

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2期

(決算日 2019年6月20日)
(作成対象期間 2018年6月21日～2019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。

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 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、分配を行なわないことがあります。		

設定以来の運用実績

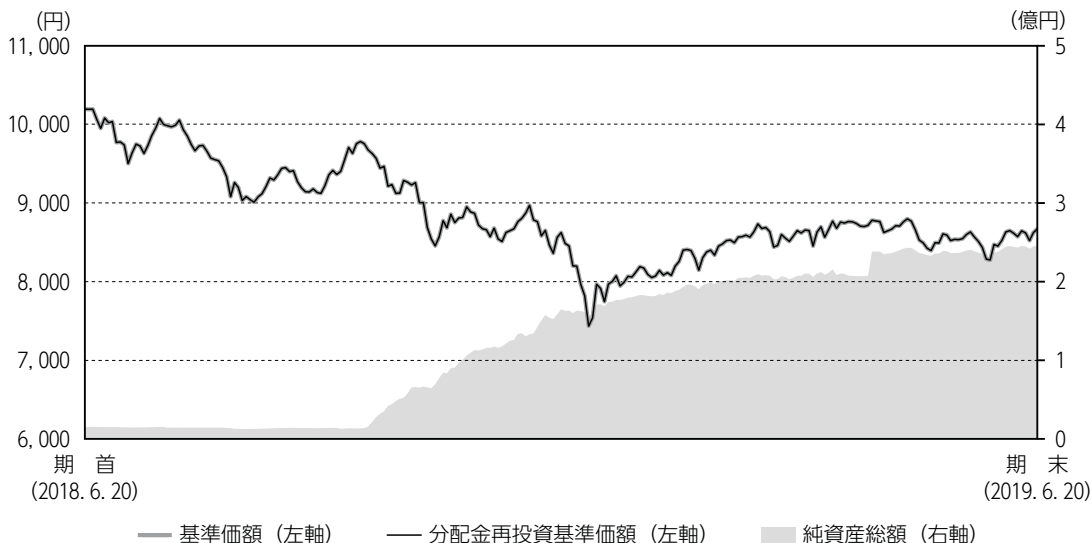
決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株式組入 比 率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2018年 6 月20日)	10, 195	10	2. 1	1, 752. 75	1. 4	93. 9	—	15
2 期末 (2019年 6 月20日)	8, 672	0	△ 14. 9	1, 559. 90	△ 11. 0	95. 0	—	245

(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：10,195円

期末：8,672円（分配金0円）

騰落率：△14.9%（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、国内株式市況の下落を反映し、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。

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		
	円	%		%	%	%
(期 首) 2018年 6 月20日	10, 195	—	1, 752. 75	—	93. 9	—
6 月末	10, 037	△ 1. 5	1, 730. 89	△ 1. 2	94. 8	—
7 月末	9, 666	△ 5. 2	1, 753. 29	0. 0	91. 9	—
8 月末	9, 451	△ 7. 3	1, 735. 35	△ 1. 0	94. 8	—
9 月末	9, 757	△ 4. 3	1, 817. 25	3. 7	92. 9	—
10月末	8, 775	△ 13. 9	1, 646. 12	△ 6. 1	92. 3	—
11月末	8, 872	△ 13. 0	1, 667. 45	△ 4. 9	98. 4	—
12月末	7, 915	△ 22. 4	1, 494. 09	△ 14. 8	96. 1	—
2019年 1 月末	8, 199	△ 19. 6	1, 567. 49	△ 10. 6	95. 0	—
2 月末	8, 568	△ 16. 0	1, 607. 66	△ 8. 3	94. 6	—
3 月末	8, 663	△ 15. 0	1, 591. 64	△ 9. 2	94. 2	—
4 月末	8, 799	△ 13. 7	1, 617. 93	△ 7. 7	94. 7	—
5 月末	8, 437	△ 17. 2	1, 512. 28	△ 13. 7	95. 6	—
(期 末) 2019年 6 月20日	8, 672	△ 14. 9	1, 559. 90	△ 11. 0	95. 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

(2018. 6. 21 ~ 2019. 6. 20)

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国の保護主義的な政策への警戒感が強い一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協点を探る動きなどがあったことから、横ばい圏で推移しました。2018年9月半ばからは、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月には、株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中通商協議に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は一進一退で推移したものの、5月に入ると米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手に対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。

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

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うことで、基準価額の上昇をめざします。

ポートフォリオについて

(2018. 6. 21 ~ 2019. 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いました。

■日本健康社会応援マザーファンド

当作成期首と当作成期末との比較では、業種構成は、小売業や化学などの組入比率を引き下げた一方、機械やサービス業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、ビジョナリーＨＬＤＧＳやトクヤマなどの組入比率を引き下げました。一方、バリューＨＲやＪＡＬＵＸなどの組入比率を引き上げました。

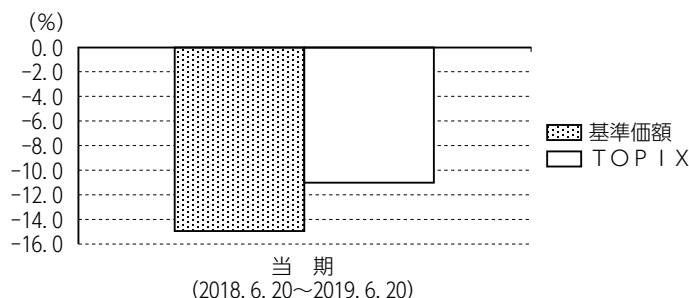
ベンチマークとの差異について

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。当作成期におけるＴＯＰＩＸの騰落率は△11.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.9%となりました。

ＵＵＵＭやバリューＨＲの株価上昇がプラスに寄与しました。一方、ビジョナリーＨＬＤＧＳやＺＯＺＯ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

当作成期は、基準価額の水準等を勘案して、収益分配を見送らせていただきました。
 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6月21日 ～2019年6月20日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	7

(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。



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

米中貿易摩擦の行方や金融政策の動向、為替相場の動向など不確定な要素が多く、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。しかしこのような不透明感の強い環境下においても、自助努力を行う企業や独自の成長要因を有する企業の株価は底堅く推移すると想定しております。「健康社会」というテーマは、今まさに注目度が高まっているテーマであり、このテーマの恩恵を受ける銘柄に投資を行うことで、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. 6. 21～2019. 6. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	137円	1. 544%	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8, 863円です。
(投 信 会 社)	(67)	(0. 756)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(67)	(0. 756)	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)	(3)	(0. 032)	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	9	0. 103	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)	(9)	(0. 103)	
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. 007	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)	(0)	(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. 002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	147	1. 655	

- (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。

■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6月21日から2019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	249,007	252,568	19,291	19,894

(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6月21日から2019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	16,304,763千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,005,525千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	5.42

(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

(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	う ち 利 害 関係人との 取引状況B		売付額等 C	う ち 利 害 関係人との 取引状況D	
		B／A			D／C	
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	8,291	957	11.5	8,013	1,104	13.8
コール・ローン	28,985	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.2%

※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) 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

(2018年6月21日から2019年6月20日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	136千円
うち利害関係人への支払額(B)	60千円
B)／(A)	44.1%

(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。

■信託会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保 有 額	当作成期中 設 定 額	当作成期中 解 約 額	当作成期末 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とその処分

(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	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	12,709	242,425	245,746

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019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	245,746	99.1
コール・ローン等、その他	2,117	0.9
投資信託財産総額	247,864	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

2019年6月20日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	247, 864, 440円
コール・ローン等	2, 117, 650
日本健康社会応援マザー ファンド（評価額）	245, 746, 790
(B) 負債	2, 108, 091
未払解約金	486, 256
未払信託報酬	1, 616, 271
その他未払費用	5, 564
(C) 純資産総額（A－B）	245, 756, 349
元本	283, 375, 544
次期繰越損益金	△ 37, 619, 195
(D) 受益権総口数	283, 375, 544口
1万口当り基準価額（C／D）	8, 672円

*期首における元本額は14, 903, 264円、当作成期間中における追加設定元本額は297, 040, 708円、同解約元本額は28, 568, 428円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は8, 672円です。
*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は37, 619, 195円です。

■損益の状況

当期 自2018年6月21日 至2019年6月20日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 267円
受取利息	7
支払利息	△ 274
(B) 有価証券売買損益	△ 1, 304, 434
売買益	662, 850
売買損	△ 1, 967, 284
(C) 信託報酬等	△ 2, 013, 446
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 3, 318, 147
(E) 前期繰越損益金	△ 145, 975
(F) 追加信託差損益金	△ 34, 155, 073
（配当等相当額）	(209, 340)
（売買損益相当額）	(△ 34, 364, 413)
(G) 合計（D＋E＋F）	△ 37, 619, 195
次期繰越損益金（G）	△ 37, 619, 195
追加信託差損益金	△ 34, 155, 073
（配当等相当額）	(209, 340)
（売買損益相当額）	(△ 34, 364, 413)
繰越損益金	△ 3, 464, 122

（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	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	209, 340
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	209, 340
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	209, 340
(h) 受益権総口数	283, 375, 544口

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2期 (決算日 2019年6月20日)

(作成対象期間 2018年6月21日～2019年6月20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。）
株式組入制限	無制限

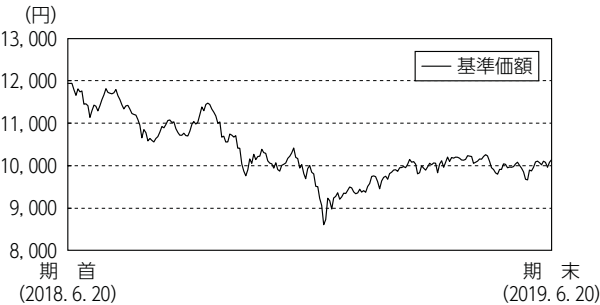
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<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		T O P I X		株 式	株 式
	円	騰落率 (参考指数)	騰落率	組 入 率	先 物 率	比 率
(期首) 2018年6月20日	11,944	—	1,752.75	—	94.0	—
6月末	11,763	△ 1.5	1,730.89	△ 1.2	95.0	—
7月末	11,340	△ 5.1	1,753.29	0.0	92.1	—
8月末	11,079	△ 7.2	1,735.35	△ 1.0	95.0	—
9月末	11,445	△ 4.2	1,817.25	3.7	93.1	—
10月末	10,158	△ 15.0	1,646.12	△ 6.1	92.5	—
11月末	10,298	△ 13.8	1,667.45	△ 4.9	95.0	—
12月末	9,169	△ 23.2	1,494.09	△ 14.8	96.3	—
2019年1月末	9,508	△ 20.4	1,567.49	△ 10.6	95.2	—
2月末	9,952	△ 16.7	1,607.66	△ 8.3	94.8	—
3月末	10,075	△ 15.6	1,591.64	△ 9.2	94.4	—
4月末	10,259	△ 14.1	1,617.93	△ 7.7	94.8	—
5月末	9,852	△ 17.5	1,512.28	△ 13.7	95.8	—
(期末) 2019年6月20日	10,137	△ 15.1	1,559.90	△ 11.0	95.0	—

(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：11,944円 期末：10,137円 騰落率：△15.1%
【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況の下落を反映し、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。

◆投資環境について

○国内株式市況
国内株式市況は下落しました。
国内株式市況は、当作成期首より、米国の保護主義的な政策への警戒感が強い一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協点を探る動きなどがあったこと

とから、横ばい圏で推移しました。2018年9月半ばからは、米中通商協議に関わっていったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことと為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月には、株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中通商協議に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は一進一退で推移したものの、5月に入ると米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手に対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。

◆前作成期末における「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うことで、基準価額の上昇をめざします。

◆ポートフォリオについて

当作成期首と当作成期末との比較では、業種構成は、小売業や化学などの組入比率を引き下げた一方、機械やサービス業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、ビジョナリーH L D G Sやトクヤマなどの組入比率を引き下げました。一方、パリュールH RやJ A L U X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T O P I Xを用いています。当作成期におけるT O P I Xの騰落率は△11.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△15.1%となりました。
U U U MやパリュールH Rの株価上昇がプラスに寄与しました。一方、ビジョナリーH L D G SやZ O Z O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》

米中貿易摩擦の行方や金融政策の動向、為替相場の動向など不確定な要素が多く、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。しかしこのような不透明感の強い環境下においても、自助努力を行う企業や独自の成長要因を有する企業の株価は底堅く推移すると想定しております。「健康社会」というテーマは、今まさに注目度が高まっているテーマであり、このテーマの恩恵を受ける銘柄に投資を行うことで、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)	28円 (28)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	28

(注 1) 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) 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

(2018 年 6 月 21 日から 2019 年 6 月 20 日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株	千円	千株	千円
	3,986.1 (△ 31.7)	8,291,094 (—)	4,975.5	8,013,669

(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

(2018 年 6 月 21 日から 2019 年 6 月 20 日まで)

当 期				期 末			
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
Z O Z O	39.6	165,003	4,166	トクヤマ	70.6	230,843	3,269
ソニー	22.2	127,586	5,747	リミックスポイント	154	168,657	1,095
ヤクルト	16.3	122,366	7,507	Z O Z O	47.9	163,431	3,411
太陽誘電	39.8	120,899	3,037	カネカ	113	155,564	1,376
ソフトバンクグループ	11.5	116,302	10,113	ファンケル	26.8	143,826	5,366
N T T ドコモ	37	104,195	2,816	ビジョナリー H L D G S	1,401	140,306	100
トクヤマ	30.6	103,233	3,373	GMO インターネット	52	122,219	2,350
リミックスポイント	88	102,156	1,160	U U U M	25	110,548	4,421
カネカ	23	100,229	4,357	ソニー	18.2	109,033	5,990
ヤフー	236	98,532	417	ソフトバンクグループ	11.5	107,892	9,381

(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	株 数	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (一)			
アクシース	8.6	—	—
建設業 (3.6%)			
五洋建設	—	90	46,620
協和エクシオ	25	24	64,176
食料品 (4.2%)			
ヤクルト	—	9	58,320
不二製油グループ	24	—	—
やまみ	—	13	28,535
ニチレイ	—	16	42,448
ファーマフーズ	25	—	—

銘 柄	株 数	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (12.0%)			
トクヤマ	40	—	—
エア・ウォーター	—	22	40,370
カネカ	100	10	39,550
積水化学	—	25	40,050
タキロンシーアイ	—	58	38,454
日油	10.5	11	44,330
花王	—	6	51,252
富士フイルム H L D G S	—	9	48,879
ファンケル	16	—	—
タカラバイオ	52	16	33,040

日本健康社会応援マザーファンド

銘柄	株数	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	33	9	30,672
医薬品 (7.8%)			
協和発酵キリン	—	22	44,682
武田薬品	—	12	45,876
アステラス製薬	43	—	—
あすか製薬	—	45	55,980
日本新薬	—	6	47,700
JCRファーマ	6	—	—
第一三共	—	7	42,273
ペプチドリーム	8	—	—
ヘリオス	10	—	—
ミズホメディール	7	—	—
石油・石炭製品 (1.0%)			
JXTGホールディングス	—	60	31,158
ガラス・土石製品 (—)			
MIPOX	39	—	—
金属製品 (—)			
SUMCO	8	—	—
RS TECHNOLOGIES	3.2	—	—
機械 (9.3%)			
ディスコ	—	2.1	35,028
ナプテスコ	—	11	32,736
サトーホールディングス	—	15	40,875
技研製作所	9	—	—
三精テクノロジーズ	—	35	39,690
ダイキン工業	—	2.8	39,340
オルガノ	—	10	35,200
ダイフク	—	10	59,300
電気機器 (5.4%)			
ソニー	7	11	63,558
TDK	3.1	—	—
日本光電工業	—	11	33,550
シスメックス	1.8	—	—
ファナック	—	1.7	33,762
村田製作所	—	7	33,523
SCREENホールディングス	3.8	—	—
輸送用機器 (1.6%)			
デンソー	—	11	49,203
精密機器 (3.7%)			
テルモ	—	15	49,035
クリエートメディック	—	34	31,620
ナカニシ	7.8	—	—
HOYA	11.5	—	—
朝日インテック	4.3	—	—
ニプロ	—	26	31,434
その他製品 (1.2%)			
ビジョン	17	8	36,840
グローブライド	2.8	—	—
美津濃	13	—	—
陸運業 (1.1%)			
東京急行	—	17.9	34,582

銘柄	株数	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
海運業 (1.1%)			
商船三井	—	13.5	33,169
空運業 (1.2%)			
ANAホールディングス	—	10	35,870
情報・通信業 (9.3%)			
アイスタイル	28	—	—
モブキャストHLDGS	99	—	—
テクマトリックス	—	29	60,871
リミックスポイント	66	—	—
クラウドワークス	20	—	—
メディカル・データ・ビジ	—	22	26,752
ダブルスタンダード	8.5	—	—
エイトレッド	—	18	33,624
UUUM	7	—	—
カオナビ	—	2	14,940
ジャストシステム	7.4	—	—
伊藤忠テクノソリューション	—	12	34,548
電通国際情報S	—	9	31,365
GMOインターネット	39	—	—
SCSK	15	6	32,640
ミロク情報サービス	—	14	48,580
卸売業 (5.6%)			
JALUX	—	23	64,400
神戸物産	—	7	36,960
歯愛メディカル	8	—	—
日本エム・ディ・エム	49	28	41,272
スターゼン	13	—	—
三菱商事	—	10	28,870
小売業 (3.6%)			
ZOZO	8.3	—	—
薬王堂	30	24	56,592
ビジョナリーHLDGS	1,371	—	—
元氣寿司	—	15	51,750
銀行業 (1.7%)			
三井住友フィナンシャルG	—	14	52,850
証券・商品先物取引業 (—)			
SBIホールディングス	26	—	—
保険業 (2.6%)			
アイベット損害保険	—	11.3	41,923
東京海上HD	—	7	38,507
その他金融業 (—)			
日本取引所グループ	34	—	—
不動産業 (3.4%)			
日本駐車場開発	—	190	32,870
東急不動産HD	—	61	38,552
ケイアイスター不動産	26.9	—	—
三菱地所	—	16	33,728
日本空港ビルデング	6.4	—	—
サービス業 (20.5%)			
ケアネット	31	—	—
コシダカホールディングス	—	22.9	32,197

銘柄	株数	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リンクアンドモチベーション	—	62	36,890
リニカル	29	—	—
夢真ホールディングス	—	45	35,325
ルネサンス	13	19	34,048
総医研ホールディングス	50	30	21,120
ベネフィット・ワン	—	8	15,520
エムスリー	—	20.6	42,106
イオンファンタジー	12	—	—
エイジス	—	6	19,050
ラウンドワン	—	20	28,240
チャームケアコーポレーション	—	28	47,656
パリュウHR	—	23	78,430
シグマクシス	—	40	49,920
メドピア	40	—	—
リクルートホールディングス	—	15	53,475
ロゼッタ	20	—	—
ベルシステム24H L D G S	—	39	58,968
ベイカレントコンサルティング	20	—	—
グリーンズ	—	23	34,730
アドバンテッジリスクマネ	17	—	—
リログループ	—	13	38,181
共立メンテナンス	2	—	—
イチネンホールディングス	13	—	—
セレスポ	1	—	—
ユニマットリタイアメント	26	—	—
合 計	株数、金額	2,675.9	1,654.8
	銘柄数 < 比率 >	61銘柄	75銘柄 < 95.0% >

(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

2019年6月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,050,132	90.1
コール・ローン等、その他	333,801	9.9
投資信託財産総額	3,383,933	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

2019年6月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,383,933,255円
コール・ローン等	105,011,226
株式(評価額)	3,050,132,100
未収入金	210,457,165
未収配当金	18,332,764
(B) 負債	174,305,019
未払金	174,305,019
(C) 純資産総額(A - B)	3,209,628,236
元本	3,166,397,822
次期繰越損益金	43,230,414
(D) 受益権総口数	3,166,397,822口
1万口当り基準価額(C / D)	10,137円

* 期首における元本額は2,986,132,908円、当作成期間中における追加設定元本額は249,414,365円、同解約元本額は69,149,451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242,425,560円、日本健康社会応援ファンド(適格機関投資家専用)2,923,972,262円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,137円です。

■損益の状況

当期 自2018年6月21日 至2019年6月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	46,345,150円
受取配当金	46,433,912
受取利息	644
その他収益金	4,826
支払利息	△ 94,232
(B) 有価証券売買損益	△ 579,955,925
売買益	446,867,651
売買損	△ 1,026,823,576
(C) その他費用	△ 66,251
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 533,677,026
(E) 前期繰越損益金	580,448,054
(F) 解約差損益金	△ 7,045,149
(G) 追加信託差損益金	3,504,535
(H) 合計(D + E + F + G)	43,230,414
次期繰越損益金(H)	43,230,414

(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。