圏で推移しました。2017年8月に入ると、北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国の物価統計の弱含みにより米国の2017年内の利上げ観測が後退したこと、対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。9月半ば以降は、米国の2017年内の利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことな

どを受け、株価は上昇しました。その後も、堅調な国内企業業績や、米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。しかし、2018年2月に米国長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月に入ると、米中貿易摩擦への懸念の後退や米国金利上昇による円安進行を受け株価は上昇したものの、5月後半には、米国が自動車・同部品への関税引き上げを検討する調査を開始したことやイタリアにおける政治不安の高まりが懸念され、株価は下落しました。

◆ポートフォリオについて

設定当初と期末の比較では、業種構成は、電気機器や機械などの組入比率を引き下げる一方、小売業や化学などの組入比率を引き上げました。個別銘柄では、業績見通しやバリュエーション指標などを考慮し、テルモや帝人などの組入比率を引き下げました。一方、ビジョナリーHLDGSやタカラバイオなどの組入比率を引き上げました。

◆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、参考指数としてTOPIXを用いています。当期におけるTOPIXの騰落率は7.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は19.4%となりました。

ビジョナリーHLDGSやファンケルの株価上昇がプラスに寄与しました。一方、MIPOXやセブテーニHDの株価下落がマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

株価が大幅に上昇し割安感の薄れた銘柄が増えてきました。また、経済統計の一部に成長鈍化の兆しを見せている統計もあり、株式市場については楽観し難い状況だと認識しております。一方で、個別企業をつぶさに見ていけば、自助努力を行なう企業や、独自の成長要因を有する企業は多く存在しております。こうした見通しのもと、株価が上昇するポテンシャルを有している銘柄に適切なタイミングで投資を行なうことで、基準価額の上昇をめざします。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	71円 (71)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	71

(注 1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注 2) 各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

日本健康社会応援マザーファンド

■売買および取引の状況
株 式

(2017年7月21日から2018年6月20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	6,999.5 (△ 578.1)	11,402,451 (—)	3,745.5	8,591,734

(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

(2017年7月21日から2018年6月20日まで)

当 期				期			
買 付		売 付		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
SUMCO	168	458,023	2,726	SUMCO	160	436,003	2,725
トクヤマ	209.5	249,222	1,189	ペプチドリーム	49	217,556	4,439
ペプチドリーム	57	229,675	4,029	任天堂	4.5	198,945	44,210
ソニー	42.8	222,137	5,190	ソフトバンクグループ	23.3	195,566	8,393
ソフトバンクグループ	23.3	212,626	9,125	ソニー	35.8	185,735	5,188
任天堂	4.5	201,154	44,701	ノーリツ鋼機	73	182,611	2,501
カネカ	165	161,444	978	CYBERDYNE	86	133,348	1,550
ビジョナリーホールディングス	1,471	152,106	103	トクヤマ	41.5	132,381	3,189
SBIホールディングス	54.5	142,938	2,622	ローム	13	129,245	9,941
ノーリツ鋼機	73	142,363	1,950	セイコーエプソン	45	127,653	2,836

(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	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
水産・農林業 (1.1%)		
アークシーズ	8.6	36,808
建設業 (2.2%)		
協和エクシオ	25	74,650
食料品 (3.3%)		
不二製油グループ	24	96,000
ファーマフーズ	25	15,750
化学 (18.1%)		
トクヤマ	40	141,000
カネカ	100	102,500
日油	10.5	36,592
ファンケル	16	89,760

銘 柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
タカラバイオ	52	125,944
ユニ・チャーム	33	111,210
医薬品 (5.8%)		
アステラス製薬	43	75,766
ＪＣＲファーマ	6	41,940
ペプチドリーム	8	39,640
ヘリオス	10	16,080
ミズホメディー	7	19,390
ガラス・土石製品 (0.6%)		
ＭＩＰＯＸ	39	18,603
金属製品 (1.1%)		
SUMCO	8	18,240

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
R S T E C H N O L O G I E S	3.2	18,144
機械 (0.7%)		
技研製作所	9	23,193
電気機器 (3.7%)		
ソニー	7	37,828
TDK	3.1	34,782
シスメックス	1.8	19,134
S C R E E Nホールディングス	3.8	31,806
精密機器 (3.3%)		
ナカニシ	7.8	19,149
HOYA	11.5	72,185
朝日インテック	4.3	17,651
その他製品 (4.7%)		
ビジョン	17	93,500
グローブライド	2.8	11,620
美津濃	13	52,845
情報・通信業 (14.6%)		
アイスタイル	28	32,172
モブキャストHLDGS	99	69,894
リミックスポイント	66	84,744
クラウドワークス	20	34,400
ダブルスタンダード	8.5	28,007
UUUM	7	34,545
ジャストシステム	7.4	16,968
GMOインターネット	39	108,771
SCSK	15	78,600
卸売業 (6.2%)		
歯愛メディカル	8	71,280
日本エム・ディ・エム	49	54,145
スターゼン	13	82,550
小売業 (11.2%)		
スタートトゥデイ	8.3	34,943
業王堂	30	114,450
ビジョナリーHLDGS	1,371	227,586
証券、商品先物取引業 (2.3%)		
SBIホールディングス	26	78,260
保険業 (0.6%)		
アドバンテッジリスクマネ	17	20,179
その他金融業 (2.2%)		
日本取引所グループ	34	72,828
不動産業 (3.1%)		
ケイアイスター不動産	26.9	69,778
日本空港ビルデング	6.4	35,392
サービス業 (15.3%)		
ケアネット	31	35,371
リニカル	29	63,481
ルネサンス	13	31,759
総医研ホールディングス	50	39,050
イオンファンタジー	12	79,560
メドピア	40	70,720
ロゼッタ	20	37,260

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ペイカレントコンサルティング	20	77,900
共立メンテナンス	2	12,280
イチネンホールディングス	13	18,538
セレスポ	1	1,677
ユニマット リタイアメント	26	43,862
合 計	株 数、金 額	千円
	2,675.9	3,352,662
	銘柄数<比率>	61銘柄 <94.0%>

(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

2018年6月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,352,662	90.6
コール・ローン等、その他	346,651	9.4
投資信託財産総額	3,699,313	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

2018年6月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,699,313,873円
コール・ローン等	208,301,223
株式 (評価額)	3,352,662,800
未収入金	123,931,650
未収配当金	14,418,200
(B) 負債	132,732,911
未払金	132,724,174
その他未払費用	8,737
(C) 純資産総額 (A - B)	3,566,580,962
元本	2,986,132,908
次期繰越損益金	580,448,054
(D) 受益権総口数	2,986,132,908口
1万口当り基準価額 (C / D)	11,944円

* 設定時における元本額は2,994,000,000円、当期中における追加設定元本額は24,173,539円、同解約元本額は32,040,631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12,709,093円、日本健康社会応援ファンド (適格機関投資家専用) 2,973,423,815円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,944円です。

■損益の状況

当期 自2017年7月21日 至2018年6月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	38,404,072円
受取配当金	38,485,100
受取利息	377
その他収益金	2,030
支払利息	△ 83,435
(B) 有価証券売買損益	541,946,006
売買益	985,548,974
売買損	△ 443,602,968
(C) その他費用	△ 25,116
(D) 当期損益金 (A + B + C)	580,324,962
(E) 解約差損益金	△ 4,865,869
(F) 追加信託差損益金	4,988,961
(G) 合計 (D + E + F)	580,448,054
次期繰越損益金 (G)	580,448,054

- (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。