

日本健康社会 関連株式ファンド (愛称：ワクワク・イキイキ)

運用報告書(全体版) 第7期

(決算日 2024年6月20日)
(作成対象期間 2023年6月21日～2024年6月20日)

★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	日本健康社会関連株式マザーファンドの受益証券	
	日本健康社会関連株式マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みません。）	
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。		

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/>

最近 5 期の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	(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
3 期末 (2020年 6 月22日)	9,387	0	8.2	2,439.36	3.9	96.0	—	179
4 期末 (2021年 6 月21日)	10,623	10	13.3	2,997.62	22.9	97.9	—	157
5 期末 (2022年 6 月20日)	9,109	0	△ 14.3	2,939.28	△ 1.9	93.3	—	122
6 期末 (2023年 6 月20日)	11,293	10	24.1	3,792.37	29.0	94.9	—	133
7 期末 (2024年 6 月20日)	12,709	10	12.6	4,630.39	22.1	96.2	—	112

(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。

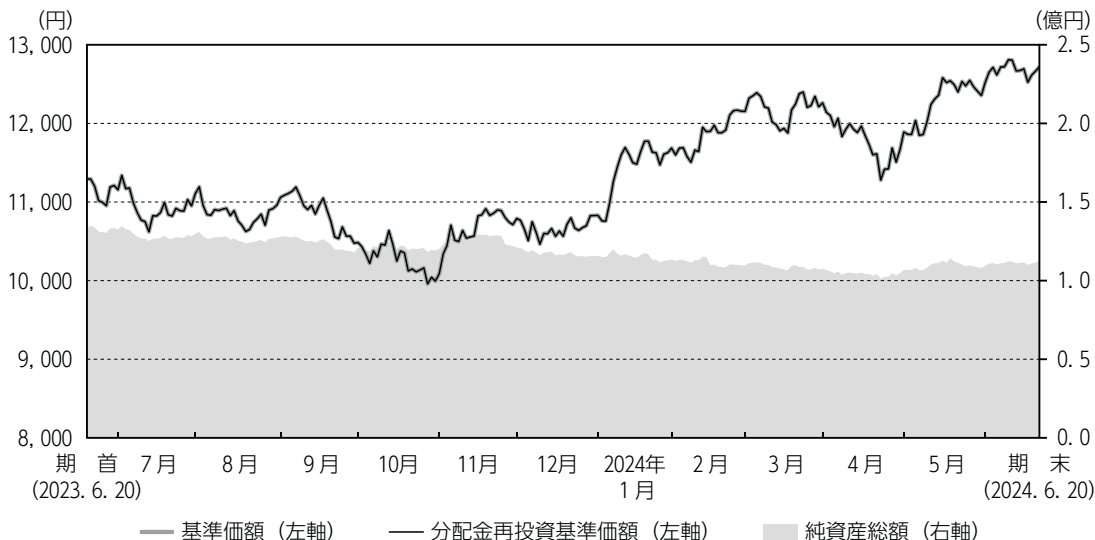
(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

配当込み TOPIX (本書類における「TOPIX (配当込み)」をいう。) の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」という。) 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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有する。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及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 は責任を負わない。



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：11,293円

期末：12,709円（分配金10円）

騰落率：12.6%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「日本健康社会関連株式マザーファンド」の

受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、国内株式市況が、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化などにより大幅に上昇したことがプラス要因となり、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。

日本健康社会関連株式ファンド

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X (配 当 込 み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 比 率
		騰 落 率	(参 考 指 数)	騰 落 率		
(期 首) 2023年 6 月20日	円	%			%	%
	11,293	—	3,792.37	—	94.9	—
6 月 末	11,156	△ 1.2	3,805.00	0.3	98.8	—
7 月 末	11,108	△ 1.6	3,861.80	1.8	97.7	—
8 月 末	11,059	△ 2.1	3,878.51	2.3	98.4	—
9 月 末	10,485	△ 7.2	3,898.26	2.8	97.5	—
10 月 末	10,089	△ 10.7	3,781.64	△ 0.3	98.0	—
11 月 末	10,791	△ 4.4	3,986.65	5.1	99.5	—
12 月 末	10,830	△ 4.1	3,977.63	4.9	98.0	—
2024年 1 月 末	11,686	3.5	4,288.36	13.1	98.0	—
2 月 末	12,153	7.6	4,499.61	18.6	98.0	—
3 月 末	12,261	8.6	4,699.20	23.9	97.5	—
4 月 末	11,891	5.3	4,656.27	22.8	97.9	—
5 月 末	12,517	10.8	4,710.15	24.2	98.1	—
(期 末) 2024年 6 月20日	12,719	12.6	4,630.39	22.1	96.2	—

(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

(2023. 6. 21 ~ 2024. 6. 20)

国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。2023年8月半ばに発表された2023年4-6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方で円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。2024年1月以降は、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。3月下旬以降は、米国の利下げ開始の後ずれ観測、市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇などが上値を抑えて高値圏での保ち合いとなり、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「日本健康社会関連株式マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

日本健康社会関連株式マザーファンド

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。

※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。

ポートフォリオについて

(2023. 6. 21 ~ 2024. 6. 20)

■当ファンド

「日本健康社会関連株式マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

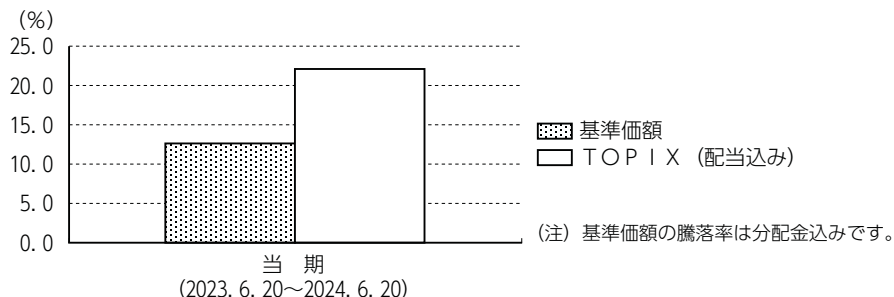
■日本健康社会関連株式マザーファンド

「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、電気機器やその他製品、精密機器などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、日立、アシックス、任天堂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	
	2023年6月21日 ～2024年6月20日	
当期分配金（税込み）	(円)	10
対基準価額比率	(%)	0.08
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)	3,392

- (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。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。

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	✓	114.25円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		1,283.94
(c) 収益調整金		831.50
(d) 分配準備積立金		1,172.40
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		3,402.10
(f) 分配金		10.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		3,392.10

(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

「日本健康社会関連株式マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

■日本健康社会関連株式マザーファンド

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 (2023. 6. 21~2024. 6. 20)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	178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11,330円です。
(投 信 会 社)	(87)	(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)	(87)	(0.770)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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	10	0.085	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)	(10)	(0.085)	
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	1.663	

(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。

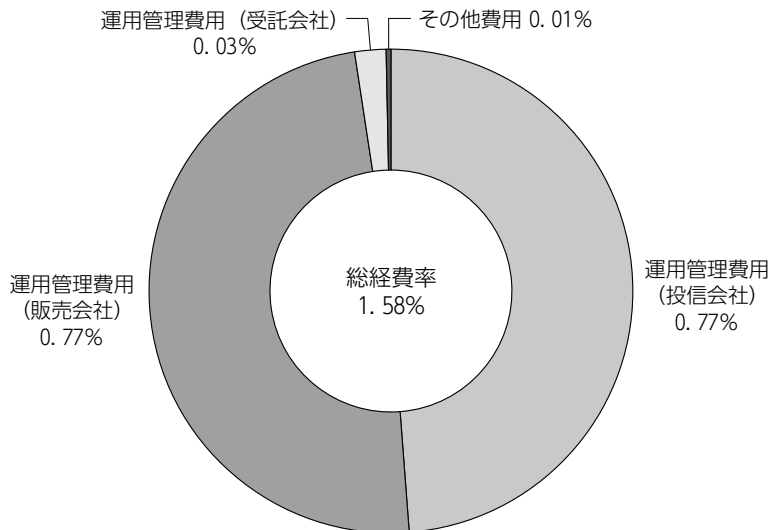
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2023年6月21日から2024年6月20日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本健康社会関連株式 マザーファンド	14,684	20,684	39,369	56,351

(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

(2023年6月21日から2024年6月20日まで)

項 目	当 期
	日本健康社会関連株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,258,600千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,795,004千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.59

(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

(2023年6月21日から2024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
株式	1,068	422	39.5	1,189	386	32.5
コール・ローン	15,961	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.1%

※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

(2023年6月21日から2024年6月20日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額(A)	100千円
うち利害関係人への支払額(B)	37千円
(B) / (A)	37.3%

(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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本健康社会関連株式 マザーファンド	94,760	70,075	112,689

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年6月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本健康社会関連株式マザーファンド	112,689	99.0
コール・ローン等、その他	1,131	1.0
投資信託財産総額	113,820	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

日本健康社会関連株式ファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年6月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	113,820,076円
コール・ローン等	1,124,052
日本健康社会関連株式マザー ファンド（評価額）	112,689,024
未収入金	7,000
(B) 負債	1,107,571
未払収益分配金	88,684
未払解約金	148,349
未払信託報酬	867,592
その他未払費用	2,946
(C) 純資産総額（A－B）	112,712,505
元本	88,684,588
次期繰越損益金	24,027,917
(D) 受益権総口数	88,684,588口
1万口当り基準価額（C／D）	12,709円

* 期首における元本額は118,055,748円、当作成期間中における追加設定元本額は24,750,045円、同解約元本額は54,121,205円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,709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	1,013,243円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	11,386,572
(c) 収益調整金	7,374,159
(d) 分配準備積立金	10,397,423
(e) 当期分配対象額（a+b+c+d）	30,171,397
(f) 分配金	88,684
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	30,082,713
(h) 受益権総口数	88,684,588口

■損益の状況

当期 自2023年6月21日 至2024年6月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	99円
受取利息	119
支払利息	△ 20
(B) 有価証券売買損益	14,255,391
売買益	16,912,126
売買損	△ 2,656,735
(C) 信託報酬等	1,855,675
△	
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	12,399,815
(E) 前期繰越損益金	10,397,423
(F) 追加信託差損益金	1,319,363
（配当等相当額）	（ 7,374,159）
（売買損益相当額）	（△ 6,054,796）
(G) 合計（D＋E＋F）	24,116,601
(H) 収益分配金	88,684
△	
次期繰越損益金（G＋H）	24,027,917
追加信託差損益金	1,319,363
（配当等相当額）	（ 7,374,159）
（売買損益相当額）	（△ 6,054,796）
分配準備積立金	22,708,554

（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。

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

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。

《お知らせ》

■ファンド名称の変更について

以下の通り、2023年9月14日付で当ファンドおよびマザーファンドの名称を変更しました。

変 更 前	変 更 後
日本健康社会応援ファンド	日本健康社会関連株式ファンド
日本健康社会応援マザーファンド	日本健康社会関連株式マザーファンド

日本健康社会関連株式マザーファンド

運用報告書 第7期 (決算日 2024年6月20日)

(作成対象期間 2023年6月21日～2024年6月20日)

日本健康社会関連株式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。

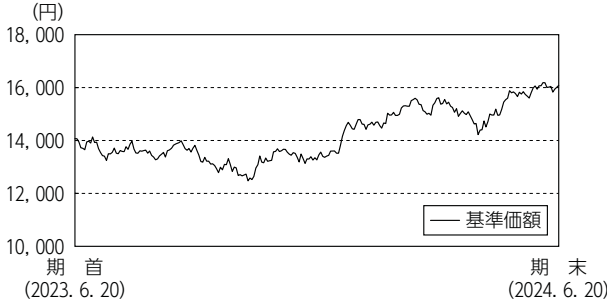
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

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 (配当込み)		株式組比率	株式先物比率
	円	%	(参考指数)	%		
(期首) 2023年6月20日	14,069	—	3,792.37	—	94.9	—
6月末	13,905	△ 1.2	3,805.00	0.3	98.8	—
7月末	13,863	△ 1.5	3,861.80	1.8	97.8	—
8月末	13,820	△ 1.8	3,878.51	2.3	98.1	—
9月末	13,119	△ 6.8	3,898.26	2.8	97.6	—
10月末	12,642	△ 10.1	3,781.64	△ 0.3	98.1	—
11月末	13,542	△ 3.7	3,986.65	5.1	98.0	—
12月末	13,605	△ 3.3	3,977.63	4.9	98.1	—
2024年1月末	14,691	4.4	4,288.36	13.1	98.1	—
2月末	15,295	8.7	4,499.61	18.6	98.0	—
3月末	15,447	9.8	4,699.20	23.9	97.6	—
4月末	15,001	6.6	4,656.27	22.8	98.0	—
5月末	15,811	12.4	4,710.15	24.2	98.2	—
(期末) 2024年6月20日	16,081	14.3	4,630.39	22.1	96.2	—

(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：14,069円 期末：16,081円 騰落率：14.3%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況が、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化などにより大幅に上昇したことがプラス要因となり、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

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国に

おける長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。2023年8月半ばに発表された2023年4－6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方で円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。2024年1月以降は、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。3月下旬以降は、米国の利下げ開始の後ずれ観測、市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇などが上値を抑えて高値圏での保ち合いとなり、当作成期末を迎えました。

◆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。

※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。

◆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、電気機器やその他製品、精密機器などの業種を高位に組み入れました。個別銘柄では、日立、アシックス、任天堂などを組入位としました。

◆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。

日本健康社会関連株式マザーファンド

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	11円 (11)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	11

(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

(2023年6月21日から2024年6月20日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
国内	千株 396.3 (649.8)	千円 1,068,706 (—)	千株 780.8	千円 1,189,893

(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

(2023年6月21日から2024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
味の素	千株 20	千円 111,752	円 5,587	ディスコ	千株 3.3	千円 102,084	円 30,934
中外製薬	18	103,623	5,756	MonotaRO	53	81,916	1,545
ファナック	18.8	92,182	4,903	アステラス製薬	47.9	80,397	1,678
イビデン	9	76,040	8,448	GMOペイメントゲートウェイ	9	78,708	8,745
島津製作所	19	75,455	3,971	日本電信電話	460	73,503	159
テルモ	13.7	57,588	4,203	テルモ	15.5	71,945	4,641
カブコン	10.5	55,269	5,263	東京エレクトロン	3.4	68,369	20,108
ユニ・チャーム	8.5	48,423	5,696	スクウェア・エニックス・HD	12	66,820	5,568
アステラス製薬	22.9	47,476	2,073	村田製作所	16.2	66,557	4,108
日本電信電話	176.3	40,901	231	コーエーテックモHD	32.4	61,332	1,892

(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
食品 (2.7%)			
味の素	—	20	111,180
化学 (5.2%)			
富士フイルムHLDS	10.6	23.7	87,405
ユニ・チャーム	16.2	24.7	128,711
医薬品 (8.1%)			
アステラス製薬	25	—	—
中外製薬	—	18	92,556
エーザイ	4.1	8.1	50,916
第一三共	27.2	35.5	193,972
機械 (10.4%)			
ディスコ	5.9	2.9	180,119

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気機器 (28.4%)			
SMC	1.4	1.4	107,366
ダイキン工業	5.4	4.4	101,310
ダイフク	20.4	—	—
セガサミーホールディングス	20	19.5	45,464
イビデン	—	6.5	46,475
日立	19.7	16.9	287,976
ソニーグループ	14.4	17	217,515
アドバンテスト	—	8	46,688
キーエンス	2.3	2.8	193,648
ファナック	10	18.8	79,260
村田製作所	13.6	30.2	101,411

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
東京エレクトロン 精密機器 (13.0%)	9.5	6.1	212,829	
テルモ	30.5	57.4	148,809	
島津製作所	—	19	74,784	
オリンパス	36.6	26.6	67,856	
H O Y A	7	7	129,325	
朝日インテック	54	54	121,689	
その他製品 (14.1%)				
バンダイナムコH L D G S	36.3	29.3	87,856	
アシックス	30.1	26.4	255,499	
任天堂	29	29	246,152	
情報・通信業 (9.8%)				
コーエーテックモHD	20	—	—	
GMOペイメントゲートウェイ	9	—	—	
野村総合研究所	32.4	30.1	129,189	
日本電信電話	20.8	301.1	43,960	
NTTデータグループ	31	—	—	
スクウェア・エニックス・HD	12	—	—	
カプコン	7	35	102,550	
コナミグループ	10.2	12.2	132,431	
小売業 (一)				
MonotaRO	53	—	—	
サービス業 (8.4%)				
オリエンタルランド	31.4	31.4	140,452	
リクルートホールディングス	27.1	25.4	209,016	
合計	株数、金額	株数	株数	千円
	683.1	948.4	4,174,375	
	銘柄数 < 比率 >	34銘柄	32銘柄	< 96.2% >

(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

2024年6月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 4,174,375	% 96.2
コール・ローン等、その他	163,547	3.8
投資信託財産総額	4,337,922	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

2024年6月20日現在

項目	当期末
(A) 資産	4,337,922,986円
コール・ローン等	60,067,312
株式(評価額)	4,174,375,500
未収入金	89,260,090
未収配当金	14,220,084
(B) 負債	617,000
未払解約金	617,000
(C) 純資産総額(A-B)	4,337,305,986
元本	2,697,215,118
次期繰越損益金	1,640,090,868
(D) 受益権総口数	2,697,215,118口
1万口当り基準価額(C/D)	16,081円

* 期首における元本額は2,845,843,011円、当作成期間中における追加設定元本額は14,684,948円、同解約元本額は163,312,841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：
日本健康社会関連株式ファンド 70,075,881円
日本健康社会関連株式ファンド(適格機関投資家専用) 2,627,139,237円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,081円です。

■損益の状況

当期 自2023年6月21日 至2024年6月20日

項目	当	期
(A) 配当等収益		46,009,837円
受取配当金		46,013,602
受取利息		11,755
その他収益		112
支払利息	△	15,632
(B) 有価証券売買損益		497,970,486
売買益		864,452,773
売買損	△	366,482,287
(C) その他費用	△	14
(D) 当期損益金(A+B+C)		543,980,309
(E) 前期繰越損益金		1,157,869,666
(F) 解約差損益金	△	67,758,159
(G) 追加信託差損益金		5,999,052
(H) 合計(D+E+F+G)		1,640,090,868
次期繰越損益金(H)		1,640,090,868

(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。

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

《お知らせ》

■ファンド名称の変更について

以下の通り、2023年9月14日付でファンドの名称を変更しました。

- ・変更前：日本健康社会応援マザーファンド
- ・変更後：日本健康社会関連株式マザーファンド