

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3期

(決算日 2020年6月22日)
(作成対象期間 2019年6月21日～2020年6月22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

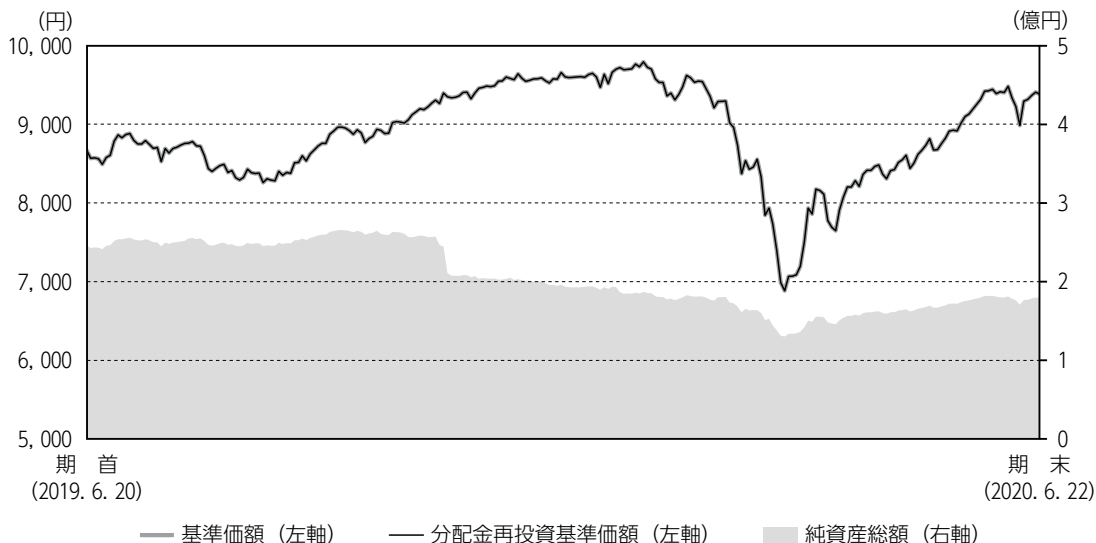
決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株式組入 比 率	株 式 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2018年 6 月20日)	10, 195	10	2. 1	1, 752. 75	1. 4	93. 9	—	15
2 期末 (2019年 6 月20日)	8, 672	0	△ 14. 9	1, 559. 90	△ 11. 0	95. 0	—	245
3 期末 (2020年 6 月22日)	9, 387	0	8. 2	1, 579. 09	1. 2	96. 0	—	179

(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：8,672円

期 末：9,387円（分配金 0 円）

騰落率：8.2%（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		
	円	%		%	%	%
(期 首) 2019年 6 月20日	8,672	—	1,559.90	—	95.0	—
6 月末	8,607	△ 0.7	1,551.14	△ 0.6	94.7	—
7 月末	8,728	0.6	1,565.14	0.3	94.7	—
8 月末	8,403	△ 3.1	1,511.86	△ 3.1	94.1	—
9 月末	8,875	2.3	1,587.80	1.8	95.1	—
10月末	9,309	7.3	1,667.01	6.9	95.1	—
11月末	9,568	10.3	1,699.36	8.9	95.5	—
12月末	9,605	10.8	1,721.36	10.4	95.1	—
2020年 1 月末	9,398	8.4	1,684.44	8.0	94.7	—
2 月末	8,373	△ 3.4	1,510.87	△ 3.1	94.2	—
3 月末	8,113	△ 6.4	1,403.04	△ 10.1	96.1	—
4 月末	8,607	△ 0.7	1,464.03	△ 6.1	96.4	—
5 月末	9,256	6.7	1,563.67	0.2	97.4	—
(期 末) 2020年 6 月22日	9,387	8.2	1,579.09	1.2	96.0	—

(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

(2019. 6. 21 ~ 2020. 6. 22)

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、米国がメキシコに対する追加関税を棚上げしたことや米国の利下げ期待、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したのに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や米国による大型の経済対策に加え、欧米における新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきたことで経済活動の再開期待が高まったこと、5月下旬に国内の緊急事態宣言が全面解除されたことが好感され、株価は上昇しました。

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

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」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）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。

ポートフォリオについて

(2019. 6. 21 ~ 2020. 6. 22)

■当ファンド

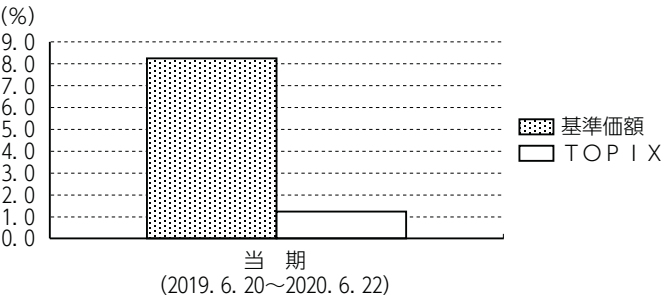
「日本健康社会応援マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

■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、サービス業や情報・通信業、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、ダイフク、ソニー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（1万口当たり）

項 目		当期
		2019年6月21日 ～2020年6月22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)	576

(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

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。

1 万口当りの費用の明細

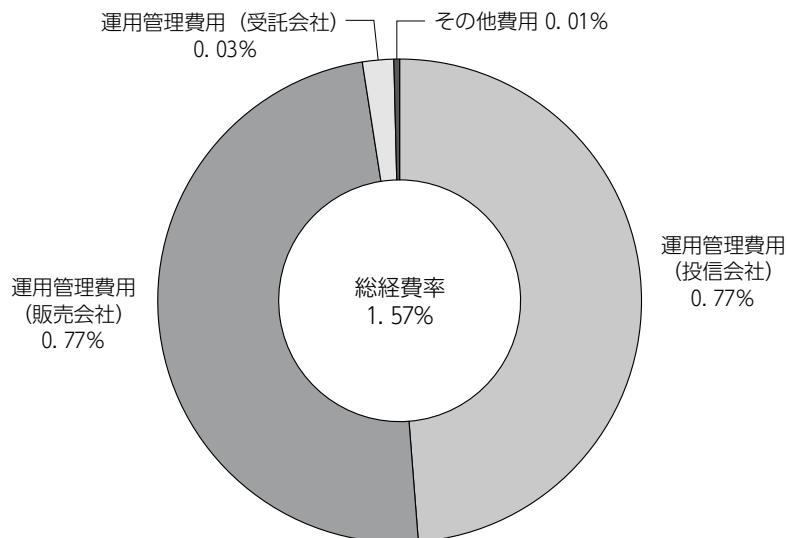
項 目	当 期 (2019. 6. 21～2020. 6. 22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	140円	1. 573%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は8, 893円です。
(投 信 会 社)	(69)	(0. 770)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(69)	(0. 770)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 033)	受託会社分は、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	12	0. 130	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)	(12)	(0. 130)	
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	0	0. 006	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. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	152	1. 709	

- (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1.57%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。

日本健康社会応援ファンド

■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

(2019年6月21日から2020年6月22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	30,792	31,641	112,351	122,411

(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

(2019年6月21日から2020年6月22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	5,950,125千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,110,597千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.91

(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

(2019年6月21日から2020年6月22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	2,963	227	7.7	2,986	404	13.5
コール・ローン	32,098	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合6.4%

※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

(2019年6月21日から2020年6月22日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	271千円
うち利害関係人への支払額(B)	49千円
(B)／(A)	18.3%

(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	242,425	160,866	179,510

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月22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	179,510	99.1
コール・ローン等、その他	1,553	0.9
投資信託財産総額	181,063	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

2020年 6 月22日現在		
項 目	当 期 末	
(A)資産	181,063,976円	
コール・ローン等	1,525,331	
日本健康社会応援マザー ファンド（評価額）	179,510,645	
未収入金	28,000	
(B)負債	1,361,532	
未払信託報酬	1,356,864	
その他未払費用	4,668	
(C)純資産総額（A－B）	179,702,444	
元本	191,431,090	
次期繰越損益金	△ 11,728,646	
(D)受益権総口数	191,431,090口	
1万口当り基準価額（C／D）	9,387円	

*期首における元本額は283,375,544円、当作成期間中における追加設定元本額は53,095,046円、同解約元本額は145,039,500円です。
 *当期末の計算口数当りの純資産額は9,387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11,728,646円です。

■損益の状況

当期 自2019年 6 月21日 至2020年 6 月22日

項 目	当 期	
(A)配当等収益	△ 349円	
受取利息	125	
支払利息	△ 474	
(B)有価証券売買損益	15,900,387	
売買益	24,570,033	
売買損	△ 8,669,646	
(C)信託報酬等	△ 3,245,434	
(D)当期損益金（A＋B＋C）	12,654,604	
(E)前期繰越損益金	△ 1,835,418	
(F)追加信託差損益金	△ 22,547,832	
（配当等相当額）	(220,922)	
（売買損益相当額）	(△ 22,768,754)	
(G)合計（D＋E＋F）	△ 11,728,646	
次期繰越損益金（G）	△ 11,728,646	
追加信託差損益金	△ 22,547,832	
（配当等相当額）	(220,922)	
（売買損益相当額）	(△ 22,768,754)	
分配準備積立金	10,819,186	

（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	2,562,606円
(b)経費控除後の有価証券売買等損益	8,256,580
(c)収益調整金	220,922
(d)分配準備積立金	0
(e)当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	11,040,108
(f)分配金	0
(g)翌期繰越分配対象額（e－f）	11,040,108
(h)受益権総口数	191,431,090口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、
 商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

日本健康社会応援マザーファンド

運用報告書 第3期 (決算日 2020年6月22日)

(作成対象期間 2019年6月21日～2020年6月22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。

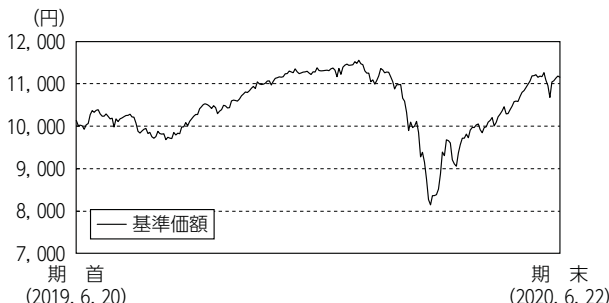
運 用 方 針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

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		T O P I X		株 式 先 物 率	株 式 入 率
	円	騰落率 (%)	(参考指数)	騰落率 (%)		
(期 首) 2019年 6月20日	10,137	—	1,559.90	—	95.0	—
6月末	10,065	△ 0.7	1,551.14	△ 0.6	94.8	—
7月末	10,221	0.8	1,565.14	0.3	94.8	—
8月末	9,852	△ 2.8	1,511.86	△ 3.1	94.2	—
9月末	10,419	2.8	1,587.80	1.8	95.2	—
10月末	10,942	7.9	1,667.01	6.9	94.9	—
11月末	11,265	11.1	1,699.36	8.9	94.5	—
12月末	11,324	11.7	1,721.36	10.4	94.8	—
2020年 1月末	11,095	9.5	1,684.44	8.0	94.8	—
2月末	9,899	△ 2.3	1,510.87	△ 3.1	94.3	—
3月末	9,606	△ 5.2	1,403.04	△ 10.1	96.2	—
4月末	10,205	0.7	1,464.03	△ 6.1	96.5	—
5月末	10,990	8.4	1,563.67	0.2	97.5	—
(期 末) 2020年 6月22日	11,159	10.1	1,579.09	1.2	96.1	—

(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：10,137円 期末：11,159円 騰落率：10.1%

【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、米国がメキシコに対する追加関税を棚上げしたことや米国の利下げ期待、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことが支えとなり、

底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したのに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や米国による大型の経済対策に加え、欧米における新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきたことで経済活動の再開期待が高まったこと、5月下旬に国内の緊急事態宣言が全面解除されたことが好感され、株価は上昇しました。

◆前作成期末における「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」（国民が長期的に健康的な生活を営める社会）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。

◆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、サービス業や情報・通信業、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、ダイフク、ソニー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、「国民の健康維持・増進に貢献している企業」、「従業員の高効率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。

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)	16円 (16)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	16

(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。

■主要な売買銘柄
株 式

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
ＨＯＹＡ	11.3	113,234	10,020	シグマクシス	50	83,105	1,662
日本ユニシス	32	108,841	3,401	元気寿司	27	78,273	2,899
積水化学	69	104,267	1,511	バリューＨＲ	37.5	68,209	1,818
日本電信電話	32.5	100,827	3,102	協和エクシオ	24	62,584	2,607
任天堂	2.3	94,565	41,115	サトーホールディングス	27	61,773	2,287
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	187	93,682	500	チャームケアコーポレーション	28	60,585	2,163
総医研ホールディングス	169	84,916	502	オルガノ	10	60,520	6,052
アドバンテッジリスクマネ	102.8	81,219	790	日本エム・ディ・エム	35.5	59,168	1,666
エフアンドエム	58.5	72,960	1,247	大幸薬品	13	58,575	4,505
村田製作所	11.8	69,750	5,911	バンダイナムコＨＬＤＧＳ	10	56,627	5,662

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は四捨入。

■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
建設業 (一)			
五洋建設	90	—	—
協和エクシオ	24	—	—
食料品 (6.7%)			
ヤクルト	9	16.6	111,220
やまみ	13	—	—
ニチレイ	16	35	109,025
化学 (11.8%)			
エア・ウォーター	22	—	—
カネカ	10	—	—
積水化学	25	69	106,605

■売買および取引の状況
株 式

(2019年 6 月21日から2020年 6 月22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	1,499 (70.7)	2,963,405 (—)	1,962.2	2,986,720

(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) 金額の単位未満は四捨入。

(2019年 6 月21日から2020年 6 月22日まで)

期				
売		付		
銘	柄	株	数	額
				平均単価
			千株	千円
				円
グマクシス			50	83,105
気寿司			27	78,273
リ्यूHR			37.5	68,209
和エクシオ			24	62,584
トーホールディングス			27	61,773
チャームケアコーポレーション			28	60,585
ルガノ			10	60,520
本エム・ディ・エム			35.5	59,168
幸薬品			13	58,575
ンダイナムコHLDGS			10	56,627

銘柄	株数	当期末	
	株数	株数	評価額
第一三共	千株 7	千株 12.5	千円 112,175
石油・石炭製品 (一)			
JXTGホールディングス	60	—	—
機械 (11.9%)			
ディスコ	2.1	4.1	103,730
ナブテスコ	11	15	50,175
サトーホールディングス	15	—	—
三精テクノロジーズ	35	—	—
ダイキン工業	2.8	7	116,375
オルガノ	10	—	—
ダイフク	10	13.5	122,310
電気機器 (10.1%)			
ソニー	11	15.7	119,429
日本光電工業	11	30	106,650
ファナック	1.7	—	—
村田製作所	7	16.6	106,173
輸送用機器 (一)			
デンソー	11	—	—
精密機器 (7.7%)			
テルモ	15	33	135,102
クリエートメディック	34	—	—
日本エム・ディ・エム	28	—	—
HOYA	—	11.3	117,237
ニプロ	26	—	—
その他製品 (3.5%)			
ビジョン	8	—	—
任天堂	—	2.3	115,345
陸運業 (一)			
東急	17.9	—	—
海運業 (一)			
商船三井	13.5	—	—
空運業 (一)			
ANAホールディングス	10	—	—
情報・通信業 (16.0%)			
テクマトリックス	29	28	108,920
NTTデータイントラマート	—	20	71,500
メディカル・データ・ビジ	22	—	—
エイトレッド	18	14	31,892
カオナビ	2	—	—
伊藤忠テクノソリューション	12	—	—
電通国際情報S	9	21	104,895
日本ユニシス	—	32	108,480
日本電信電話	—	40.5	101,088
SCSK	6	—	—
ミロク情報サービス	14	—	—
卸売業 (一)			
JALUX	23	—	—
神戸物産	7	—	—
三菱商事	10	—	—
小売業 (一)			
薬王堂	24	—	—

銘柄	株数	当期末	
	株数	株数	評価額
元気寿司	千株 15	千株 —	千円 —
銀行業 (2.0%)			
三菱UFJフィナンシャルG	—	150	65,625
三井住友フィナンシャルG	14	—	—
保険業 (0.9%)			
アイベツ損害保険	11.3	15	29,490
東京海上HD	7	—	—
不動産業 (一)			
日本駐車場開発	190	—	—
東急不動産HD	61	—	—
三菱地所	16	—	—
サービス業 (17.0%)			
コシダカホールディングス	22.9	—	—
リンクアンドモチベーション	62	70	29,540
夢真ホールディングス	45	—	—
ルネサンス	19	—	—
総医研ホールディングス	30	169	88,218
ベネフィット・ワン	8	24	53,280
エムスリー	20.6	11.5	51,750
エイジス	6	—	—
ラウンドワン	20	—	—
エフアンドエム	—	58.5	66,105
チャームケアコーポレーション	28	—	—
パリュウHR	23	35	51,100
シグマクシス	40	—	—
リクルートホールディングス	15	—	—
ベルシステム24HLDGS	39	75	104,175
グリーンズ	23	—	—
アドバンテッジリスクマネ	—	60	48,300
リログループ	13	30	65,340
合計	千株 1,654.8	千株 1,262.3	千円 3,288,135
銘柄数 < 比率 >	75銘柄	37銘柄	<96.1%>

(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

2020年6月22日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	3,288,135	96.1
コール・ローン等、その他	133,352	3.9
投資信託財産総額	3,421,487	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

日本健康社会応援マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年 6 月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3, 421, 487, 483円
コール・ローン等	99, 267, 953
株式（評価額）	3, 288, 135, 000
未収入金	11, 060, 230
未収配当金	23, 024, 300
(B) 負債	488, 116
未払解約金	488, 000
その他未払費用	116
(C) 純資産総額（A－B）	3, 420, 999, 367
元本	3, 065, 709, 287
次期繰越損益金	355, 290, 080
(D) 受益権総口数	3, 065, 709, 287口
1 万口当り基準価額（C／D）	11, 159円

- * 期首における元本額は3, 166, 397, 822円、当作成期間中における追加設定元本額は32, 797, 249円、同解約元本額は133, 485, 784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160, 866, 247円、日本健康社会応援ファンド（適格機関投資家専用）2, 904, 843, 040円です。
- * 当期末の計算口数当りの純資産額は11, 159円です。

■損益の状況

当期 自2019年 6 月21日 至2020年 6 月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	61, 096, 976円
受取配当金	61, 128, 000
受取利息	2, 290
その他収益金	44, 794
支払利息	△ 78, 108
(B) 有価証券売買損益	261, 318, 096
売買益	630, 808, 591
売買損	△ 369, 490, 495
(C) その他費用	△ 3, 941
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	322, 411, 131
(E) 前期繰越損益金	43, 230, 414
(F) 解約差損益金	△ 11, 235, 216
(G) 追加信託差損益金	883, 751
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	355, 290, 080
次期繰越損益金（H）	355, 290, 080

- (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。