

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5期

(決算日 2022年6月20日)

(作成対象期間 2021年6月22日～2022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	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		株式組入率	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	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
5 期末 (2022年 6 月20日)	9,109	0	△ 14.3	1,818.94	△ 4.2	93.3	—	122

(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。

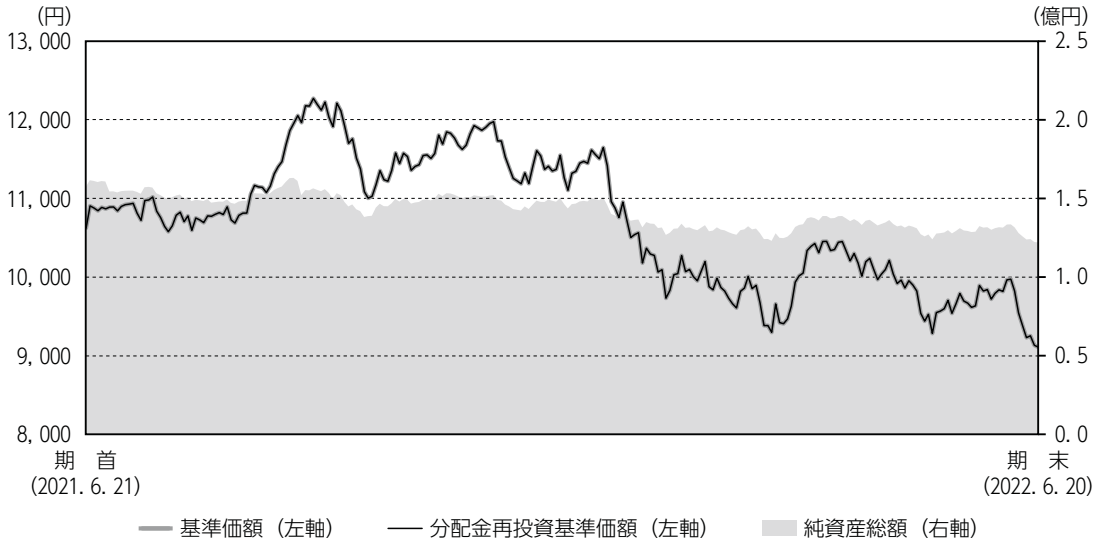
(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

「東証株価指数 (T O P I X)」の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」といいます。) 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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売およ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 は責任を負いません。



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：10,623円

期末：9,109円(分配金0円)

騰落率：△14.3%(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、国内株式市況は一進一退の展開となりました

が、当ファンドの主要投資対象である「健康社会(※)」推進企業の株価が下落したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

※当ファンドにおける健康社会とは、国民が長期的に健康的な生活を営める社会を指します。

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) 2021年 6月21日	円	%			%	%
	10,623	—	1,899.45	—	97.9	—
6月末	10,891	2.5	1,943.57	2.3	98.2	—
7月末	10,595	△ 0.3	1,901.08	0.1	98.3	—
8月末	11,313	6.5	1,960.70	3.2	97.9	—
9月末	11,758	10.7	2,030.16	6.9	99.4	—
10月末	11,572	8.9	2,001.18	5.4	99.3	—
11月末	11,256	6.0	1,928.35	1.5	98.4	—
12月末	11,506	8.3	1,992.33	4.9	98.6	—
2022年 1月末	10,030	△ 5.6	1,895.93	△ 0.2	93.8	—
2月末	9,860	△ 7.2	1,886.93	△ 0.7	94.0	—
3月末	10,338	△ 2.7	1,946.40	2.5	95.6	—
4月末	9,952	△ 6.3	1,899.62	0.0	94.2	—
5月末	9,823	△ 7.5	1,912.67	0.7	95.9	—
(期 末) 2022年 6月20日	9,109	△ 14.3	1,818.94	△ 4.2	93.3	—

(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

(2021. 6. 22 ~ 2022. 6. 20)

国内株式市況

国内株式市況は、一進一退の展開でした。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。しかし、2021年8月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで株価は反落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感されて11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3月後半は、FRBの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進行したことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後はFRBの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて上値の重い展開となりました。

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」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まいります。

ポートフォリオについて

(2021. 6. 22 ~ 2022. 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。

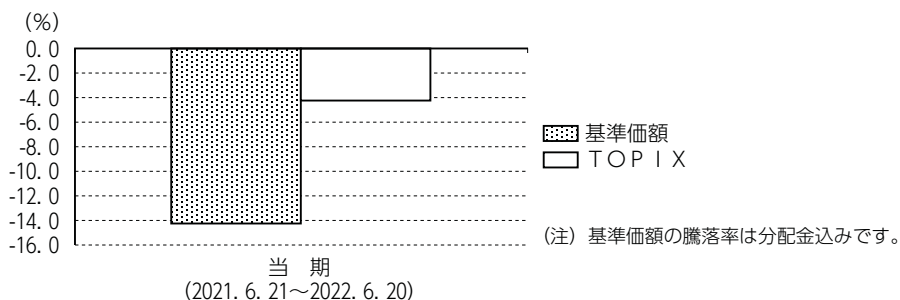
日本健康社会応援マザーファンド

「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、情報・通信業や電気機器、その他製品などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、任天堂、バンダイナムコHLDGS、日本電信電話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	
	2021年6月22日 ～2022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)	1,289

- (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」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 (2021. 6. 22~2022. 6. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	168円	1.569%	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10,707円です。
(投 信 会 社)	(82)	(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)	(82)	(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)	(4)	(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	19	0.178	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)	(19)	(0.178)	
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
合 計	188	1.752	

(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。

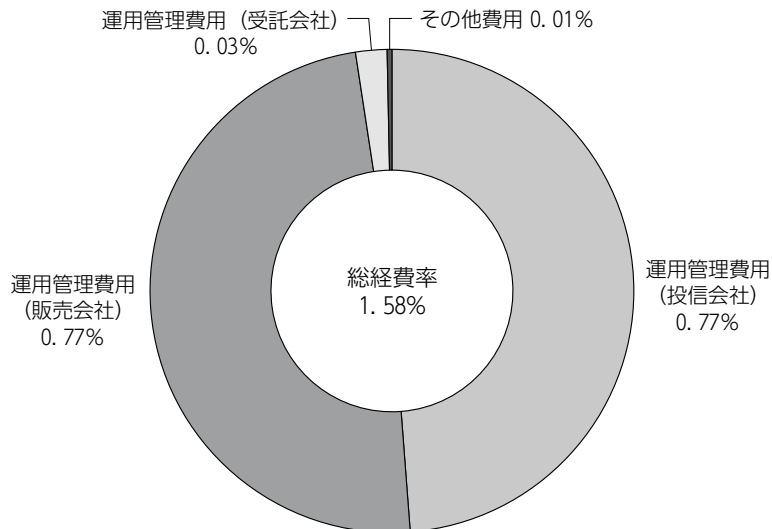
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2021年6月22日から2022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	17,338	22,842	30,949	42,490

(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

(2021年6月22日から2022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	5,120,010千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,680,790千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.39	

(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

(2021年6月22日から2022年6月20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	2,472	718	29.1	2,647	569	21.5
コール・ローン	23,718	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.8%

※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

(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	253千円
うち利害関係人への支払額(B)	67千円
(B) / (A)	26.8%

(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、大和証券株式会社です。

■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	122,975	109,364	121,941

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022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	121,941	98.8
コール・ローン等、その他	1,497	1.2
投資信託財産総額	123,439	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

2022年6月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	123,439,426円
コール・ローン等	1,153,893
日本健康社会応援マザー ファンド（評価額）	121,941,533
未収入金	344,000
(B) 負債	1,375,075
未払解約金	332,519
未払信託報酬	1,039,020
その他未払費用	3,536
(C) 純資産総額（A－B）	122,064,351
元本	134,005,481
次期繰越損益金	△ 11,941,130
(D) 受益権総口数	134,005,481口
1万口当り基準価額（C/D）	9,109円

* 期首における元本額は148,079,529円、当作成期間中における追加設定元本額は23,984,419円、同解約元本額は38,058,467円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,109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11,941,130円です。

■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	5,392,026
(d) 分配準備積立金	11,885,168
(e) 当期分配対象額（a+b+c+d）	17,277,194
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	17,277,194
(h) 受益権総口数	134,005,481口

■損益の状況

当期 自2021年6月22日 至2022年6月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	70円
受取利息	3
支払利息	△ 73
(B) 有価証券売買損益	18,576,644
売買益	2,957,085
売買損	△ 21,533,729
(C) 信託報酬等	2,235,605
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	20,812,319
(E) 前期繰越損益金	11,885,168
(F) 追加信託差損益金	3,013,979
（配当等相当額）	（ 5,392,026）
（売買損益相当額）	（△ 8,406,005）
(G) 合計（D＋E＋F）	11,941,130
次期繰越損益金（G）	11,941,130
追加信託差損益金	△ 3,013,979
（配当等相当額）	（ 5,392,026）
（売買損益相当額）	（△ 8,406,005）
分配準備積立金	11,885,168
繰越損益金	△ 20,812,319

（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せん。

（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。

日本健康社会応援マザーファンド

運用報告書 第5期 (決算日 2022年6月20日)

(作成対象期間 2021年6月22日～2022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

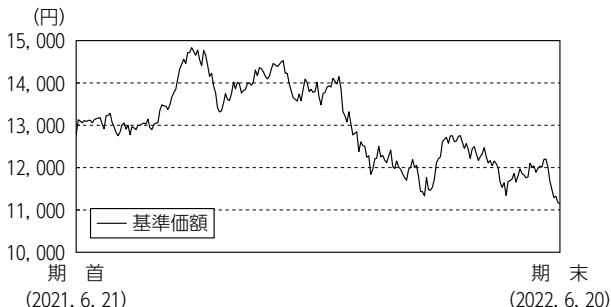
大和アセットマネジメント

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		株式比率	株式先物比率
	円	騰落率 (%)	(参考指数)	騰落率 (%)		
(期首) 2021年6月21日	12,791	—	1,899.45	—	97.9	—
6月末	13,118	2.6	1,943.57	2.3	98.3	—
7月末	12,779	△ 0.1	1,901.08	0.1	98.4	—
8月末	13,662	6.8	1,960.70	3.2	98.0	—
9月末	14,226	11.2	2,030.16	6.9	99.5	—
10月末	14,023	9.6	2,001.18	5.4	99.4	—
11月末	13,655	6.8	1,928.35	1.5	98.5	—
12月末	13,976	9.3	1,992.33	4.9	98.8	—
2022年1月末	12,205	△ 4.6	1,895.93	△ 0.2	93.9	—
2月末	12,011	△ 6.1	1,886.93	△ 0.7	94.1	—
3月末	12,611	△ 1.4	1,946.40	2.5	95.7	—
4月末	12,155	△ 5.0	1,899.62	0.0	94.3	—
5月末	12,015	△ 6.1	1,912.67	0.7	96.0	—
(期末) 2022年6月20日	11,150	△ 12.8	1,818.94	△ 4.2	93.4	—

(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：12,791円 期末：11,150円 騰落率：△12.8%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況は一進一退の展開となりましたが、当ファンドの主要投資対象である「健康社会(※)」推進企業の株価が下落したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

※当ファンドにおける健康社会とは、国民が長期的に健康的な生活を営める社会を指します。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、一進一退の展開でした。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。しかし、2021年8月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで株価は反落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感されて11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会)の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3月後半は、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進んだことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後はF R Bの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて上値の重い展開となりました。

◆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」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。

◆ポートフォリオについて

「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、情報・通信業や電気機器、その他製品などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、任天堂、パナダイナムコH L D G S、日本電信電話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」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
売買委託手数料 (株式)	23円 (23)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	23

(注1) 費用の項目および算出法については掲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

(2021年6月22日から2022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
	517.2 (5.5)	2,472,826 (—)	637.2	2,647,184

(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

(2021年6月22日から2022年6月20日まで)

銘 柄	当 期 買 付			当 期 売 付			
	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
オリエンタルランド	10.5	195,548	18,623	オリエンタルランド	12.5	230,761	18,460
日本電信電話	40	154,855	3,871	テルモ	43	195,078	4,536
テルモ	26	102,990	3,961	日本新薬	15.9	121,444	7,638
富士フィルムHLDGS	11.5	102,621	8,923	ユニ・チャーム	27.5	120,234	4,372
野村総合研究所	25.2	99,773	3,959	第一三共	38	114,601	3,015
任天堂	1.7	95,911	56,418	リクルートホールディングス	14.3	95,965	6,710
コナミホールディングス	11	93,875	8,534	S/MC	1.4	93,190	66,564
スクウェア・エニックス・HD	15	92,989	6,199	ベルシステム24HLDGS	63	91,350	1,450
ダイキン工業	3.7	85,545	23,120	武田薬品	29	90,724	3,128
ユニ・チャーム	19	84,283	4,435	ディスコ	2.9	90,580	31,234

(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
化学 (7.0%)			
積水化学	13	—	—
花王	16	8	41,704
富士フィルムHLDGS	—	9.7	66,736
ユニ・チャーム	32.5	24	103,560
医薬品 (8.9%)			
協和キリン	44	50	146,200
武田薬品	29	—	—
日本新薬	9.7	—	—
第一三共	48	40	122,000
ペプチドリーム	10	—	—

銘 柄	期 首	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (10.6%)			
ディスコ	2.4	1.2	35,736
ナブテスコ	15	10	30,500
S/MC	1.7	1	59,220
ダイキン工業	5.1	5.8	116,203
ダイフク	7.3	5	35,800
セガサミーホールディングス	—	20	41,220
電気機器 (16.8%)			
日立	—	11	70,477
ソニーグループ	13.8	12	132,300
キーエンス	1.9	1.9	87,552

日本健康社会応援マザーファンド

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
シスメックス	7	5.5	41,866	
ファナック	3.5	3	61,380	
村田製作所	6	7	54,068	
東京エレクトロン	1.4	1.3	59,202	
精密機器 (10.6%)				
テルモ	40	23	88,435	
オリンパス	44	29	77,183	
H O Y A	6.5	6	70,800	
朝日インテック	31.1	49	84,476	
その他製品 (13.8%)				
バンダイナムコH L D G S	8.8	18	167,220	
アシックス	—	20	46,900	
任天堂	1.9	3.6	202,320	
情報・通信業 (18.6%)				
テクマトリックス	30	—	—	
GMOペイメントゲートウェイ	4.9	4.5	36,855	
野村総合研究所	24	29	103,530	
Zホールディングス	50	99	37,936	
B I P R O G Y	17	—	—	
日本電信電話	—	40	153,160	
N T T データ	59	31	57,257	
スクウェア・エニックス・HD	—	15	88,650	
コナミホールディングス	—	11	83,820	
卸売業 (一)				
シップヘルスケアHD	28	—	—	
アズワン	4	—	—	
小売業 (1.4%)				
MonotaRO	25.5	24	40,944	
サービス業 (12.3%)				
エス・エム・エス	22	17	41,378	
ベネフィット・ワン	20	15	25,020	
エムスリー	9.5	9	31,005	
オリエンタルランド	10	8	144,680	
エフアンドエム	20.3	—	—	
リクルートホールディングス	30	16.8	63,991	
ベルシステム24H L D G S	30	—	—	
リログループ	48	33	64,350	
合計	株数、金額	株数	株数	千円
	銘柄数 <比率>	42銘柄	39銘柄	<93.4%>

(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

2022年6月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 3,015,635	% 93.1
コール・ローン等、その他	224,214	6.9
投資信託財産総額	3,239,850	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

2022年6月20日現在

項目	当期末
(A) 資産	3,239,850,449円
コール・ローン等	195,545,829
株式(評価額)	3,015,635,500
未収入金	11,871,880
未収配当金	16,797,240
(B) 負債	12,215,171
未払金	11,281,171
未払解約金	934,000
(C) 純資産総額(A-B)	3,227,635,278
元本	2,894,676,372
次期繰越損益金	332,958,906
(D) 受益権総口数	2,894,676,372口
1万口当り基準価額(C/D)	11,150円

* 期首における元本額は2,960,992,720円、当作成期間中における追加設定元本額は17,383,319円、同解約元本額は83,699,667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:

日本健康社会応援ファンド 109,364,604円

日本健康社会応援ファンド(適格機関投資家専用) 2,785,311,768円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,150円です。

■損益の状況

当期 自2021年6月22日 至2022年6月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	46,025,594円
受取配当金	46,048,611
受取利息	287
その他収益金	82
支払利息	△ 23,386
(B) 有価証券売買損益	△ 518,299,330
売買益	193,343,984
売買損	△ 711,643,314
(C) 当期損益金 (A + B)	△ 472,273,736
(D) 前期繰越損益金	826,524,294
(E) 解約差損益金	△ 26,800,333
(F) 追加信託差損益金	5,508,681
(G) 合計 (C + D + E + F)	332,958,906
次期繰越損益金 (G)	332,958,906

(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。

「東証株価指数 (TOPIX)」の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」といいます。) 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・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。