

○当ファンドの仕組みは次のとおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 主投資対象 | しんきん好配当利回り株マザーファンド受益証券、しんきん世界好配当利回り株マザーファンド受益証券、しんきん国内債券マザーファンドⅡ受益証券、しんきん欧州ソブリン債マザーファンド受益証券、しんきん米国ソブリン債マザーファンド受益証券、しんきん高格付外国債券マザーファンド受益証券、しんきんJリートマザーファンドⅡ受益証券およびしんきんグローバルリートマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| 運用方針 | ①各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券へ分散投資を行います。 ②各マザーファンド受益証券への資金配分は、原則として、6つの資産の割合が、投資信託財産の純資産総額に対して、おおむね6分の1ずつになるよう、それぞれ以下に定める範囲内で投資します。 <国内株式> 16% (±10%) しんきん好配当利回り株マザーファンド受益証券 <外国株式> 16% (±10%) しんきん世界好配当利回り株マザーファンド受益証券 <国内債券> 16% (±10%) しんきん国内債券マザーファンドⅡ受益証券 <外国債券> 16% (±10%) しんきん欧州ソブリン債マザーファンド受益証券 しんきん米国ソブリン債マザーファンド受益証券 しんきん高格付外国債券マザーファンド受益証券 <国内不動産投信> 16% (±10%) しんきんJリートマザーファンドⅡ受益証券 <外国不動産投信> 16% (±10%) しんきんグローバルリートマザーファンド受益証券 ③実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ④資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。 |
| 主投資制限 | ①株式への直接投資は行いません。 ②外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 収益分配方針 | ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益も含みます。）等とします。 ②分配金は、利子・配当等収益等を中心に安定した収益分配を行うことを目指し、委託者が基準価額等を勘案して決定します。 |

運用報告書(全体版)

しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型)

第215期 (決算日：2024年7月12日)
第216期 (決算日：2024年8月13日)
第217期 (決算日：2024年9月12日)
第218期 (決算日：2024年10月15日)
第219期 (決算日：2024年11月12日)
第220期 (決算日：2024年12月12日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引立てに預かり厚く御礼申し上げます。

さて、ご購入いただいております「しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型)」は2024年12月12日に第220期の決算を行いました。

ここに、第215期から第220期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

■運用報告書に関しては、下記にお問い合わせください。

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
<コールセンター> ☎ 0120-781812
(土日、休日を除く) 携帯電話からは03-5524-8181
(9:00~17:00)

本資料は投資信託の運用状況を開示するためのものであり、ファンドの勧誘を目的とするものではありません。

 しんきんアセットマネジメント投信株式会社

〒104-0031 東京都中央区京橋3丁目8番1号

<https://www.skam.co.jp>

目 次

| | |
|------------------------------|-----|
| ◇しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） | 頁 |
| 最近30期の運用実績 | 1 |
| 当作成期中の基準価額と市況等の推移 | 2 |
| 当作成期中（第215期～第220期）の運用経過等 | 3 |
| 1万口当たりの費用明細 | 10 |
| 売買及び取引の状況 | 12 |
| 株式売買比率 | 12 |
| 利害関係人との取引状況等 | 12 |
| 第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況 | 12 |
| 自社による当ファンドの設定・解約状況 | 12 |
| 組入資産の明細 | 13 |
| 投資信託財産の構成 | 13 |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 14 |
| 損益の状況 | 15 |
| 分配金のお知らせ | 16 |
| ◇参考情報 | |
| 親投資信託の組入資産の明細 | 17 |
| ◇親投資信託の運用報告書 | |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド | 38 |
| しんきん世界好配当利回り株マザーファンド | 47 |
| しんきん国内債券マザーファンドⅡ | 59 |
| しんきん欧州ソブリン債マザーファンド | 67 |
| しんきん米国ソブリン債マザーファンド | 76 |
| しんきん高格付外国債券マザーファンド | 84 |
| しんきんJリートマザーファンドⅡ | 93 |
| しんきんグローバルリートマザーファンド | 102 |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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う仕組みです。

○最近30期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 株組入比率 | 債組入比率 | 債券組入比率 | 投資信託組入比率 | 純資産総額 |
|-------------------|--------|----|----|-------|-------|--------|----------|--------|
| | (分配落) | 税分 | 込配 | | | | | |
| | 円 | 円 | 円 | % | % | % | % | 百万円 |
| 191期(2022年7月12日) | 9,232 | 20 | | △1.3 | 32.8 | 32.5 | 32.9 | 17,443 |
| 192期(2022年8月12日) | 9,445 | 20 | | 2.5 | 32.7 | 32.2 | 33.3 | 18,112 |
| 193期(2022年9月12日) | 9,510 | 20 | | 0.9 | 32.6 | 32.5 | 33.1 | 18,609 |
| 194期(2022年10月12日) | 8,883 | 20 | | △6.4 | 32.5 | 33.3 | 32.2 | 17,708 |
| 195期(2022年11月14日) | 9,254 | 20 | | 4.4 | 33.5 | 32.1 | 32.7 | 18,591 |
| 196期(2022年12月12日) | 9,222 | 20 | | △0.1 | 33.9 | 32.3 | 32.4 | 18,622 |
| 197期(2023年1月12日) | 9,062 | 20 | | △1.5 | 33.6 | 32.1 | 32.5 | 18,562 |
| 198期(2023年2月13日) | 9,164 | 20 | | 1.3 | 34.3 | 31.7 | 32.8 | 18,861 |
| 199期(2023年3月13日) | 9,123 | 20 | | △0.2 | 33.7 | 32.5 | 31.8 | 18,943 |
| 200期(2023年4月12日) | 9,219 | 20 | | 1.3 | 33.1 | 32.4 | 32.6 | 19,288 |
| 201期(2023年5月12日) | 9,347 | 20 | | 1.6 | 32.3 | 32.2 | 33.1 | 19,661 |
| 202期(2023年6月12日) | 9,538 | 20 | | 2.3 | 32.6 | 32.5 | 33.0 | 19,968 |
| 203期(2023年7月12日) | 9,575 | 20 | | 0.6 | 32.3 | 32.6 | 33.2 | 19,816 |
| 204期(2023年8月14日) | 9,777 | 20 | | 2.3 | 33.3 | 32.2 | 33.2 | 20,236 |
| 205期(2023年9月12日) | 9,830 | 20 | | 0.7 | 33.1 | 32.1 | 32.9 | 20,399 |
| 206期(2023年10月12日) | 9,744 | 20 | | △0.7 | 33.1 | 32.4 | 32.4 | 20,337 |
| 207期(2023年11月13日) | 9,653 | 20 | | △0.7 | 33.1 | 32.7 | 32.6 | 20,047 |
| 208期(2023年12月12日) | 9,802 | 20 | | 1.8 | 33.1 | 32.5 | 33.1 | 20,118 |
| 209期(2024年1月12日) | 10,047 | 20 | | 2.7 | 33.5 | 32.3 | 32.7 | 20,393 |
| 210期(2024年2月13日) | 10,057 | 20 | | 0.3 | 33.3 | 32.4 | 32.5 | 20,193 |
| 211期(2024年3月12日) | 10,053 | 20 | | 0.2 | 32.9 | 32.6 | 32.7 | 19,889 |
| 212期(2024年4月12日) | 10,309 | 20 | | 2.7 | 33.2 | 32.0 | 32.8 | 20,283 |
| 213期(2024年5月13日) | 10,458 | 20 | | 1.6 | 33.0 | 32.0 | 33.1 | 20,490 |
| 214期(2024年6月12日) | 10,357 | 20 | | △0.8 | 32.8 | 32.6 | 32.6 | 20,240 |
| 215期(2024年7月12日) | 10,643 | 20 | | 3.0 | 33.1 | 32.3 | 32.8 | 20,690 |
| 216期(2024年8月13日) | 10,086 | 20 | | △5.0 | 31.8 | 33.2 | 33.1 | 19,519 |
| 217期(2024年9月12日) | 10,193 | 20 | | 1.3 | 31.9 | 32.6 | 33.9 | 19,711 |
| 218期(2024年10月15日) | 10,431 | 20 | | 2.5 | 33.2 | 32.4 | 32.8 | 20,077 |
| 219期(2024年11月12日) | 10,458 | 20 | | 0.5 | 32.8 | 32.6 | 32.7 | 20,042 |
| 220期(2024年12月12日) | 10,319 | 20 | | △1.1 | 33.0 | 32.8 | 32.4 | 19,668 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドは6つの異なる資産(国内株式・外国株式・国内債券・外国債券・国内不動産投信・外国不動産投信)に分散投資を行うことで投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指しておりますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指標はありません。

(注3) 当ファンドは国内外の株式、債券および投資信託証券(不動産投資信託)に約3分の1ずつ投資しています。また、ファンドの約半分を円建資産に、残りの約半分を外貨建資産に投資しています。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注5) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注6) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年 月 日 | 基準価額 | 騰 落 率 | | 株組入比率 | 債組入比率 | 投資信託組入比率 |
|-------|---------------------|-------------|--------|-------|-----------|-----------|-----------|
| | | | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| 第215期 | (期首) 2024年6月12日 | 円 10,357 | % - | | % 32.8 | % 32.6 | % 32.6 |
| | 6月末 | 10,513 | 1.5 | | 33.1 | 32.6 | 32.8 |
| | (期末) 2024年7月12日 | 10,663 | 3.0 | | 33.1 | 32.3 | 32.8 |
| 第216期 | (期首) 2024年7月12日 | 10,643 | - | | 33.1 | 32.3 | 32.8 |
| | 7月末 | 10,468 | △1.6 | | 33.2 | 32.1 | 33.0 |
| | (期末) 2024年8月13日 | 10,106 | △5.0 | | 31.8 | 33.2 | 33.1 |
| 第217期 | (期首) 2024年8月13日 | 10,086 | - | | 31.8 | 33.2 | 33.1 |
| | 8月末 | 10,336 | 2.5 | | 32.4 | 32.3 | 33.2 |
| | (期末) 2024年9月12日 | 10,213 | 1.3 | | 31.9 | 32.6 | 33.9 |
| 第218期 | (期首) 2024年9月12日 | 10,193 | - | | 31.9 | 32.6 | 33.9 |
| | 9月末 | 10,351 | 1.6 | | 32.7 | 32.3 | 33.4 |
| | (期末) 2024年10月15日 | 10,451 | 2.5 | | 33.2 | 32.4 | 32.8 |
| 第219期 | (期首) 2024年10月15日 | 10,431 | - | | 33.2 | 32.4 | 32.8 |
| | 10月末 | 10,492 | 0.6 | | 32.7 | 32.5 | 32.7 |
| | (期末) 2024年11月12日 | 10,478 | 0.5 | | 32.8 | 32.6 | 32.7 |
| 第220期 | (期首) 2024年11月12日 | 10,458 | - | | 32.8 | 32.6 | 32.7 |
| | 11月末 | 10,332 | △1.2 | | 32.6 | 32.7 | 33.0 |
| | (期末) 2024年12月12日 | 10,339 | △1.1 | | 33.0 | 32.8 | 32.4 |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

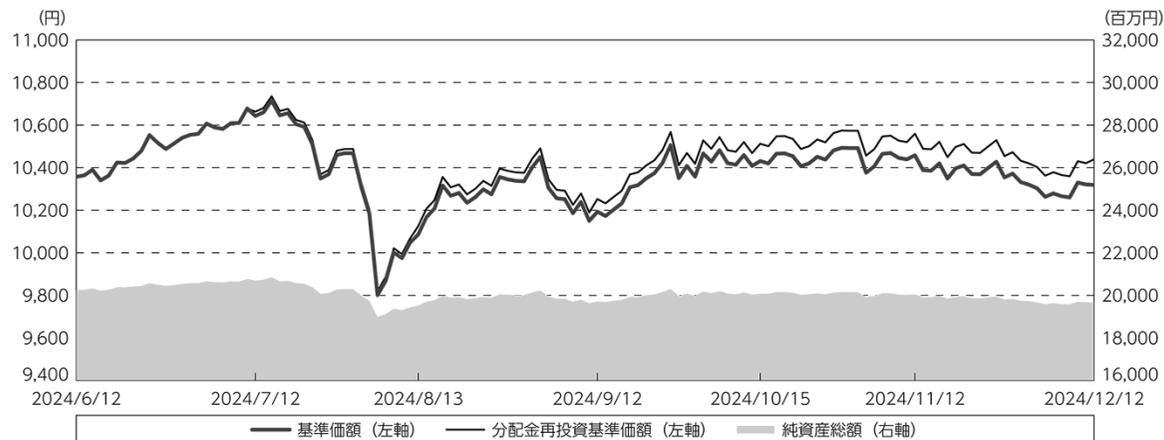
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

○当作成期中（第215期～第220期）の運用経過等（2024年6月13日～2024年12月12日）

<当作成期中の基準価額等の推移>



(注1) 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。

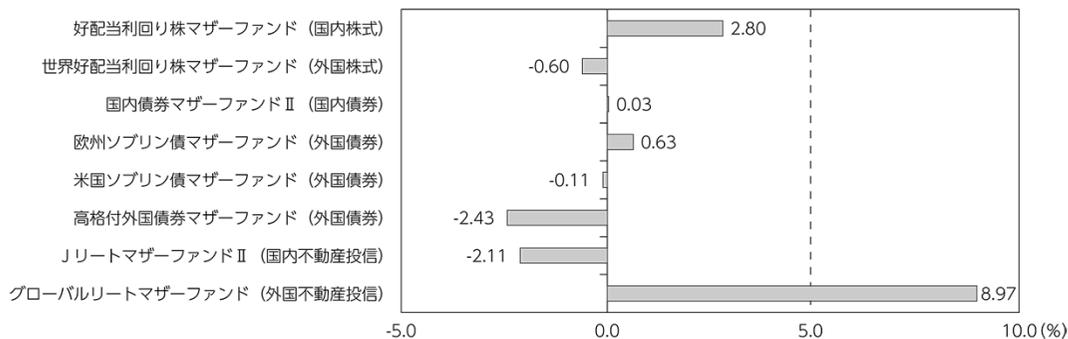
(注2) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2024年6月12日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

<基準価額の主な変動要因>

当ファンドは、複数のマザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託証券へ分散投資を行うことで、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指しています。当作成期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。

各マザーファンドの期間騰落率および当ファンドの基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

当作成期中の各マザーファンドの騰落率 (第215期～第220期)



(注) () 内は主な組入れ対象資産

＜上昇要因＞

- ・国内株式市場が上昇し、国内株式を投資対象とするマザーファンドがプラスに寄与したこと。
- ・組み入れている債券価格が上昇し、国内債券を投資対象とするマザーファンドが小幅にプラスに寄与したこと。
- ・欧州債券市場が上昇し、欧州債券を投資対象とするマザーファンドがプラスに寄与したこと。
- ・外国不動産投資信託（外国リート）市場が上昇し、外国リートを投資対象とするマザーファンドがプラスに寄与したこと。

＜下落要因＞

- ・組み入れている外国株式が下落し、外国株式を投資対象とするマザーファンドがマイナスに寄与したこと。
- ・米ドルが対円で下落し、米国債券を投資対象とするマザーファンドが小幅にマイナスに寄与したこと。
- ・投資対象国通貨が対円で下落し、高格付外債を投資対象とするマザーファンドがマイナスに寄与したこと。
- ・国内不動産投資信託（国内リート）市場が下落し、国内リートを投資対象とするマザーファンドがマイナスに寄与したこと。

＜投資環境＞

（国内株式市況）

国内株式市場は上昇しました。当作成期初から2024年9月にかけては、日銀の金融政策正常化観測の高まりや、米雇用の減速を示唆する経済指標の発表、自民党総裁に金融政策の正常化に前向きな考えを示している石破氏が就任したことなどを受けたことによる円高の進行等が重しとなり、売りが優勢となりました。特に8月5日は、日経平均株価の下落幅が4,451.28円となる史上最大の下げ幅を記録しました。10月は、衆議院選の結果が与党の過半数割れとなり、野党が主張する積極的な財政政策が実施されるとの思わくが強まったことなどから上昇しました。その後は、日銀が12月の金融政策決定会合で追加利上げを決めるとの観測が高まったことや、トランプ氏の関税政策による輸出産業の業績低下が見込まれることなどが重しとなるものの、脱デフレ化傾向が進み、内需主導の景気回復が見込まれることや、国内企業の株主還元の動きが強まっていることなどが株価の下支えとなり、当作成期末にかけては底堅く推移し、当作成期を通じては、国内株式市場は上昇しました。

（外国株式市況）

外国株式市場は、全体で見ると上昇しました。当作成期初から2024年9月にかけては、米国経済の減速を示唆する経済指標の発表が相次ぎ、市場の利下げ期待が高まったことや、実際に米連邦公開市場委員会（FOMC）で0.5%の利下げが決まったこと、欧州中央銀行（ECB）の政策理事会で0.25%の利下げを決定したことなどが好感され、上昇しました。10月は、米国経済の底堅さなどを要因とした米国金利の上昇が重しとなり、下落しました。11月は、トランプ氏が米大統領選挙で勝利し、同氏が掲げる規制緩和や減税が米景気を刺激するとの期待などから上昇し、当作成期を通じては、外国株式市場は上昇しました。

（国内債券市況）

国内債券市場はほぼ横ばいとなりました。2024年7月は、日銀が国債買入れを大幅に減らすとの思わくなどから下落する一方で、米消費者物価指数（CPI）の伸び鈍化を受けた米国金利の低下に準じて国内債券市場は上昇するなど、一進一退の動きが続きました。8月から9月にかけては、米雇用統計が市場予想を下回る内容だったことや、植田日銀総裁が利上げに慎重な姿勢を示したことなどから、上昇しました。その後は、日銀の追加利上げ観測が再燃したことや、石破政権の経済対策に伴う国債増発への懸念などから下落基調の動きとなりましたが、利回りの高さに着目した買いに加え、トランプ氏が新政権の財務長官として投資家のスコッ

ト・ベッセント氏を指名したことによる財政規律に配慮した経済政策への期待などから米国金利が大幅に低下したことを受け、下落幅を縮小し、当作成期を通じては、国内債券市場はほぼ横ばいとなりました。

(外国債券市況)

外国債券市場は、全体で見ると上昇しました。米国では、2024年7月から9月にかけて、パウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長が利下げの可能性について言及したことや、米雇用統計が想定を超えるペースで労働市場が悪化していることを示唆したことなどから、米国債券市場は上昇しました。その後、米大統領選挙で勝利したトランプ氏の掲げる政策などがインフレを再燃させるとの見方から、下落基調で推移し、当作成期を通じては、米国債券市場は下落しました。

欧州では、2024年7月から9月にかけて、ドイツの7月の製造業購買担当者景気指数（PMI）速報値が市場予想を下回ったことで、ECBによる利下げ観測が市場で高まったことや、米経済指標等の結果を受けて低下した米国金利に連動したことなどから、欧州債券市場は上昇基調で推移しました。その後は、ドイツの複数の経済指標が市場予想を上回ったことでドイツの景気後退の回避が示唆されたことなどから下落基調となったものの、ECBが利下げペースを加速させるとの観測や、ユーロ圏のPMIの結果などを受けて、上昇基調で推移し、当作成期を通じては、欧州債券市場は上昇しました。

(国内リート市況)

国内リート市場は下落しました。2024年7月は、米経済指標を受け米国金利が低下する一方、日銀から国債買い入れオペ減額策が公表されるとの見込みから、ほぼ横ばいの動きとなりました。8月は、パウエルFRB議長が今後の利下げに前向きな発言をしたことなどが支えとなり、約3か月ぶりの高値を付けるなど、買いが優勢となりました。その後は、自民党総裁選で石破氏が選出されたことや、米大統領選挙の結果を受けた金利上昇などを理由とした下落基調の動きが続き、当作成期を通じては、下落しました。

(外国リート市況)

外国リート市場は全体で見ると上昇しました。2024年7月から9月にかけて、FOMCで0.5%の利下げが決定されたことなどから、上昇しました。10月は、堅調な米経済指標の発表を受けて、米国金利が大きく上昇し、下落基調の動きとなりました。その後は、地政学リスクを背景とした、安全資産とされる米国債に資金流入が進んだことや、トランプ氏が次期財務長官として指名したベッセント氏による経済政策への期待などをを受けて、米国長期金利が低下したことで、上昇基調の動きで推移し、当作成期を通じては、上昇しました。

(外国為替市況)

主な為替市場の動き（対円）について、米ドルにおいては、2024年7月の動きとして、当初上昇していましたが、米CPIの結果や、日銀が米ドル売り介入を実施したことなどを受け、急落しました。8月から9月にかけては、米雇用統計が市場予想を上回るペースでの労働市場の悪化を示唆し、日米欧株価が大幅に下落したことや、米国金利の大幅利下げ観測が高まったことなどが原因で急落する場面はあったものの、日米欧株価の反発や、パウエルFRB議長の発言を受けて上昇する場面もありました。その後は、米国景気のソフトランディング（経済の軟着陸）期待が高まったことや、トランプ氏の経済政策等を背景に上昇し、当作成期を通じては、対円で下落しました。

ユーロにおいては、2024年7月から8月にかけて、ECB理事会が政策金利を据え置くとの見方から上昇したものの、米雇用統計の悪化を受けた日米欧株価の歴史的な急落により急速に下落するなど、激しい展開となりました。9月は、ECBが0.25%の利下げを実施したものの、その後の利下げの示唆がない一方で、米国金利の大幅利下げが開始されたことから、ユーロ米ドルが上昇し、それを受けてユーロ円も買いが優勢となりました。その後は、米ドル円の上昇に連れてユーロ円も上昇する局面などがある一方で、ユーロ圏景気の減速を

示唆する経済指標が散見され、ECBの追加利下げが予想されるなど、ユーロの下押し圧力となる事情もあったことから、一進一退で推移し、当作成期を通じては、対円で下落しました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

当ファンドでは、長期運用に適した6つの異なる資産（国内株式・外国株式・国内債券・外国債券・国内不動産投資信託・外国不動産投資信託）を投資対象とし、それぞれの資産の組入比率がおおむね6分の1ずつとなるように調整しています。

各資産に対する投資は、マザーファンドの受益証券への投資を通じて行いました。それぞれのマザーファンドの運用経過は、以下のとおりです。

国内株式

●しんきん好配当利回り株マザーファンド

ファンドの運用方針に従い、①予想配当利回り、②企業業績、③時価総額、④財務の健全性の4項目により投資対象銘柄を絞り込み、個別銘柄の入替えなどを必要に応じて実施しました。当作成期末時点の組入銘柄数は86銘柄、保有銘柄の予想平均配当利回りは3.46%（時価加重ベース。日経予想・会社予想より、しんきんアセットマネジメント投信算出）となっています。株式の組入比率は99.4%となっています。

外国株式

●しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

日本を除く世界各国の株式に投資することにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用しました。当作成期末時点の組入銘柄数は46銘柄で、各地域への投資比率については、欧州地域が66.0%と最大であり、次に北米地域が32.3%となっています。なお、2024年11月末時点の保有銘柄の予想平均配当利回りは5.30%となっています。株式の組入比率は、おおむね90%以上の高位を維持しています。

国内債券

●しんきん国内債券マザーファンドⅡ

ファンドの修正デュレーション（金利感応度）は、ベンチマーク対比でおおむね中立となるよう調整し、調整範囲はベンチマーク対比で $\Delta 0.30 \sim +0.30$ 年程度としました。債券種別構成は、国債を中心とし、国債以外の債券の構成比率がベンチマーク対比でおおむね中立となるよう調整しました。当作成期末時点のファンドの修正デュレーションは8.78年、最終利回りは1.14%、国内債券の組入比率は99.1%となっています。

外国債券

●しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

ドイツ、フランス、スペイン、イタリア、オランダ、オーストリア、ベルギー、フィンランド、アイルランドおよびポルトガルの各国国債などでポートフォリオを構成しています。ファンドの修正デュレーションは、各国国債インデックスに対して中立を基本とし機動的に調整しました。当作成期末時点の修正デュレーションは7.26年、最終利回りは2.55%、外国債券の組入比率は98.5%となっています。

●しんきん米国ソブリン債マザーファンド

米国国債に加え、国際機関債でポートフォリオを構成しています。ファンドの修正デュレーションは、ベンチマークに対して中立を基本とし機動的に調整しました。当作成期末時点の修正デュレーションは5.90年、最終利回りは4.32%、外国債券の組入比率は99.1%となっています。

●しんきん高格付外国債券マザーファンド

英国、カナダ、オーストラリアおよびノルウェーの各国国債等でポートフォリオを構成しています。国別配分は、それぞれ25%（±5%）の範囲で調整しました。修正デュレーションの調整範囲は、英国6.0年（±2年）、カナダ6.0年（±2年）、オーストラリア4.5年（±2年）、ノルウェー5.0年（±2年）で行いました。当作成期末時点のファンドの修正デュレーションは4.88年、最終利回りは3.60%、外国債券の組入比率は99.0%となっています。国別修正デュレーション（債券部分）等については以下のとおりです。

| | 英国 | カナダ | オーストラリア | ノルウェー |
|--------------|------|------|---------|-------|
| 修正デュレーション（年） | 5.20 | 5.47 | 4.41 | 4.42 |
| 最終利回り（%） | 4.02 | 2.94 | 3.89 | 3.56 |

国内不動産投資信託

●しんきんJリートマザーファンドⅡ

銘柄選定にあたっては、①財務の健全性、②収益性および分配金利回り、③流動性および価格水準に着目し、各銘柄の比率は、時価総額比率をベースに調整しました。当作成期末時点の組入銘柄数は38銘柄としています。なお、予想分配金利回りは4.95%、組入比率は99.0%となっています。

外国不動産投資信託

●しんきんグローバルリートマザーファンド

S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して、日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資を行いました。当作成期末時点の組入銘柄数は290銘柄で、各国への投資比率については、リート市場が世界最大規模である米国に対して79.6%、次に規模が大きなオーストラリアで7.2%、その他の欧州・アジアで12.7%となっており、これらの国々における銘柄に幅広く分散投資しています。また、指数ベースで見た2024年11月末時点での平均配当利回りは3.81%となっています。組入比率については、おおむね99%以上の高位を維持しています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当ファンドは、6つの異なる資産（国内株式・外国株式・国内債券・外国債券・国内不動産投資信託・外国不動産投資信託）に分散投資を行うことで、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指していますが、特定の指数を上回る、または連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指標はありません。

<分配金>

収益分配金については、経費控除後の配当等収益や基準価額水準等を勘案して、各期20円（それぞれ1万口当たり、税込み）とし、当作成期の合計は120円としました。なお、収益分配に充当しなかった部分については、信託財産中に留保し、基本方針に基づき運用を行います。

分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項 目 | 第215期 | 第216期 | 第217期 | 第218期 | 第219期 | 第220期 |
|--------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2024年6月13日～ 2024年7月12日 | 2024年7月13日～ 2024年8月13日 | 2024年8月14日～ 2024年9月12日 | 2024年9月13日～ 2024年10月15日 | 2024年10月16日～ 2024年11月12日 | 2024年11月13日～ 2024年12月12日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 20 0.188% | 20 0.198% | 20 0.196% | 20 0.191% | 20 0.191% | 20 0.193% |
| 当期の収益 | 20 | 7 | 20 | 20 | 10 | 15 |
| 当期の収益以外 | — | 12 | — | — | 9 | 4 |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,622 | 2,610 | 2,612 | 2,634 | 2,625 | 2,621 |

(注1) 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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

＜今後の運用方針＞

引き続き、6つの異なる資産（国内株式・外国株式・国内債券・外国債券・国内不動産投資信託・外国不動産投資信託）の組入比率がおおむね6分の1ずつになるよう、マザーファンドの受益証券へ投資し、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

各マザーファンドの運用方針は、以下のとおりです。

国内株式

●しんきん好配当利回り株マザーファンド

主として、予想配当利回りが市場平均を上回ると期待できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用を行います。

外国株式

●しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

日本を除く世界各国の配当利回りの高い企業の株式へ分散投資を行うことにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用を行います。

国内債券

●しんきん国内債券マザーファンドⅡ

「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとし、主として我が国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

外国債券

●しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

主として、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資し、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

●しんきん米国ソブリン債マザーファンド

主として、米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資し、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

●しんきん高格付外国債券マザーファンド

日本、米国、EMU参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とし、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

国内不動産投資信託

●しんきんJリートマザーファンドⅡ

我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。運用にあたっては、「東証REIT指数（配当込み）」をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果を目指して運用を行います。

外国不動産投資信託

●しんきんグローバルリートマザーファンド

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年6月13日～2024年12月12日)

| 項 目 | 第215期～第220期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------------|-------------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 60 | % 0.579 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (28) | (0.265) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (29) | (0.276) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ） | (4) | (0.039) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 1 | 0.008 | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 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 ） | (1) | (0.005) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.003) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 1 | 0.011 | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 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 |
| （ 株 式 ） | (1) | (0.008) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.003) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 4 | 0.040 | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (4) | (0.035) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の 送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.003) | 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要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 66 | 0.638 | |
| 作成期間の平均基準価額は、10,415円です。 | | | |

(注1) 作成期間の費用（消費税等の掛かるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

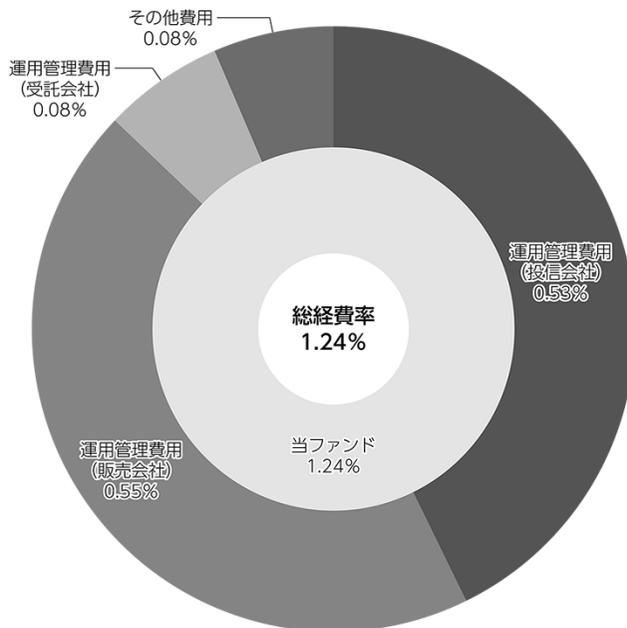
(注3) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

(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（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除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.24%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当た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) 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) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2024年6月13日～2024年12月12日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第215期～第220期 | | | |
|----------------------|-------------|----|---------|---------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド | — | — | 44,504 | 187,000 |
| しんきん世界好配当利回り株マザーファンド | — | — | 22,307 | 105,000 |
| しんきん欧州ソブリン債マザーファンド | — | — | 23,219 | 42,000 |
| しんきん米国ソブリン債マザーファンド | — | — | 26,904 | 60,000 |
| しんきん高格付外国債券マザーファンド | — | — | 16,539 | 27,000 |
| しんきんグローバルリートマザーファンド | — | — | 156,137 | 459,000 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2024年6月13日～2024年12月12日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 第215期～第220期 | |
|----------------------|--------------------|----------------------|
| | しんきん好配当利回り株マザーファンド | しんきん世界好配当利回り株マザーファンド |
| (a) 当作成期中の株式売買金額 | 10,185,779千円 | 16,285,095千円 |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 35,277,149千円 | 30,696,058千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.28 | 0.53 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2024年6月13日～2024年12月12日)

該当事項はございません。

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す。

○第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

(2024年6月13日～2024年12月12日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年6月13日～2024年12月12日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年12月12日現在)

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|----------------------|---|-----------|-----------|--------|-----------|
| | | 口数 | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 | 千円 |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド | | 824,291 | 779,786 | | 3,301,773 |
| しんきん世界好配当利回り株マザーファンド | | 724,001 | 701,694 | | 3,269,894 |
| しんきん国内債券マザーファンドⅡ | | 2,586,271 | 2,586,271 | | 3,220,424 |
| しんきん欧州ソブリン債マザーファンド | | 621,491 | 598,272 | | 1,099,206 |
| しんきん米国ソブリン債マザーファンド | | 509,343 | 482,439 | | 1,098,225 |
| しんきん高格付外国債券マザーファンド | | 703,265 | 686,725 | | 1,109,680 |
| しんきんJリートマザーファンドⅡ | | 1,205,510 | 1,205,510 | | 3,158,559 |
| しんきんグローバルリートマザーファンド | | 1,231,651 | 1,075,514 | | 3,257,196 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年12月12日現在)

| 項目 | 第220期末 | |
|----------------------|------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド | 3,301,773 | 16.7 |
| しんきん世界好配当利回り株マザーファンド | 3,269,894 | 16.6 |
| しんきん国内債券マザーファンドⅡ | 3,220,424 | 16.3 |
| しんきん欧州ソブリン債マザーファンド | 1,099,206 | 5.6 |
| しんきん米国ソブリン債マザーファンド | 1,098,225 | 5.6 |
| しんきん高格付外国債券マザーファンド | 1,109,680 | 5.6 |
| しんきんJリートマザーファンドⅡ | 3,158,559 | 16.0 |
| しんきんグローバルリートマザーファンド | 3,257,196 | 16.5 |
| コール・ローン等、その他 | 236,802 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 19,751,759 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) しんきん世界好配当利回り株マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (30,804,380千円) の投資信託財産総額 (31,010,943千円) に対する比率は99.3%です。

(注3) しんきん欧州ソブリン債マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (13,398,929千円) の投資信託財産総額 (13,676,245千円) に対する比率は98.0%です。

(注4) しんきん米国ソブリン債マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (13,472,728千円) の投資信託財産総額 (13,515,891千円) に対する比率は99.7%です。

(注5) しんきん高格付外国債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (2,671,899千円) の投資信託財産総額 (2,685,704千円) に対する比率は99.5%です。

(注6) しんきんグローバルリートマザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産 (5,531,492千円) の投資信託財産総額 (5,553,435千円) に対する比率は99.6%です。

(注7) 外貨建資産は、当作成期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年12月12日現在、1ドル=152.40円、1カナダドル=107.75円、1ユーロ=160.08円、1ポンド=194.54円、1スイスフラン=172.40円、1ノルウェークローネ=13.69円、1オーストラリアドル=97.58円、1ニュージーランドドル=88.38円、1香港ドル=19.60円、1シンガポールドル=113.45円、100ウォン=10.66円、1イスラエル・シェケル=42.63円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第215期末 | 第216期末 | 第217期末 | 第218期末 | 第219期末 | 第220期末 |
|---------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|
| | 2024年7月12日現在 | 2024年8月13日現在 | 2024年9月12日現在 | 2024年10月15日現在 | 2024年11月12日現在 | 2024年12月12日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 20,770,530,200 | 19,590,681,483 | 19,774,133,121 | 20,149,103,601 | 20,117,544,654 | 19,751,759,283 |
| コール・ローン等 | 36,661,545 | 48,700,736 | 135,924,708 | 153,014,606 | 143,207,830 | 166,797,398 |
| しんきん好配当利回り株マザーファンド(評価額) | 3,474,247,207 | 3,138,628,299 | 3,195,996,282 | 3,360,321,523 | 3,361,796,199 | 3,301,773,946 |
| しんきん世界好配当利回り株マザーファンド(評価額) | 3,489,326,275 | 3,181,480,745 | 3,184,521,552 | 3,409,975,315 | 3,328,767,058 | 3,269,894,916 |
| しんきん国内債券マザーファンドII(評価額) | 3,208,528,148 | 3,251,977,506 | 3,250,942,997 | 3,233,614,980 | 3,220,942,250 | 3,220,424,996 |
| しんきん欧州ソブリン債マザーファンド(評価額) | 1,182,201,133 | 1,097,597,673 | 1,086,918,278 | 1,119,810,814 | 1,125,913,325 | 1,099,206,005 |
| しんきん米国ソブリン債マザーファンド(評価額) | 1,191,304,248 | 1,096,250,022 | 1,083,710,405 | 1,110,226,987 | 1,131,836,762 | 1,098,225,944 |
| しんきん高格付外国債券マザーファンド(評価額) | 1,190,559,406 | 1,099,229,315 | 1,091,696,561 | 1,123,831,707 | 1,129,567,657 | 1,109,680,082 |
| しんきんJリートマザーファンドII(評価額) | 3,280,677,346 | 3,244,150,366 | 3,336,371,950 | 3,234,385,728 | 3,229,443,133 | 3,158,559,093 |
| しんきんグローバルリートマザーファンド(評価額) | 3,547,024,882 | 3,262,666,581 | 3,408,049,532 | 3,403,921,271 | 3,386,069,813 | 3,257,196,172 |
| 未収入金 | 170,000,000 | 170,000,000 | — | — | 60,000,000 | 70,000,000 |
| 未収利息 | 10 | 240 | 856 | 670 | 627 | 731 |
| (B) 負債 | 80,364,711 | 71,183,307 | 62,166,851 | 71,988,124 | 75,520,085 | 83,226,375 |
| 未払収益分配金 | 38,880,553 | 38,707,256 | 38,675,859 | 38,496,038 | 38,328,147 | 38,119,642 |
| 未払解約金 | 21,936,739 | 12,001,867 | 4,489,296 | 12,500,287 | 19,313,240 | 26,199,621 |
| 未払信託報酬 | 19,437,419 | 20,364,184 | 18,893,745 | 20,881,799 | 17,777,124 | 18,799,697 |
| その他未払費用 | 110,000 | 110,000 | 107,951 | 110,000 | 101,574 | 107,415 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 20,690,165,489 | 19,519,498,176 | 19,711,966,270 | 20,077,115,477 | 20,042,024,569 | 19,668,532,908 |
| 元本 | 19,440,276,756 | 19,353,628,163 | 19,337,929,655 | 19,248,019,118 | 19,164,073,702 | 19,059,821,400 |
| 次期繰越損益金 | 1,249,888,733 | 165,870,013 | 374,036,615 | 829,096,359 | 877,950,867 | 608,711,508 |
| (D) 受益権総口数 | 19,440,276,756口 | 19,353,628,163口 | 19,337,929,655口 | 19,248,019,118口 | 19,164,073,702口 | 19,059,821,400口 |
| 1万円当たり基準価額(C/D) | 10,643円 | 10,086円 | 10,193円 | 10,431円 | 10,458円 | 10,319円 |

(注1) 当ファンドの第215期首元本額は19,542,783,847円、当作成期中(第215期～第220期)における追加設定元本額は621,186,271円、一部解約元本額は1,104,148,718円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第215期1.0643円、第216期1.0086円、第217期1.0193円、第218期1.0431円、第219期1.0458円、第220期1.0319円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第215期 | 第216期 | 第217期 | 第218期 | 第219期 | 第220期 |
|------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 2024年6月13日～ 2024年7月12日 | 2024年7月13日～ 2024年8月13日 | 2024年8月14日～ 2024年9月12日 | 2024年9月13日～ 2024年10月15日 | 2024年10月16日～ 2024年11月12日 | 2024年11月13日～ 2024年12月12日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | 833 | 3,579 | 28,108 | 16,160 | 14,522 | 16,623 |
| 受取利息 | 833 | 3,579 | 28,108 | 16,160 | 14,522 | 16,623 |
| (B) 有価証券売買損益 | 612,098,739 | △1,017,760,833 | 264,257,596 | 514,543,082 | 107,928,562 | △206,972,016 |
| 売買益 | 626,233,613 | 47,885,214 | 298,013,325 | 637,208,736 | 132,247,302 | 44,701,941 |
| 売買損 | △14,134,874 | △1,065,646,047 | △33,755,729 | △122,665,654 | △24,318,740 | △251,673,957 |
| (C) 信託報酬等 | △19,547,419 | △20,474,184 | △19,001,696 | △20,991,799 | △17,878,698 | △18,907,112 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 592,552,153 | △1,038,231,438 | 245,284,008 | 493,567,443 | 90,064,386 | △225,862,505 |
| (E) 前期繰越損益金 | 3,163,520,065 | 3,685,335,995 | 2,594,020,858 | 2,775,432,788 | 3,198,101,315 | 3,213,676,385 |
| (F) 追加信託差損益金 | △2,467,302,932 | △2,442,527,288 | △2,426,592,392 | △2,401,407,834 | △2,371,886,687 | △2,340,982,730 |
| (配当等相当額) | (1,380,508,600) | (1,390,344,567) | (1,406,928,103) | (1,417,019,023) | (1,432,403,690) | (1,445,910,427) |
| (売買損益相当額) | (△3,847,811,532) | (△3,832,871,855) | (△3,833,520,495) | (△3,818,426,857) | (△3,804,290,377) | (△3,786,893,157) |
| (G) 計(D+E+F) | 1,288,769,286 | 204,577,269 | 412,712,474 | 867,592,397 | 916,279,014 | 646,831,150 |
| (H) 収益分配金 | △38,880,553 | △38,707,256 | △38,675,859 | △38,496,038 | △38,328,147 | △38,119,642 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 1,249,888,733 | 165,870,013 | 374,036,615 | 829,096,359 | 877,950,867 | 608,711,508 |
| 追加信託差損益金 | △2,467,302,932 | △2,442,527,288 | △2,426,592,392 | △2,401,407,834 | △2,371,886,687 | △2,340,982,730 |
| (配当等相当額) | (1,380,688,735) | (1,390,415,674) | (1,407,062,690) | (1,417,193,719) | (1,432,488,730) | (1,446,038,056) |
| (売買損益相当額) | (△3,847,991,667) | (△3,832,942,962) | (△3,833,655,082) | (△3,818,601,553) | (△3,804,375,417) | (△3,787,020,786) |
| 分配準備積立金 | 3,717,191,665 | 3,661,101,911 | 3,645,214,033 | 3,653,154,567 | 3,599,146,590 | 3,549,711,562 |
| 繰越損益金 | - | △1,052,704,610 | △844,585,026 | △422,650,374 | △349,309,036 | △600,017,324 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)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います。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用として、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年1万分の50の率を乗じて得た金額を委託者報酬の中から支弁しています。信託財産の運用指図に係る権限の一部を委託するために要した費用として、「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年1万分の50の率を乗じて得た金額を委託者報酬の中から支弁しています。

<分配金の計算過程>

第215期計算期間末における費用控除後の配当等収益(57,862,741円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(346,116,262円)、信託約款に規定する収益調整金(1,380,688,735円)および分配準備積立金(3,352,093,215円)より分配対象収益は5,136,760,953円(10,000口当たり2,642円)であり、うち38,880,553円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

第216期計算期間末における費用控除後の配当等収益(14,473,172円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,390,415,674円)および分配準備積立金(3,685,335,995円)より分配対象収益は5,090,224,841円(10,000口当たり2,630円)であり、うち38,707,256円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

第217期計算期間末における費用控除後の配当等収益(43,090,453円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,407,062,690円)および分配準備積立金(3,640,799,439円)より分配対象収益は5,090,952,582円(10,000口当たり2,632円)であり、うち38,675,859円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

第218期計算期間末における費用控除後の配当等収益(79,382,221円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,417,193,719円)および分配準備積立金(3,612,268,384円)より分配対象収益は5,108,844,324円(10,000口当たり2,654円)であり、うち38,496,038円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

第219期計算期間末における費用控除後の配当等収益(21,040,987円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,432,488,730円)および分配準備積立金(3,616,433,750円)より分配対象収益は5,069,963,467円(10,000口当たり2,645円)であり、うち38,328,147円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

第220期計算期間末における費用控除後の配当等収益(28,804,779円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,446,038,056円)および分配準備積立金(3,559,026,425円)より分配対象収益は5,033,869,260円(10,000口当たり2,641円)であり、うち38,119,642円(10,000口当たり20円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

| | 第215期 | 第216期 | 第217期 | 第218期 | 第219期 | 第220期 |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 | 20円 |

◇分配金を再投資される場合のお手取分配金は、自動けいぞく投資約款の規定に基づき、各決算日の翌営業日に再投資いたしました。

◇分配金をお受け取りになる場合の分配金は、各決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しています。

◇分配金のお取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

(注1) 分配金は、分配後の基準価額と各受益者の個別元本との差により、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)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額が「普通分配金」となります。分配後の基準価額を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が「元本払戻金(特別分配金)」、残りの部分が「普通分配金」となります。

(注2) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に各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、その後の各受益者の個別元本となります。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2024年12月12日現在）

<しんきん好配当利回り株マザーファンド>

下記は、しんきん好配当利回り株マザーファンド全体(8,438,055千口)の内容です。

国内株式

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|---------------|--------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業（－%） | | | | |
| ホクト | 208.9 | — | — | — |
| 鉱業（1.1%） | | | | |
| INPEX | 169.4 | 204.5 | 405,216 | |
| 建設業（2.4%） | | | | |
| 大林組 | 222.9 | 204.7 | 434,373 | |
| 積水ハウス | 109.4 | 113.6 | 414,867 | |
| 食料品（3.4%） | | | | |
| 明治ホールディングス | — | 117.2 | 379,259 | |
| 雪印メグミルク | — | 151 | 417,968 | |
| キリンホールディングス | 172.2 | 196.8 | 418,200 | |
| 繊維製品（－%） | | | | |
| 帝人 | 215.7 | — | — | — |
| 化学（6.0%） | | | | |
| クラレ | 223.9 | 205.9 | 480,570 | |
| 三菱ケミカルグループ | 463.1 | 469.2 | 372,920 | |
| 三洋化成工業 | 97 | 102.7 | 422,097 | |
| 太陽ホールディングス | 124.8 | 105.2 | 425,008 | |
| マンダム | 259.2 | — | — | — |
| 日東電工 | 32.6 | 165.5 | 417,639 | |
| 医薬品（4.5%） | | | | |
| 武田薬品工業 | 92.3 | 99.4 | 412,211 | |
| アステラス製薬 | 258.1 | 239.4 | 378,611 | |
| 参天製薬 | 252.3 | 236.5 | 397,083 | |
| ツムラ | — | 87.9 | 424,029 | |
| 大塚ホールディングス | 59.1 | — | — | — |
| 石油・石炭製品（2.4%） | | | | |
| 出光興産 | 377.8 | 400.9 | 419,341 | |
| ENEOSホールディングス | 510.5 | 510.5 | 422,438 | |
| ゴム製品（2.2%） | | | | |
| 横浜ゴム | 103.4 | 123.4 | 392,165 | |
| ブリヂストン | 57.6 | 72.1 | 387,898 | |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|----------------|--------|-------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ガラス・土石製品（1.1%） | | | | |
| AGC | 71.2 | 85.5 | 402,192 | |
| 鉄鋼（2.3%） | | | | |
| 日本製鉄 | 114.1 | 125.7 | 385,396 | |
| 丸一鋼管 | 102.9 | 116.7 | 415,452 | |
| 非鉄金属（2.3%） | | | | |
| 三井金属鉱業 | 81.1 | 84.1 | 403,595 | |
| 住友電気工業 | 152.2 | 145.8 | 423,476 | |
| 金属製品（2.4%） | | | | |
| 三和ホールディングス | 140.1 | 94.1 | 428,343 | |
| LIXIL | 225.8 | 249.6 | 436,550 | |
| 機械（6.8%） | | | | |
| アマダ | 231.7 | 274.7 | 407,105 | |
| 小松製作所 | 85.4 | 99.4 | 422,748 | |
| SANKYO | 232 | — | — | — |
| マックス | 108.3 | 112.6 | 378,899 | |
| 日本精工 | 516.7 | 553.7 | 376,017 | |
| 三菱重工業 | 286.5 | 183.1 | 437,609 | |
| スター精密 | 193.6 | 203.2 | 385,064 | |
| 電気機器（11.2%） | | | | |
| 日清紡ホールディングス | 359.3 | 405.8 | 360,106 | |
| 三菱電機 | 140.4 | 149.9 | 404,505 | |
| マブチモーター | 161.1 | 180.2 | 405,540 | |
| 日東工業 | 115.7 | 124.4 | 354,664 | |
| IDEC | 141.7 | 146.1 | 354,876 | |
| パナソニックホールディングス | 285 | 295.9 | 466,634 | |
| カシオ計算機 | 328.5 | 353.6 | 445,005 | |
| SCREENホールディングス | 23.8 | 37.8 | 364,089 | |
| キャノン | 89.5 | 85 | 430,525 | |
| 東京エレクトロン | 11.4 | 15.6 | 384,150 | |
| 輸送用機器（8.1%） | | | | |
| デンソー | 154.2 | 188.7 | 410,611 | |
| いすゞ自動車 | 195.1 | 203.1 | 428,134 | |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|------------------------|---------|---------|---------|-----|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| トヨタ自動車 | 117 | 154.8 | 420,823 | |
| アイシン | 67.6 | 249.7 | 437,099 | |
| 本田技研工業 | 228.2 | 257.7 | 335,010 | |
| S U B A R U | 114.6 | 158.5 | 396,487 | |
| ヤマハ発動機 | — | 322.6 | 447,607 | |
| 精密機器 (1.1%) | | | | |
| ニコン | 241.1 | 238.3 | 404,514 | |
| その他製品 (2.4%) | | | | |
| 任天堂 | 47.3 | 47.1 | 430,446 | |
| オカムラ | — | 202.2 | 410,668 | |
| 電気・ガス業 (2.2%) | | | | |
| 中部電力 | 198.3 | 238.1 | 386,674 | |
| 大阪瓦斯 | 108.5 | 124 | 405,232 | |
| 陸運業 (2.4%) | | | | |
| 九州旅客鉄道 | 115.4 | 107 | 434,420 | |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 50.9 | 55.9 | 432,386 | |
| 倉庫・運輸関連業 (1.3%) | | | | |
| 住友倉庫 | 151.6 | 157 | 441,798 | |
| 情報・通信業 (6.1%) | | | | |
| B I P R O G Y | 95.3 | 89 | 416,253 | |
| 日本テレビホールディングス | 174.9 | — | — | |
| 日本電信電話 | 2,531.4 | 2,745.1 | 428,235 | |
| ソフトバンク | 207.4 | 2,166.5 | 436,333 | |
| S C S K | 133.4 | 133.4 | 433,283 | |
| T K C | 118.8 | 114.3 | 458,343 | |
| 卸売業 (4.7%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 55.4 | 55.4 | 433,228 | |
| 三井物産 | 52.2 | 121.9 | 400,563 | |
| 住友商事 | 96.3 | 123.1 | 413,739 | |
| サンゲツ | 129 | 143.8 | 405,947 | |
| 因幡電機産業 | 106.1 | — | — | |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|---------------------------|---------|--------|---------|------------|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 小売業 (4.7%) | | | | |
| 日本瓦斯 | 164.8 | 178.6 | 380,418 | |
| 丸井グループ | — | 170.1 | 435,285 | |
| ヤマダホールディングス | 886 | 938.7 | 426,639 | |
| サンドラッグ | 95.8 | 102.7 | 412,854 | |
| 銀行業 (6.0%) | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 253.7 | 236.2 | 437,324 | |
| りそなホールディングス | 395.4 | 337.2 | 408,180 | |
| 三井住友トラストグループ | 113.5 | 113.8 | 434,602 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 39.9 | 113.1 | 430,571 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 131.9 | 111.4 | 428,555 | |
| 証券・商品先物取引業 (2.4%) | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 330.5 | 389.6 | 406,937 | |
| 野村ホールディングス | 435.7 | 466.6 | 430,485 | |
| 保険業 (3.6%) | | | | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 129.7 | 121.7 | 420,351 | |
| 東京海上ホールディングス | 72.7 | 73.9 | 424,629 | |
| T & Dホールディングス | 149 | 152.2 | 430,573 | |
| 不動産業 (2.3%) | | | | |
| 大東建託 | 23 | 24 | 433,320 | |
| 野村不動産ホールディングス | 93 | 103 | 385,632 | |
| サービス業 (4.6%) | | | | |
| H. U. グループホールディングス | 159.4 | 162.5 | 418,437 | |
| ユー・エス・エス | 310 | 310 | 423,770 | |
| 日本郵政 | 264.7 | 280.5 | 433,793 | |
| メイテックグループホールディングス | 133 | 128.1 | 369,184 | |
| 合 計 | 株数・金額 | 17,879 | 20,840 | 35,513,832 |
| | 銘柄数<比率> | 87 | 86 | <99.4%> |

(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) 評価額欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の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り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

<しんきん世界好配当利回り株マザーファンド>

下記は、しんきん世界好配当利回り株マザーファンド全体(6,642,104千口)の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 株数 | 第220期末 | | | | 業種等 |
|------------------------------|---------|--------|--------|-----------|------------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千ドル | 千円 | | |
| BEST BUY CO INC | 501 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 1,097 | 849 | 4,815 | 733,818 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CITIGROUP INC | 703 | — | — | — | 銀行 | |
| EBAY INC | 836 | — | — | — | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| HP INC | 1,372 | 1,208 | 4,174 | 636,268 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 153 | — | — | — | ソフトウェア・サービス | |
| INTEL CORP | 676 | 1,290 | 2,596 | 395,765 | 半導体・半導体製造装置 | |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 1,374 | 1,801 | 5,637 | 859,148 | 食品・飲料・タバコ | |
| LEAR CORP | — | 295 | 3,011 | 458,879 | 自動車・自動車部品 | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | — | 460 | 3,523 | 536,982 | 素材 | |
| MANPOWER INC | 632 | 706 | 4,308 | 656,679 | 商業・専門サービス | |
| MARCUS & MILLICHAP INC | 785 | 877 | 3,639 | 554,651 | 不動産管理・開発 | |
| PFIZER INC | 2,090 | 2,334 | 5,889 | 897,585 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 589 | 402 | 3,372 | 513,999 | 資本財 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 793 | 1,067 | 6,555 | 998,988 | 食品・飲料・タバコ | |
| VIATRIS INC | 2,469 | 1,854 | 2,364 | 360,380 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 1,555 | 1,565 | 6,572 | 1,001,678 | 電気通信サービス | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,888 | 2,891 | 2,845 | 433,606 | 生活必需品流通・小売り | |
| WILEY (JOHN) & SONS-CLASS A | 672 | 576 | 2,682 | 408,810 | メディア・娯楽 | |
| WESTERN UNION CO | 2,891 | 3,229 | 3,510 | 535,036 | 金融サービス | |
| 小計 | 株数・金額 | 21,083 | 21,413 | 65,500 | 9,982,278 | |
| | 銘柄数<比率> | 18 | 16 | — | <32.3%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| BASF SE | 1,053 | 1,177 | 5,283 | 845,790 | 素材 | |
| BAYER AG | 1,205 | 1,492 | 2,984 | 477,781 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CONTINENTAL AG | 946 | 1,057 | 7,012 | 1,122,578 | 自動車・自動車部品 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 551 | 663 | 5,694 | 911,540 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| RTL GROUP S.A. | 1,178 | 1,316 | 3,554 | 568,977 | メディア・娯楽 | |
| Schaeffler AG Preference NPV | 6,712 | — | — | — | 自動車・自動車部品 | |
| SCHAEFFLER AG | — | 2,885 | 1,300 | 208,118 | 自動車・自動車部品 | |
| VOLKSWAGEN AG | — | 237 | 2,043 | 327,095 | 自動車・自動車部品 | |
| 小計 | 株数・金額 | 11,648 | 8,829 | 27,872 | 4,461,882 | |
| | 銘柄数<比率> | 6 | 7 | — | <14.4%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| ENI SPA | 2,355 | 3,165 | 4,233 | 677,741 | エネルギー | |
| INTESA SANPAOLOA | 10,179 | 11,369 | 4,383 | 701,683 | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 | 12,535 | 14,534 | 8,617 | 1,379,424 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | — | <4.5%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| BNP PARIBAS | — | 478 | 2,854 | 456,897 | 銀行 | |

| 銘柄 | 株数 | 第220期末 | | | | 業種等 |
|-------------------------------|------------------|---------------|---------------|-------------|------------------------|-----|
| | | 株数 | 評価額 | | 業種等 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| CARREFOUR SA | — | 2,952 | 4,149 | 664,209 | 生活必需品流通・小売り | |
| AXA SA | 1,089 | 1,216 | 4,096 | 655,734 | 保険 | |
| SOCIETE GENERALE | — | 1,164 | 3,124 | 500,219 | 銀行 | |
| ORANGE | 4,584 | 4,540 | 4,337 | 694,274 | 電気通信サービス | |
| SANOFI | 410 | 458 | 4,186 | 670,125 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| SES GLOBAL-FDR | 4,144 | 4,628 | 1,476 | 236,375 | メディア・娯楽 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 10,228 4 | 15,440 7 | 24,224 — | 3,877,836 <12.5%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 1,314 | 1,760 | 5,648 | 904,209 | 生活必需品流通・小売り | |
| ING GROEP NV | 2,272 | — | — | — | 銀行 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,587 2 | 1,760 1 | 5,648 — | 904,209 <2.9%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| REPSOL SA | 2,670 | 3,823 | 4,337 | 694,415 | エネルギー | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 2,670 1 | 3,823 1 | 4,337 — | 694,415 <2.2%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| AGEAS | 1,060 | 800 | 3,780 | 605,149 | 保険 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,060 1 | 800 1 | 3,780 — | 605,149 <2.0%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 41,731 16 | 45,189 19 | 74,481 — | 11,922,919 <38.5%> | |
| (イギリス) | | | 千ポンド | | | |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,699 | 1,898 | 4,840 | 941,608 | 素材 | |
| BT GROUP PLC | 42,053 | 36,234 | 5,507 | 1,071,461 | 電気通信サービス | |
| GSK PLC | 2,132 | 3,547 | 4,755 | 925,187 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| ITV PLC | 51,212 | 57,195 | 4,198 | 816,708 | メディア・娯楽 | |
| NATWEST GROUP PLC | 12,343 | 6,993 | 2,862 | 556,819 | 銀行 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 5,083 | 4,082 | 4,037 | 785,392 | 銀行 | |
| TESCO PLC | 10,788 | 7,663 | 2,837 | 551,947 | 生活必需品流通・小売り | |
| VODAFONE GROUP PLC | — | 53,191 | 3,673 | 714,621 | 電気通信サービス | |
| WPP PLC | 4,769 | 5,326 | 4,697 | 913,784 | メディア・娯楽 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 130,081 8 | 176,133 9 | 37,408 — | 7,277,531 <23.5%> | |
| (スイス) | | | 千スイスフラン | | | |
| ADECCO GROUP AG-REG | 810 | 904 | 2,159 | 372,215 | 商業・専門サービス | |
| SWISS RE AG | 296 | — | — | — | 保険 | |
| SWATCH GROUP AG | 217 | 302 | 4,976 | 858,025 | 耐久消費財・アパレル | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,324 3 | 1,207 2 | 7,135 — | 1,230,240 <4.0%> | |
| 合計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 194,221 45 | 243,944 46 | — — | 30,412,971 <98.3%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

＜しんきん国内債券マザーファンドⅡ＞

下記は、しんきん国内債券マザーファンドⅡ全体(7,955,000千円)の内容です。

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第220期末 | | | | | | |
|---------------------|--------------|-------------|---------|--------------------|-----------|--------|--------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちBB格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 8,160,000 | 7,646,669 | 77.2 | — | 59.8 | 11.4 | 6.0 |
| 地方債証券 | 1,100,000 | 1,088,196 | 11.0 | — | 1.0 | 5.0 | 5.0 |
| | (1,100,000) | (1,088,196) | (11.0) | (—) | (1.0) | (5.0) | (5.0) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 300,000 | 297,752 | 3.0 | — | 1.0 | 2.0 | — |
| | (300,000) | (297,752) | (3.0) | (—) | (1.0) | (2.0) | (—) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 800,000 | 784,174 | 7.9 | — | — | 6.9 | 1.0 |
| | (800,000) | (784,174) | (7.9) | (—) | (—) | (6.9) | (1.0) |
| 合 計 | 10,360,000 | 9,816,791 | 99.1 | — | 61.8 | 25.3 | 12.0 |
| | (2,200,000) | (2,170,122) | (21.9) | (—) | (2.0) | (13.9) | (6.0) |

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | 第220期末 | | | |
|-----------------|--------|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | | |
| 第150回利付国債 (20年) | 1.4 | 250,000 | 258,325 | 2034/9/20 |
| 第145回利付国債 (5年) | 0.1 | 100,000 | 99,796 | 2025/9/20 |
| 第147回利付国債 (5年) | 0.005 | 200,000 | 198,778 | 2026/3/20 |
| 第148回利付国債 (5年) | 0.005 | 300,000 | 297,582 | 2026/6/20 |
| 第150回利付国債 (5年) | 0.005 | 150,000 | 148,336 | 2026/12/20 |
| 第154回利付国債 (5年) | 0.1 | 300,000 | 296,034 | 2027/9/20 |
| 第14回利付国債 (40年) | 0.7 | 200,000 | 118,762 | 2061/3/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1 | 300,000 | 296,877 | 2027/3/20 |
| 第354回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 195,190 | 2029/3/20 |
| 第355回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 194,786 | 2029/6/20 |
| 第357回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 194,040 | 2029/12/20 |
| 第360回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 193,076 | 2030/9/20 |
| 第361回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 192,734 | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 192,334 | 2031/3/20 |
| 第363回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 191,862 | 2031/6/20 |
| 第364回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 191,376 | 2031/9/20 |
| 第365回利付国債 (10年) | 0.1 | 200,000 | 190,822 | 2031/12/20 |
| 第376回利付国債 (10年) | 0.9 | 150,000 | 148,071 | 2034/9/20 |

| 銘 | 柄 | 第220期末 | | | |
|---------------------------------------|---|--------|------------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 第32回利付国債 (30年) | | 2.3 | 200,000 | 220,834 | 2040/3/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | | 2.2 | 200,000 | 216,886 | 2041/3/20 |
| 第36回利付国債 (30年) | | 2.0 | 200,000 | 209,406 | 2042/3/20 |
| 第38回利付国債 (30年) | | 1.8 | 150,000 | 151,246 | 2043/3/20 |
| 第42回利付国債 (30年) | | 1.7 | 200,000 | 196,576 | 2044/3/20 |
| 第46回利付国債 (30年) | | 1.5 | 260,000 | 244,246 | 2045/3/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | | 0.8 | 220,000 | 177,564 | 2046/3/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | | 0.8 | 150,000 | 118,971 | 2047/3/20 |
| 第58回利付国債 (30年) | | 0.8 | 170,000 | 132,557 | 2048/3/20 |
| 第62回利付国債 (30年) | | 0.5 | 200,000 | 141,944 | 2049/3/20 |
| 第66回利付国債 (30年) | | 0.4 | 240,000 | 161,704 | 2050/3/20 |
| 第71回利付国債 (30年) | | 0.7 | 200,000 | 142,478 | 2051/6/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | | 1.5 | 200,000 | 209,958 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | | 1.7 | 200,000 | 213,164 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | | 1.7 | 150,000 | 159,817 | 2033/9/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | | 1.5 | 200,000 | 209,278 | 2034/3/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | | 1.2 | 200,000 | 202,124 | 2035/3/20 |
| 第160回利付国債 (20年) | | 0.7 | 100,000 | 93,454 | 2037/3/20 |
| 第161回利付国債 (20年) | | 0.6 | 160,000 | 147,070 | 2037/6/20 |
| 第168回利付国債 (20年) | | 0.4 | 200,000 | 173,028 | 2039/3/20 |
| 第174回利付国債 (20年) | | 0.4 | 200,000 | 167,458 | 2040/9/20 |
| 第180回利付国債 (20年) | | 0.8 | 200,000 | 173,540 | 2042/3/20 |
| 第181回利付国債 (20年) | | 0.9 | 210,000 | 184,581 | 2042/6/20 |
| 小 | 計 | | 8,160,000 | 7,646,669 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 第843回東京都公募公債 | | 0.8 | 100,000 | 98,349 | 2033/6/20 |
| 平成29年度第16回愛知県公募公債 (10年) | | 0.26 | 200,000 | 197,174 | 2028/2/14 |
| 平成28年度第3回埼玉県公募公債 | | 0.08 | 300,000 | 297,606 | 2026/5/25 |
| 平成28年度第6回福岡県公募公債 | | 0.175 | 100,000 | 99,019 | 2026/12/22 |
| 第496回名古屋市公募公債 (10年) | | 0.07 | 200,000 | 198,270 | 2026/6/19 |
| 平成28年度第4回福井県公募公債 | | 0.2 | 200,000 | 197,778 | 2027/4/27 |
| 小 | 計 | | 1,100,000 | 1,088,196 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.216 | 100,000 | 100,376 | 2035/3/30 |
| 第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.155 | 200,000 | 197,376 | 2027/8/31 |
| 小 | 計 | | 300,000 | 297,752 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 第13回日本たばこ産業株式会社社債 (一般担保付) | | 0.355 | 100,000 | 97,781 | 2028/9/8 |
| 第6回ヒューリック株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.494 | 100,000 | 97,706 | 2028/10/20 |
| 第37回王子ホールディングス株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.29 | 100,000 | 96,522 | 2029/7/19 |
| 第9回ココミノルタ株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 1.023 | 100,000 | 98,932 | 2029/3/6 |
| 第14回株式会社ブリヂストン無担保社債 | | 0.375 | 100,000 | 97,296 | 2029/4/19 |
| 第68回株式会社神戸製鋼所無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.545 | 100,000 | 98,102 | 2028/6/8 |
| 第18回バナソニック株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.23 | 100,000 | 99,252 | 2026/3/5 |
| 第15回株式会社デンソー無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.245 | 100,000 | 98,583 | 2027/6/18 |
| 小 | 計 | | 800,000 | 784,174 | |
| 合 | 計 | | 10,360,000 | 9,816,791 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<しんきん欧州ソブリン債マザーファンド>

下記は、しんきん欧州ソブリン債マザーファンド全体(7,296,995千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区分 | 第220期末 | | | | | | | | |
|--------|--------|--------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|--|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 | |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | % | % | % | % | % | |
| ドイツ | 15,900 | 16,525 | 2,645,378 | 19.7 | — | 14.2 | 3.8 | 1.7 | |
| イタリア | 19,250 | 19,862 | 3,179,511 | 23.7 | — | 15.1 | 7.6 | 1.1 | |
| フランス | 19,400 | 19,371 | 3,101,040 | 23.1 | — | 18.3 | 4.8 | — | |
| オランダ | 3,850 | 3,463 | 554,476 | 4.1 | — | 3.5 | 0.7 | — | |
| スペイン | 11,850 | 12,499 | 2,000,986 | 14.9 | — | 10.1 | 3.3 | 1.5 | |
| ベルギー | 4,300 | 4,101 | 656,506 | 4.9 | — | 3.5 | 1.1 | 0.2 | |
| オーストリア | 3,350 | 3,068 | 491,188 | 3.7 | — | 2.5 | 0.8 | 0.4 | |
| フィンランド | 1,000 | 1,038 | 166,226 | 1.2 | — | 1.2 | — | — | |
| アイルランド | 1,000 | 1,016 | 162,686 | 1.2 | — | 1.2 | — | — | |
| ポルトガル | 1,500 | 1,544 | 247,321 | 1.8 | — | 1.8 | — | — | |
| 合計 | 81,400 | 82,492 | 13,205,322 | 98.5 | — | 71.5 | 22.1 | 4.9 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | | 第220期末 | | | | | 償還年月日 |
|---------------------|------|---------------------|--------|---------|----------|---------|------------|-------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | | |
| ドイツ | 国債証券 | DBR 0.000 08/15/31 | — | 2,300 | 2,023 | 323,933 | 2031/8/15 | |
| | | DBR 0.250 02/15/29 | 0.25 | 2,200 | 2,060 | 329,879 | 2029/2/15 | |
| | | DBR 0.500 02/15/26 | 0.5 | 1,450 | 1,424 | 228,029 | 2026/2/15 | |
| | | DBR 1.700 08/15/32 | 1.7 | 2,900 | 2,839 | 454,560 | 2032/8/15 | |
| | | DBR 3.250 07/04/42 | 3.25 | 2,150 | 2,417 | 387,015 | 2042/7/4 | |
| | | DBR 4.000 01/04/37 | 4.0 | 2,600 | 3,072 | 491,841 | 2037/1/4 | |
| | | DBR 4.750 07/04/28 | 4.75 | 1,050 | 1,152 | 184,541 | 2028/7/4 | |
| | | DBR 4.750 07/04/34 | 4.75 | 1,250 | 1,534 | 245,577 | 2034/7/4 | |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 0.950 08/01/30 | 0.95 | 2,200 | 2,006 | 321,270 | 2030/8/1 | |
| | | BTPS 2.000 12/01/25 | 2.0 | 900 | 897 | 143,719 | 2025/12/1 | |
| | | BTPS 2.500 12/01/32 | 2.5 | 1,450 | 1,410 | 225,729 | 2032/12/1 | |
| | | BTPS 2.800 12/01/28 | 2.8 | 2,800 | 2,847 | 455,754 | 2028/12/1 | |
| | | BTPS 2.950 02/15/27 | 2.95 | 1,400 | 1,420 | 227,451 | 2027/2/15 | |
| | | BTPS 3.350 07/01/29 | 3.35 | 2,000 | 2,070 | 331,496 | 2029/7/1 | |
| | | BTPS 3.450 07/15/31 | 3.45 | 2,200 | 2,285 | 365,916 | 2031/7/15 | |
| | | BTPS 3.850 07/01/34 | 3.85 | 2,900 | 3,077 | 492,687 | 2034/7/1 | |
| | | BTPS 4.050 10/30/37 | 4.05 | 1,200 | 1,290 | 206,633 | 2037/10/30 | |
| | | BTPS 4.500 10/01/53 | 4.5 | 600 | 673 | 107,755 | 2053/10/1 | |
| BTPS 5.000 08/01/39 | 5.0 | 1,600 | 1,880 | 301,097 | 2039/8/1 | | | |
| フランス | 国債証券 | FRTR 0.000 11/25/31 | — | 2,500 | 2,089 | 334,463 | 2031/11/25 | |
| | | FRTR 1.000 05/25/27 | 1.0 | 1,300 | 1,264 | 202,433 | 2027/5/25 | |

| 銘柄 | | | 第220期末 | | | | |
|--------|------|-----------------------|--------|-------|-------|------------|------------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | FRTR 1.250 05/25/34 | 1.25 | 1,300 | 1,129 | 180,830 | 2034/5/25 |
| | | FRTR 1.250 05/25/36 | 1.25 | 1,300 | 1,082 | 173,266 | 2036/5/25 |
| | | FRTR 1.500 05/25/31 | 1.5 | 2,500 | 2,343 | 375,147 | 2031/5/25 |
| | | FRTR 2.500 05/25/30 | 2.5 | 700 | 701 | 112,219 | 2030/5/25 |
| | | FRTR 2.750 10/25/27 | 2.75 | 2,700 | 2,741 | 438,810 | 2027/10/25 |
| | | FRTR 3.250 05/25/45 | 3.25 | 1,200 | 1,193 | 191,124 | 2045/5/25 |
| | | FRTR 4.000 10/25/38 | 4.0 | 2,400 | 2,634 | 421,666 | 2038/10/25 |
| | | FRTR 4.500 04/25/41 | 4.5 | 1,100 | 1,278 | 204,741 | 2041/4/25 |
| | | FRTR 5.750 10/25/32 | 5.75 | 2,400 | 2,913 | 466,336 | 2032/10/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHER 0.000 07/15/31 | — | 450 | 390 | 62,563 | 2031/7/15 |
| | | NETHER 0.250 07/15/29 | 0.25 | 300 | 276 | 44,216 | 2029/7/15 |
| | | NETHER 0.500 01/15/40 | 0.5 | 1,300 | 978 | 156,615 | 2040/1/15 |
| | | NETHER 0.750 07/15/27 | 0.75 | 300 | 290 | 46,559 | 2027/7/15 |
| | | NETHER 2.500 01/15/33 | 2.5 | 1,500 | 1,527 | 244,521 | 2033/1/15 |
| スペイン | 国債証券 | SPGB 0.800 07/30/29 | 0.8 | 1,400 | 1,307 | 209,331 | 2029/7/30 |
| | | SPGB 1.500 04/30/27 | 1.5 | 1,450 | 1,429 | 228,879 | 2027/4/30 |
| | | SPGB 1.950 04/30/26 | 1.95 | 1,300 | 1,297 | 207,624 | 2026/4/30 |
| | | SPGB 1.950 07/30/30 | 1.95 | 2,500 | 2,444 | 391,335 | 2030/7/30 |
| | | SPGB 2.350 07/30/33 | 2.35 | 200 | 195 | 31,316 | 2033/7/30 |
| | | SPGB 4.200 01/31/37 | 4.2 | 2,500 | 2,825 | 452,351 | 2037/1/31 |
| | | SPGB 4.700 07/30/41 | 4.7 | 2,500 | 2,999 | 480,147 | 2041/7/30 |
| ベルギー | 国債証券 | BGB 0.800 06/22/25 | 0.8 | 200 | 198 | 31,718 | 2025/6/22 |
| | | BGB 0.800 06/22/27 | 0.8 | 300 | 290 | 46,561 | 2027/6/22 |
| | | BGB 0.900 06/22/29 | 0.9 | 700 | 660 | 105,722 | 2029/6/22 |
| | | BGB 1.600 06/22/47 | 1.6 | 1,300 | 976 | 156,294 | 2047/6/22 |
| | | BGB 3.000 06/22/34 | 3.0 | 1,100 | 1,133 | 181,424 | 2034/6/22 |
| | | BGB 5.000 03/28/35 | 5.0 | 700 | 841 | 134,785 | 2035/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | RAGB 0.000 02/20/31 | — | 250 | 216 | 34,701 | 2031/2/20 |
| | | RAGB 0.500 04/20/27 | 0.5 | 400 | 385 | 61,750 | 2027/4/20 |
| | | RAGB 0.750 02/20/28 | 0.75 | 300 | 287 | 46,015 | 2028/2/20 |
| | | RAGB 1.200 10/20/25 | 1.2 | 300 | 297 | 47,590 | 2025/10/20 |
| | | RAGB 1.500 02/20/47 | 1.5 | 1,000 | 790 | 126,483 | 2047/2/20 |
| | | RAGB 2.400 05/23/34 | 2.4 | 1,100 | 1,091 | 174,647 | 2034/5/23 |
| フィンランド | 国債証券 | RFBG 3.000 09/15/34 | 3.0 | 1,000 | 1,038 | 166,226 | 2034/9/15 |
| アイルランド | 国債証券 | IRISH 2.600 10/18/34 | 2.6 | 1,000 | 1,016 | 162,686 | 2034/10/18 |
| ポルトガル | 国債証券 | PGB 2.875 10/20/34 | 2.875 | 1,500 | 1,544 | 247,321 | 2034/10/20 |
| 合 計 | | | | | | 13,205,322 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<しんきん米国ソブリン債マザーファンド>

下記は、しんきん米国ソブリン債マザーファンド全体(5,921,114千口)の内容です。

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第220期末 | | | | | | | |
|------|--------|--------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千ドル | 千ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 96,950 | 87,685 | 13,363,226 | 99.1 | — | 49.9 | 18.1 | 31.1 |
| 合 計 | 96,950 | 87,685 | 13,363,226 | 99.1 | — | 49.9 | 18.1 | 31.1 |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | | | 第220期末 | | | | |
|------|------|-----------------------|--------|-------|-------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千ドル | 千ドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | T-BOND 1.750 08/15/41 | 1.75 | 3,800 | 2,563 | 390,679 | 2041/8/15 |
| | | T-BOND 2.500 05/15/46 | 2.5 | 4,300 | 3,063 | 466,838 | 2046/5/15 |
| | | T-BOND 3.000 02/15/47 | 3.0 | 2,750 | 2,131 | 324,884 | 2047/2/15 |
| | | T-BOND 3.125 02/15/42 | 3.125 | 3,600 | 3,003 | 457,792 | 2042/2/15 |
| | | T-BOND 3.125 05/15/48 | 3.125 | 3,700 | 2,904 | 442,601 | 2048/5/15 |
| | | T-BOND 3.500 02/15/39 | 3.5 | 1,500 | 1,362 | 207,588 | 2039/2/15 |
| | | T-BOND 3.625 02/15/44 | 3.625 | 4,000 | 3,508 | 534,709 | 2044/2/15 |
| | | T-BOND 4.375 05/15/40 | 4.375 | 3,000 | 2,977 | 453,824 | 2040/5/15 |
| | | T-BOND 4.750 02/15/37 | 4.75 | 1,600 | 1,670 | 254,650 | 2037/2/15 |
| | | T-BOND 5.250 02/15/29 | 5.25 | 1,100 | 1,150 | 175,262 | 2029/2/15 |
| | | T-BOND 6.500 11/15/26 | 6.5 | 1,000 | 1,048 | 159,787 | 2026/11/15 |
| | | T-NOTE 0.625 08/15/30 | 0.625 | 1,600 | 1,315 | 200,425 | 2030/8/15 |
| | | T-NOTE 0.875 11/15/30 | 0.875 | 1,250 | 1,036 | 157,958 | 2030/11/15 |
| | | T-NOTE 1.250 08/15/31 | 1.25 | 3,200 | 2,654 | 404,469 | 2031/8/15 |
| | | T-NOTE 1.375 11/15/31 | 1.375 | 4,800 | 3,987 | 607,761 | 2031/11/15 |
| | | T-NOTE 1.500 02/15/30 | 1.5 | 1,600 | 1,403 | 213,902 | 2030/2/15 |
| | | T-NOTE 1.625 02/15/26 | 1.625 | 3,900 | 3,783 | 576,598 | 2026/2/15 |
| | | T-NOTE 1.625 05/15/26 | 1.625 | 3,700 | 3,568 | 543,769 | 2026/5/15 |
| | | T-NOTE 1.625 08/15/29 | 1.625 | 4,600 | 4,116 | 627,321 | 2029/8/15 |
| | | T-NOTE 2.000 08/15/25 | 2.0 | 5,100 | 5,021 | 765,217 | 2025/8/15 |
| | | T-NOTE 2.250 11/15/25 | 2.25 | 4,700 | 4,613 | 703,118 | 2025/11/15 |

| 銘 柄 | | | 第220期末 | | | | |
|------|-----------------------|---------------------|--------|-------|---------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千ドル | 千ドル | 千円 | |
| 国債証券 | T-NOTE 2.250 11/15/27 | 2.25 | 2,300 | 2,181 | 332,432 | 2027/11/15 | |
| | T-NOTE 2.625 01/31/26 | 2.625 | 1,500 | 1,473 | 224,519 | 2026/1/31 | |
| | T-NOTE 2.625 02/15/29 | 2.625 | 1,000 | 941 | 143,541 | 2029/2/15 | |
| | T-NOTE 2.875 05/31/25 | 2.875 | 2,150 | 2,135 | 325,471 | 2025/5/31 | |
| | T-NOTE 3.125 11/15/28 | 3.125 | 4,400 | 4,237 | 645,833 | 2028/11/15 | |
| | T-NOTE 3.500 02/15/33 | 3.5 | 1,700 | 1,613 | 245,964 | 2033/2/15 | |
| | T-NOTE 4.250 11/15/34 | 4.25 | 1,300 | 1,297 | 197,779 | 2034/11/15 | |
| | T-NOTE 4.375 05/15/34 | 4.375 | 2,900 | 2,922 | 445,412 | 2034/5/15 | |
| | 特殊債券 (除く金融債) | ASIA 1.875 01/24/30 | 1.875 | 5,300 | 4,728 | 720,547 | 2030/1/24 |
| | | IADB 2.125 01/15/25 | 2.125 | 3,400 | 3,392 | 516,996 | 2025/1/15 |
| | | IADB 4.125 02/15/29 | 4.125 | 1,400 | 1,395 | 212,639 | 2029/2/15 |
| | | IBRD 0.750 11/24/27 | 0.75 | 2,200 | 1,991 | 303,478 | 2027/11/24 |
| | | IBRD 1.875 10/27/26 | 1.875 | 2,600 | 2,489 | 379,446 | 2026/10/27 |
| | 合 計 | | | | | 13,363,226 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<しんきん高格付外国債券マザーファンド>

下記は、しんきん高格付外国債券マザーファンド全体(1,657,751千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第220期末 | | | | | | | |
|---------|----------------------|----------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|----------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| カナダ | 千カナダドル 6,991 | 千カナダドル 6,251 | 千円 673,619 | % 25.1 | % — | % 23.8 | % 1.3 | % — |
| イギリス | 千ポンド 3,746 | 千ポンド 3,417 | 664,784 | 24.8 | — | 17.8 | 7.0 | — |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 52,810 | 千ノルウェークローネ 48,411 | 662,758 | 24.7 | — | 8.8 | 15.9 | — |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 7,161 | 千オーストラリアドル 6,655 | 649,450 | 24.2 | — | 9.1 | 15.2 | — |
| 合 計 | — | — | 2,650,613 | 99.0 | — | 59.5 | 39.4 | — |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | | 第220期末 | | | | |
|-----------------|----------------------|-------|--------|------------|------------|------------|-------|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| カナダ | | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | |
| 国債証券 | CAN 0.500 12/01/30 | 0.5 | 3,551 | 3,079 | 331,845 | 2030/12/1 | |
| | CAN 1.250 06/01/30 | 1.25 | 3,000 | 2,746 | 295,969 | 2030/6/1 | |
| | CAN 2.250 12/01/29 | 2.25 | 340 | 330 | 35,583 | 2029/12/1 | |
| 地方債証券 | BRCOL 2.200 06/18/30 | 2.2 | 100 | 94 | 10,220 | 2030/6/18 | |
| 小計 | | | | | 673,619 | | |
| イギリス | | | | 千ポンド | 千ポンド | | |
| 国債証券 | UKT 0.250 07/31/31 | 0.25 | 150 | 117 | 22,802 | 2031/7/31 | |
| | UKT 0.375 10/22/30 | 0.375 | 1,050 | 853 | 166,069 | 2030/10/22 | |
| | UKT 0.875 10/22/29 | 0.875 | 1,115 | 963 | 187,499 | 2029/10/22 | |
| | UKT 4.750 12/07/30 | 4.75 | 1,431 | 1,482 | 288,414 | 2030/12/7 | |
| 小計 | | | | | 664,784 | | |
| ノルウェー | | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | |
| 国債証券 | NGB 1.375 08/19/30 | 1.375 | 19,420 | 17,291 | 236,722 | 2030/8/19 | |
| | NGB 1.750 09/06/29 | 1.75 | 21,600 | 19,928 | 272,827 | 2029/9/6 | |
| | NGB 2.000 04/26/28 | 2.0 | 11,790 | 11,191 | 153,207 | 2028/4/26 | |
| 小計 | | | | | 662,758 | | |
| オーストラリア | | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| 国債証券 | ACGB 1.000 12/21/30 | 1.0 | 1,680 | 1,419 | 138,491 | 2030/12/21 | |
| | ACGB 2.250 05/21/28 | 2.25 | 574 | 546 | 53,346 | 2028/5/21 | |
| | ACGB 2.500 05/21/30 | 2.5 | 1,147 | 1,071 | 104,535 | 2030/5/21 | |
| | ACGB 2.750 11/21/27 | 2.75 | 720 | 700 | 68,344 | 2027/11/21 | |
| | ACGB 2.750 11/21/29 | 2.75 | 971 | 925 | 90,280 | 2029/11/21 | |
| | ACGB 3.250 04/21/29 | 3.25 | 639 | 625 | 61,062 | 2029/4/21 | |
| 地方債証券 | NSWTC 3.000 04/20/29 | 3.0 | 1,330 | 1,271 | 124,059 | 2029/4/20 | |
| 特殊債券 (除く金融債) | IADB 3.150 06/26/29 | 3.15 | 100 | 95 | 9,330 | 2029/6/26 | |
| 小計 | | | | | 649,450 | | |
| 合計 | | | | | 2,650,613 | | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

くしんきんJリートマザーファンドⅡ

下記は、しんきんJリートマザーファンドⅡ全体(2,840,010千口)の内容です。

国内投資信託証券

| 銘 柄 | 第214期末 | | 第220期末 | |
|-----------------------|------------|--------|-----------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 0.13 | 0.275 | 155,375 | 2.1 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 0.635 | 0.37 | 45,547 | 0.6 |
| 産業ファンド投資法人 | 1.21 | 1.58 | 177,118 | 2.4 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 0.305 | 0.885 | 253,818 | 3.4 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 0.355 | 0.365 | 114,792 | 1.5 |
| G L P投資法人 | 2.335 | 2.98 | 368,626 | 5.0 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | — | 0.605 | 166,375 | 2.2 |
| 日本プロロジスリート投資法人 | 0.985 | 1.57 | 354,349 | 4.8 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.28 | 0.625 | 144,812 | 1.9 |
| One リート投資法人 | 0.095 | — | — | — |
| イオンリート投資法人 | — | 0.42 | 52,206 | 0.7 |
| ヒューリックリート投資法人 | 0.43 | — | — | — |
| 日本リート投資法人 | 0.175 | — | — | — |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 1.775 | 3.04 | 219,792 | 3.0 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 2.025 | 2.44 | 339,404 | 4.6 |
| いちごホテルリート投資法人 | 0.95 | 0.08 | 11,552 | 0.2 |
| ラサールレジポート投資法人 | 0.915 | 1.27 | 175,895 | 2.4 |
| スターアジア不動産投資法人 | 2.86 | 0.97 | 48,209 | 0.6 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 0.235 | 1.645 | 162,032 | 2.2 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 0.255 | 0.33 | 111,870 | 1.5 |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | 0.32 | 0.54 | 75,168 | 1.0 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 0.66 | 4.93 | 609,348 | 8.2 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 0.592 | 0.86 | 472,140 | 6.3 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 3.025 | 5.1 | 451,350 | 6.1 |
| オリックス不動産投資法人 | 1.355 | 1.74 | 283,272 | 3.8 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 0.47 | 0.69 | 221,490 | 3.0 |
| N T T 都市開発リート投資法人 | 0.365 | 0.15 | 16,695 | 0.2 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 0.365 | 0.52 | 81,120 | 1.1 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | — | 0.35 | 33,355 | 0.4 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 1.46 | 2 | 271,200 | 3.6 |
| 森トラストリート投資法人 | 1.085 | 1.44 | 86,544 | 1.2 |
| インヴィンシブル投資法人 | 3.975 | 6.2 | 415,400 | 5.6 |
| フロンティア不動産投資法人 | 0.015 | 0.09 | 35,190 | 0.5 |
| 平和不動産リート投資法人 | 0.645 | 0.25 | 29,000 | 0.4 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 0.36 | 0.52 | 135,564 | 1.8 |
| 福岡リート投資法人 | 0.28 | — | — | — |
| K D X 不動産投資法人 | 1.8 | 2.395 | 346,556 | 4.7 |
| いちごオフィスリート投資法人 | — | 0.33 | 25,377 | 0.3 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.335 | 0.47 | 135,736 | 1.8 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 0.965 | 1.3 | 294,840 | 4.0 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2.965 | 4.56 | 329,232 | 4.4 |
| 大和証券リビング投資法人 | 0.22 | — | — | — |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 0.49 | 1.04 | 119,600 | 1.6 |
| 合 計 | 37.697 | 54.925 | 7,369,951 | <99.0%> |
| | 口 数・金 額 | 口 数 | | |
| | 銘 柄 数<比 率> | 38 | | |

(注1) 合計欄の<>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注3) —印は組み入れなし。

<しんきんグローバルリートマザーファンド>

下記は、しんきんグローバルリートマザーファンド全体(1,826,503千口)の内容です。

外国投資信託証券

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--------------------------------------|--------|--------|--------|---------|-----|--|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % | |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 1.01 | 1.17 | 32 | 4,942 | 0.1 | |
| AGREE REALTY CORP | 2.048 | 2.446 | 181 | 27,704 | 0.5 | |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 1.398 | 1.745 | 18 | 2,885 | 0.1 | |
| AMERICAN HEALTHCARE REIT INC | — | 3.595 | 100 | 15,378 | 0.3 | |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST INC | 1.017 | — | — | — | — | |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 2.945 | — | — | — | — | |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 2.78 | 3.152 | 27 | 4,188 | 0.1 | |
| ACADIA REALTY TRUST | 2.12 | 2.578 | 64 | 9,822 | 0.2 | |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 1.504 | 1.804 | 34 | 5,270 | 0.1 | |
| ALEXANDER'S INC | 0.044 | 0.056 | 11 | 1,825 | 0.0 | |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 6.53 | 7.632 | 288 | 43,907 | 0.8 | |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 4.411 | 5.373 | 87 | 13,298 | 0.2 | |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 3.233 | 3.787 | 391 | 59,670 | 1.1 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 2.912 | 3.452 | 780 | 118,979 | 2.2 | |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 3.568 | 3.961 | 22 | 3,434 | 0.1 | |
| SAUL CENTERS INC | 0.268 | 0.27 | 10 | 1,659 | 0.0 | |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 1.019 | 1.251 | 4 | 657 | 0.0 | |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 3.882 | 4.659 | 78 | 11,992 | 0.2 | |
| BRT APARTMENTS CORP | 0.245 | 0.24 | 4 | 696 | 0.0 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 6.145 | 7.36 | 213 | 32,561 | 0.6 | |
| BOSTON PROPERTIES INC | 2.961 | 3.525 | 281 | 42,971 | 0.8 | |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 0.511 | 0.369 | 11 | 1,732 | 0.0 | |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | 2.326 | 2.7 | 88 | 13,430 | 0.2 | |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 0.502 | 0.634 | 11 | 1,758 | 0.0 | |
| CITY OFFICE REIT INC | 0.826 | 0.857 | 4 | 756 | 0.0 | |
| CHATHAM LODGING TRUST | 1.013 | 1.303 | 12 | 1,961 | 0.0 | |
| CLIPPER REALTY INC | 0.382 | — | — | — | — | |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 5.453 | 6.349 | 144 | 22,022 | 0.4 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 2.192 | 2.589 | 311 | 47,529 | 0.9 | |
| CENTERSPACE | 0.312 | 0.371 | 25 | 3,936 | 0.1 | |
| CTO REALTY GROWTH INC | 0.419 | 0.444 | 9 | 1,384 | 0.0 | |
| CARETRUST REIT INC | 2.705 | 4.063 | 115 | 17,672 | 0.3 | |
| CUBESMART | 4.616 | 5.457 | 254 | 38,788 | 0.7 | |
| CURBLINE PROPERTIES CORP | — | 2.296 | 54 | 8,355 | 0.2 | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 3.062 | 3.676 | 110 | 16,913 | 0.3 | |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 14.9 | 21.1 | 12 | 1,848 | 0.0 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES, INC. | 1.973 | 2.267 | 26 | 4,069 | 0.1 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 3.456 | 3.835 | 75 | 11,490 | 0.2 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 4.486 | 5.617 | 14 | 2,140 | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 6.63 | 7.482 | 1,400 | 213,478 | 3.9 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 14.534 | 17.106 | 363 | 55,449 | 1.0 | |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO | 4.345 | 5.122 | 49 | 7,548 | 0.1 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 9.1 | 9.1 | — | — | — | |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | |
|--|--------|--------|--------|---------|-----|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 0.977 | 1.186 | 202 | 30,846 | 0.6 |
| ELME COMMUNITIES | 1.821 | 2.176 | 35 | 5,448 | 0.1 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 3.827 | 4.528 | 309 | 47,166 | 0.9 |
| EPR PROPERTIES | 1.562 | 1.814 | 80 | 12,318 | 0.2 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 3.165 | 4.256 | 140 | 21,397 | 0.4 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 2.212 | 2.653 | 4 | 675 | 0.0 |
| EQUINIX INC | 1.927 | 2.308 | 2,246 | 342,442 | 6.2 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 7.086 | 8.281 | 602 | 91,850 | 1.7 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 2.712 | 3.319 | 36 | 5,614 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 1.318 | 1.563 | 465 | 70,993 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 4.338 | 5.152 | 821 | 125,249 | 2.3 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 1.877 | 2.29 | 66 | 10,096 | 0.2 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 0.902 | 1.127 | 13 | 2,107 | 0.0 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 2.7 | 3.221 | 167 | 25,550 | 0.5 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 1.504 | 1.836 | 206 | 31,439 | 0.6 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 1.815 | 1.948 | 3 | 561 | 0.0 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 5.482 | 6.665 | 330 | 50,391 | 0.9 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 1.278 | 1.596 | 13 | 2,079 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 4.049 | 4.848 | 34 | 5,253 | 0.1 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 0.828 | 1.039 | 17 | 2,669 | 0.0 |
| GETTY REALTY CORP | 1.018 | 1.232 | 39 | 6,060 | 0.1 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 2.191 | 2.62 | 80 | 12,238 | 0.2 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 2.626 | 3.41 | 10 | 1,637 | 0.0 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 7.778 | 8.827 | 153 | 23,407 | 0.4 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 14.483 | 17.052 | 322 | 49,193 | 0.9 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 0.581 | 0.7 | 73 | 11,127 | 0.2 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 1.228 | 1.426 | 5 | 786 | 0.0 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 2.231 | 2.767 | 18 | 2,880 | 0.1 |
| INVITATION HOMES INC | 11.81 | 13.868 | 461 | 70,357 | 1.3 |
| IRON MOUNTAIN INC | 5.995 | 7.131 | 806 | 122,902 | 2.2 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 4.54 | 5.432 | 115 | 17,666 | 0.3 |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 1.4 | 1.858 | 57 | 8,735 | 0.2 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 1.805 | 2.067 | 33 | 5,122 | 0.1 |
| KIMCO REALTY CORP | 13.676 | 16.396 | 400 | 61,094 | 1.1 |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 8.9 | 20.8 | 4 | 729 | 0.0 |
| KILROY REALTY CORP | 2.153 | 2.547 | 104 | 15,887 | 0.3 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 4.548 | 5.333 | 140 | 21,342 | 0.4 |
| LAMAR ADVERTISING CO-A | — | 2.131 | 276 | 42,105 | 0.8 |
| GLADSTONE LAND CORP | 0.691 | 0.871 | 9 | 1,515 | 0.0 |
| LINEAGE INC | — | 1.427 | 89 | 13,657 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 0.858 | 1.075 | 39 | 6,078 | 0.1 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 6.066 | 7.275 | 65 | 10,044 | 0.2 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 2.396 | 2.844 | 450 | 68,624 | 1.2 |
| MACERICH CO/THE | 4.477 | 5.718 | 122 | 18,604 | 0.3 |
| MODIV INDUSTRIAL INC | — | 0.22 | 3 | 529 | 0.0 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 12.417 | 14.83 | 60 | 9,288 | 0.2 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 19.668 | 47.668 | 4 | 740 | 0.0 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 0.9 | 1.074 | 78 | 11,946 | 0.2 |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | |
|--|--------|--------|--------|---------|-----|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | 0.303 | 0.319 | 10 | 1,566 | 0.0 |
| NNN REIT INC | 3.737 | 4.478 | 190 | 28,976 | 0.5 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 1.601 | 1.727 | 72 | 11,114 | 0.2 |
| NETSTREIT CORP | 1.424 | 1.837 | 28 | 4,269 | 0.1 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | 0.692 | 0.722 | 4 | 633 | 0.0 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 0.474 | 0.512 | 23 | 3,575 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 17.074 | 21.158 | 1,170 | 178,378 | 3.2 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 5.025 | 6.306 | 244 | 37,336 | 0.7 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.328 | 0.345 | 10 | 1,530 | 0.0 |
| ORION OFFICE REIT INC | 1.156 | 1.24 | 5 | 763 | 0.0 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 0.386 | 1.214 | 1 | 253 | 0.0 |
| OUTFRONT MEDIA INC | — | 3.405 | 63 | 9,745 | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 2.565 | 2.916 | 27 | 4,132 | 0.1 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 2.498 | 3.002 | 44 | 6,771 | 0.1 |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY INC | 2.468 | 2.961 | 115 | 17,598 | 0.3 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 3.424 | 4.316 | 21 | 3,209 | 0.1 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 0.178 | 0.309 | 5 | 835 | 0.0 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 4.353 | 5.163 | 80 | 12,235 | 0.2 |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 0.747 | 0.971 | 12 | 1,855 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 18.969 | 22.509 | 2,520 | 384,064 | 6.9 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 0.76 | 0.897 | 16 | 2,563 | 0.0 |
| PRIME US REIT | 3.37 | 20.07 | 3 | 550 | 0.0 |
| PUBLIC STORAGE | 3.249 | 3.828 | 1,237 | 188,632 | 3.4 |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A | 0.419 | 0.445 | 6 | 937 | 0.0 |
| REGENCY CENTERS CORP | 3.373 | 3.963 | 294 | 44,813 | 0.8 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 4.326 | 5.351 | 217 | 33,174 | 0.6 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1.219 | 1.457 | 170 | 25,988 | 0.5 |
| RLJ LODGING TRUST | 3.182 | 3.644 | 38 | 5,847 | 0.1 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 2.612 | 3.09 | 53 | 8,217 | 0.1 |
| SAFEHOLD INC | 0.928 | 1.164 | 23 | 3,638 | 0.1 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 4.793 | 5.648 | 99 | 15,218 | 0.3 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 4.259 | 5.026 | 61 | 9,367 | 0.2 |
| SITE CENTERS CORP | 3.732 | 1.203 | 18 | 2,821 | 0.1 |
| TANGER INC | 2.232 | 2.632 | 93 | 14,271 | 0.3 |
| SL GREEN REALTY CORP | 1.342 | 1.695 | 124 | 19,007 | 0.3 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 6.691 | 7.448 | 1,315 | 200,488 | 3.6 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 3.708 | 4.429 | 159 | 24,312 | 0.4 |
| SUN COMMUNITIES INC | 2.555 | 2.847 | 344 | 52,577 | 1.0 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 3.436 | 4.411 | 11 | 1,754 | 0.0 |
| TERRENO REALTY CORP | 1.903 | 2.351 | 148 | 22,622 | 0.4 |
| UDR INC | 6.213 | 7.288 | 322 | 49,214 | 0.9 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 2.439 | 2.999 | 67 | 10,251 | 0.2 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.264 | 0.329 | 13 | 2,042 | 0.0 |
| UMH PROPERTIES INC | 1.294 | 1.651 | 31 | 4,861 | 0.1 |
| UNITI GROUP INC | 4.948 | 6.01 | 36 | 5,577 | 0.1 |
| VICI PROPERTIES INC | 21.239 | 25.457 | 797 | 121,471 | 2.2 |
| VORNADO REALTY TRUST | 3.235 | 4.034 | 180 | 27,499 | 0.5 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 1.662 | 1.996 | 35 | 5,350 | 0.1 |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--|------------------|----------------|----------------|-------------|----------------------|--|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % | |
| VENTAS INC | 8.261 | 10.028 | 608 | 92,796 | 1.7 | |
| WELLTOWER INC | 11.363 | 14.068 | 1,809 | 275,692 | 5.0 | |
| WP CAREY INC | 4.489 | 5.311 | 294 | 44,953 | 0.8 | |
| WHITESTONE REIT | 0.976 | 1.043 | 15 | 2,290 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 2.181 | 2.52 | 40 | 6,225 | 0.1 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 513.654 138 | 670.941 141 | 28,913 — | 4,406,453 <79.7%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 1.3 | 1.559 | 28 | 3,052 | 0.1 | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.052 | 1.104 | 8 | 874 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.502 | 0.598 | 40 | 4,411 | 0.1 | |
| BTB REIT | 0.654 | — | — | — | — | |
| CAN APARTMENT PROP REIT | 1.703 | 2.024 | 89 | 9,665 | 0.2 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 3.33 | 3.841 | 52 | 5,674 | 0.1 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.087 | 1.368 | 19 | 2,081 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.101 | 1.383 | 20 | 2,220 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.082 | 0.224 | 4 | 451 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 2.775 | 3.338 | 40 | 4,362 | 0.1 | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2.155 | 2.57 | 44 | 4,829 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.643 | 0.769 | 55 | 6,032 | 0.1 | |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.339 | — | — | — | — | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 2.66 | 3.186 | 31 | 3,388 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.471 | 1.877 | 19 | 2,111 | 0.0 | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 1.203 | 1.316 | 23 | 2,529 | 0.0 | |
| MINTO APARTMENT REIT | 0.386 | 0.396 | 5 | 588 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 0.383 | 0.392 | 7 | 769 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REIT | 2.471 | 2.451 | 11 | 1,254 | 0.0 | |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 0.639 | 0.674 | 5 | 578 | 0.0 | |
| PRIMARIS REIT | 0.981 | 1.232 | 19 | 2,153 | 0.0 | |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.419 | — | — | — | — | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3.047 | 3.558 | 65 | 7,050 | 0.1 | |
| SLATE GROCERY REIT | 0.581 | 0.616 | 8 | 968 | 0.0 | |
| SMARTCENTRES REIT VAR VT UN | 1.469 | 1.752 | 44 | 4,804 | 0.1 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 0.014 | — | — | — | — | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 32.447 26 | 36.228 22 | 648 — | 69,852 <1.3%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | | |
| HAMBORNER REIT AG | 1.467 | 1.837 | 11 | 1,896 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 1.467 1 | 1.837 1 | 11 — | 1,896 <0.0%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 0.651 | 1.66 | 4 | 682 | 0.0 | |
| 小計 | 口数・金額 銘柄数<比率> | 0.651 1 | 1.66 1 | 4 — | 682 <0.0%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| ALTAREA | 0.095 | 0.125 | 11 | 1,872 | 0.0 | |
| CARMILA | 1.152 | 1.229 | 19 | 3,073 | 0.1 | |
| COVIVIO | 1.005 | 1.324 | 65 | 10,508 | 0.2 | |

| 銘 柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--|---------------|--------|--------|--------|---------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…フランス) | | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| GECINA SA | | 1.046 | 1.262 | 114 | 18,262 | 0.3 |
| ICADE | | 0.648 | 0.77 | 17 | 2,724 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 3.978 | 5.371 | 149 | 23,902 | 0.4 |
| MERCIALYS | | 1.946 | 2.172 | 21 | 3,515 | 0.1 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | | 2.081 | 2.447 | 180 | 28,971 | 0.5 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 11.951 | 14.7 | 579 | 92,829 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | <1.7%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | | 0.896 | 1.076 | 24 | 3,875 | 0.1 |
| NSI NV | | 0.376 | 0.378 | 7 | 1,188 | 0.0 |
| VASTNED RETAIL NV | | 0.375 | — | — | — | — |
| WERELDHAVE NV | | 0.737 | 0.928 | 12 | 2,035 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2.384 | 2.382 | 44 | 7,099 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 | 3 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | | 5.929 | 8.372 | 43 | 6,968 | 0.1 |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | | 1.024 | 1.083 | 8 | 1,432 | 0.0 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 6.754 | 9.521 | 97 | 15,667 | 0.3 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 13.707 | 18.976 | 150 | 24,068 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | <0.4%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| AEDIFICA | | 0.958 | 1.172 | 65 | 10,487 | 0.2 |
| COFINIMMO | | 0.762 | 0.93 | 50 | 8,061 | 0.1 |
| CARE PROPERTY INVEST | | 0.767 | 0.963 | 11 | 1,782 | 0.0 |
| MONTEA NV | | 0.371 | 0.508 | 32 | 5,180 | 0.1 |
| RETAIL ESTATES | | 0.253 | 0.303 | 17 | 2,793 | 0.1 |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | | 0.646 | 0.732 | 27 | 4,429 | 0.1 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 3.594 | 4.25 | 83 | 13,443 | 0.2 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | 0.689 | 0.84 | 24 | 3,966 | 0.1 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 8.04 | 9.698 | 313 | 50,144 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | <0.9%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 8.892 | 11.497 | 10 | 1,656 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 8.892 | 11.497 | 10 | 1,656 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ…その他) | | | | | | |
| CROMWELL EUROPEAN REIT | | 6.48 | 8.18 | 13 | 2,108 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 6.48 | 8.18 | 13 | 2,108 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 53.572 | 68.93 | 1,127 | 180,486 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 27 | 26 | — | <3.3%> | |
| (イギリス) | | | | 千ポンド | | |
| AEW UK REIT PLC | | 2.862 | 2.878 | 2 | 561 | 0.0 |
| ASSURA PLC | | 61.873 | 73.6 | 29 | 5,718 | 0.1 |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | | 7.902 | 8.414 | 5 | 993 | 0.0 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | | 47.237 | 59.812 | 80 | 15,638 | 0.3 |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | | 14.543 | — | — | — | — |
| BRITISH LAND CO PLC | | 19.112 | 24.114 | 87 | 17,094 | 0.3 |

| 銘柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--------------------------------------|---------|---------|------------|----------|-----|--|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千ポンド | 千円 | % | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 3.945 | 4.854 | 48 | 9,386 | 0.2 | |
| CLS HOLDINGS PLC | 2.199 | 4.389 | 3 | 691 | 0.0 | |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC | 9.139 | 11.748 | 9 | 1,764 | 0.0 | |
| CARE REIT PLC | — | 10.835 | 8 | 1,732 | 0.0 | |
| DERWENT LONDON PLC | 2.261 | 2.775 | 56 | 11,012 | 0.2 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 12.509 | 14.762 | 12 | 2,449 | 0.0 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 4.808 | 10.125 | 30 | 5,909 | 0.1 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES-FULL | 3.157 | — | — | — | — | |
| HELICAL PLC | 2.115 | 2.908 | 5 | 1,061 | 0.0 | |
| HAMMERSON PLC | 79.845 | 10.883 | 30 | 5,966 | 0.1 | |
| HOME REIT PLC | 19.023 | 19.023 | — | — | — | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 8.59 | — | — | — | — | |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | 6.678 | 6.584 | 2 | 486 | 0.0 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 15.36 | 18.067 | 104 | 20,280 | 0.4 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 41.48 | 49.4 | 90 | 17,538 | 0.3 | |
| NEWRIVER REIT PLC | 6.486 | 6.584 | 5 | 1,006 | 0.0 | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 11.352 | 14.259 | 9 | 1,872 | 0.0 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 27.705 | 33.031 | 30 | 5,976 | 0.1 | |
| PRS REIT PLC/THE | 10.703 | 12.354 | 13 | 2,537 | 0.0 | |
| REGIONAL REIT LTD | 7.435 | 3.671 | 4 | 842 | 0.0 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 4.528 | 5.4 | 37 | 7,327 | 0.1 | |
| SEGR0 PLC | 27.473 | 32.83 | 236 | 45,984 | 0.8 | |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 39.461 | 48.272 | 63 | 12,367 | 0.2 | |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 9.784 | 10.53 | 11 | 2,212 | 0.0 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 6.813 | 6.729 | 4 | 785 | 0.0 | |
| SCHRODER REIT LTD | 10.084 | 10.571 | 5 | 1,017 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 25.834 | 31.046 | 21 | 4,191 | 0.1 | |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 12.857 | 13.834 | 12 | 2,341 | 0.0 | |
| UNITE GROUP PLC | 8.222 | 10.026 | 83 | 16,257 | 0.3 | |
| WAREHOUSE REIT PLC | 8.807 | 8.803 | 7 | 1,368 | 0.0 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 2.825 | 3.356 | 17 | 3,388 | 0.1 | |
| 小計 | 585.007 | 586.467 | 1,170 | 227,764 | | |
| 銘柄数 < 比率 > | 36 | 34 | — | < 4.1% > | | |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリアドル | | | |
| ABACUS GROUP | 8.892 | 11.924 | 13 | 1,338 | 0.0 | |
| ARENA REIT | 7.362 | 8.949 | 34 | 3,353 | 0.1 | |
| ABACUS STORAGE KING | 11.169 | 11.259 | 12 | 1,263 | 0.0 | |
| BWP TRUST | 11.265 | 13.489 | 45 | 4,396 | 0.1 | |
| CHARTER HALL GROUP | 9.574 | 11.431 | 168 | 16,408 | 0.3 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 11.056 | 13.286 | 38 | 3,733 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 13.788 | 16.438 | 62 | 6,063 | 0.1 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 28.773 | 29.076 | 10 | 1,035 | 0.0 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 16.689 | 20.364 | 38 | 3,745 | 0.1 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 8.668 | 8.82 | 9 | 946 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE | 7.009 | 8.797 | 22 | 2,188 | 0.0 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 10.723 | 12.911 | 41 | 4,081 | 0.1 | |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 4.406 | 5.689 | 14 | 1,437 | 0.0 | |
| DEXUS | 22.296 | 26.002 | 177 | 17,304 | 0.3 | |

| 銘 柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--|---------------|---------|-------------|---------|----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | % | |
| GDI PROPERTY GROUP | 10.698 | — | — | — | — | |
| GOODMAN GROUP | 35.481 | 46.176 | 1,736 | 169,465 | 3.1 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 5.626 | 7.279 | 17 | 1,725 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 39.039 | 46.489 | 211 | 20,640 | 0.4 | |
| HEALTHCO REIT | 9.895 | 9.72 | 10 | 991 | 0.0 | |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 37.041 | 44.214 | 52 | 5,090 | 0.1 | |
| HMC CAPITAL LTD | 5.057 | — | — | — | — | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 4.043 | 4.137 | 15 | 1,525 | 0.0 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 7.773 | 9.267 | 42 | 4,177 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 80.343 | 95.686 | 199 | 19,421 | 0.4 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 26.241 | 33.391 | 79 | 7,754 | 0.1 | |
| RURAL FUNDS GROUP | 8.034 | 8.067 | 14 | 1,377 | 0.0 | |
| REGION RE LTD | 22.743 | 27.831 | 60 | 5,866 | 0.1 | |
| SCENTRE GROUP | 106.559 | 126.058 | 447 | 43,667 | 0.8 | |
| STOCKLAND | 48.744 | 58.43 | 296 | 28,964 | 0.5 | |
| VICINITY CENTRES | 80.21 | 93.731 | 194 | 18,932 | 0.3 | |
| WAYPOINT REIT | 13.926 | 16.737 | 40 | 3,936 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 713.123 | 825.648 | 4,107 | 400,834 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 31 | 29 | — | < 7.2% > | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 17.561 | — | — | — | — | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 21.817 | 25.861 | 52 | 4,639 | 0.1 | |
| KIWI PROPERTY GROUP INC | 33.001 | — | — | — | — | |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 32.884 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 105.263 | 25.861 | 52 | 4,639 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 | 1 | — | < 0.1% > | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| CHAMPION REIT | 39 | 51 | 88 | 1,739 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 46 | 49 | 47 | 931 | 0.0 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 21 | 21 | 38 | 757 | 0.0 | |
| FORTUNE REIT | 31 | 33 | 132 | 2,593 | 0.0 | |
| PROSPERITY REIT | 23 | — | — | — | — | |
| LINK REIT | 52.8 | 62.4 | 2,115 | 41,461 | 0.7 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 212.8 | 216.4 | 2,422 | 47,482 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6 | 5 | — | < 0.9% > | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| AIMS APAC REIT | 14.279 | 15.279 | 19 | 2,166 | 0.0 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 13.95 | 13.45 | 11 | 1,319 | 0.0 | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 103.575 | 131.701 | 254 | 28,837 | 0.5 | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 72.75 | 85.55 | 219 | 24,846 | 0.4 | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 51.489 | 62.789 | 55 | 6,304 | 0.1 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 24.108 | 25.508 | 18 | 2,083 | 0.0 | |
| EC WORLD REIT | 4.4 | 4.4 | — | — | — | |
| ESR-LOGOS REIT | 124.351 | 150.051 | 39 | 4,426 | 0.1 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 23.579 | 29.079 | 61 | 6,993 | 0.1 | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 22 | 22.1 | 13 | 1,554 | 0.0 | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 60.603 | 72.403 | 64 | 7,310 | 0.1 | |
| KEPPEL DC REIT | 27.84 | 42.598 | 93 | 10,583 | 0.2 | |

| 銘 柄 | 第214期末 | | 第220期末 | | | |
|--------------------------------------|---------------|----------|-------------|--------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % | |
| KEPPEL REIT | 46.55 | 56.55 | 48 | 5,453 | 0.1 | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 36.121 | 43.821 | 24 | 2,759 | 0.0 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 42.869 | 49.569 | 110 | 12,484 | 0.2 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 69.192 | 83.392 | 105 | 12,015 | 0.2 | |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | 47.909 | 57.209 | 69 | 7,918 | 0.1 | |
| OUÉ REIT | — | 58.9 | 16 | 1,871 | 0.0 | |
| PARAGON REIT | 25.8 | — | — | — | — | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 8 | 9.6 | 35 | 4,007 | 0.1 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9.7 | 14.6 | 10 | 1,151 | 0.0 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 29 | 36.4 | 18 | 2,044 | 0.0 | |
| SUNTEC REIT | 46.4 | 54.1 | 64 | 7,365 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 904.465 | 1,119.049 | 1,352 | 153,496 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 22 | 22 | — | < 2.8% > | |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 1.516 | 2.881 | 16,133 | 1,719 | 0.0 | |
| LOTTE REIT CO LTD | 2.518 | 3.086 | 9,520 | 1,014 | 0.0 | |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | — | 1.313 | 5,501 | 586 | 0.0 | |
| JR REIT XXVII | 3.396 | 4.119 | 12,418 | 1,323 | 0.0 | |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 1.046 | 1.179 | 4,828 | 514 | 0.0 | |
| ESR KENDALL SQUARE REIT LTD | 3.313 | 4.146 | 18,864 | 2,010 | 0.0 | |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | 1.051 | — | — | — | — | |
| SK REITS CO LTD | 2.464 | 3.12 | 14,305 | 1,524 | 0.0 | |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 0.645 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 15.949 | 19.844 | 81,571 | 8,695 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | 7 | — | < 0.2% > | |
| (イスラエル) | | | 千イスラエル・シェケル | | | |
| MENIVIM-THE NEW REIT LTD | 15.851 | 15.738 | 31 | 1,332 | 0.0 | |
| REIT 1 LTD | 4.031 | 4.541 | 90 | 3,877 | 0.1 | |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 4.578 | 4.816 | 46 | 2,001 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 24.46 | 25.095 | 169 | 7,211 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | < 0.1% > | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 | 3,160.74 | 3,594.463 | — | 5,506,917 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 301 | 290 | — | < 99.6% > | |

(注1) 邦貨換算金額は、2024年12月12日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の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り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

運用報告書

親投資信託

しんきん好配当利回り株マザーファンド

第19期

(決算日：2024年3月21日)

しんきん好配当利回り株マザーファンドの第19期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。</p> <p>②銘柄の選定にあたっては、企業業績、財務健全性、時価総額などを総合的に勘案して決定します。</p> <p>③株式等の組入れは、原則として高位を保ちます。</p> <p>④株式以外の資産の組入比率は通常の場合50%以下とします。</p> <p>⑤投資信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引を行うことができます。</p> <p>⑥資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたときおよびやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。</p> |
| 主要投資対象 | 我が国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含みます。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑦外貨建資産への投資は行いません。</p> |

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 価 額 | | T O P I X | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|---------|-------------|---------|-----------|-----------|---------|
| | 騰 落 中 率 | 騰 落 中 率 | (参 考 指 標) | 騰 落 中 率 | | | |
| | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 15期(2020年3月23日) | 15,942 | △22.1 | 1,292.01 | △20.0 | 94.6 | — | 22,150 |
| 16期(2021年3月22日) | 24,413 | 53.1 | 1,990.18 | 54.0 | 97.6 | — | 30,424 |
| 17期(2022年3月22日) | 25,142 | 3.0 | 1,933.74 | △ 2.8 | 99.3 | — | 26,971 |
| 18期(2023年3月20日) | 27,188 | 8.1 | 1,929.30 | △ 0.2 | 99.5 | — | 28,315 |
| 19期(2024年3月21日) | 41,309 | 51.9 | 2,796.21 | 44.9 | 99.4 | — | 36,097 |

(注) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○当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 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|-------------|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | (参 考 指 標) | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2023年3月20日 | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| | 27,188 | — | 1,929.30 | — | 99.5 | — |
| 3月末 | 28,628 | 5.3 | 2,003.50 | 3.8 | 98.0 | — |
| 4月末 | 29,498 | 8.5 | 2,057.48 | 6.6 | 98.2 | — |
| 5月末 | 30,159 | 10.9 | 2,130.63 | 10.4 | 98.2 | — |
| 6月末 | 32,527 | 19.6 | 2,288.60 | 18.6 | 98.7 | — |
| 7月末 | 33,172 | 22.0 | 2,322.56 | 20.4 | 98.9 | — |
| 8月末 | 33,821 | 24.4 | 2,332.00 | 20.9 | 99.2 | — |
| 9月末 | 34,732 | 27.7 | 2,323.39 | 20.4 | 98.3 | — |
| 10月末 | 33,618 | 23.7 | 2,253.72 | 16.8 | 98.0 | — |
| 11月末 | 35,243 | 29.6 | 2,374.93 | 23.1 | 98.3 | — |
| 12月末 | 35,134 | 29.2 | 2,366.39 | 22.7 | 99.6 | — |
| 2024年1月末 | 38,094 | 40.1 | 2,551.10 | 32.2 | 98.5 | — |
| 2月末 | 39,493 | 45.3 | 2,675.73 | 38.7 | 99.4 | — |
| (期 末) 2024年3月21日 | 41,309 | 51.9 | 2,796.21 | 44.9 | 99.4 | — |

(注 1) 騰落率は期首比。

(注 2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (TOPIX) 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、利用など東証株価指数 (TOPIX) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (TOPIX) に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数 (TOPIX) の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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 は責任を負いません。

○第19期の運用経過等（2023年3月21日～2024年3月21日）

<当期中の基準価額等の推移>



当ファンドは、主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用を行っています。

当期の基準価額は上昇しました。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・国内外の企業業績が堅調だったこと。
- ・米連邦準備制度理事会（FRB）が利上げを緩めると期待されたこと。
- ・日銀が政策修正後も緩和的な金融政策を継続する姿勢を示したこと。

<下落要因>

- ・米連邦公開市場委員会（FOMC）で高金利を長期にわたり維持する見通しが示されたこと。
- ・イスラエルとハマスの紛争が勃発し中東情勢が悪化したこと。

＜投資環境＞

(2023年3月～5月)

当期の東証株価指数（TOPIX）は、期中安値となる1,929.30ポイントの水準から始まりました。2023年3月の株式市場は、下旬は米国金融機関の経営破綻や欧州大手金融機関の信用不安などによる金融システムへの過度な不安が和らいだことなどから堅調に推移しました。4月は、FRBが近く利上げを停止し、利下げを開始するとの見方が広がったことや、米著名投資家のパフェット氏が日本株への追加投資の検討を表明したことなどから、投資家心理が改善し堅調に推移しました。5月は、日銀が大規模な金融緩和策を継続するとの見方が意識される中、国内企業の好調な業績見通しや積極的な自社株買い方針および円安の進行などから堅調に推移しました。

(2023年6月～8月)

6月は、米債務上限問題をめぐる懸念が払拭されたことや、根強い日本株の先高観を背景に堅調に推移しました。7月は、FOMCでパウエルFRB議長が追加の利上げを明言しなかったことや米国のインフレ鈍化を受けて上昇しました。8月は、米国の格付会社が米国国債や米国の中堅銀行を格下げしたことや、ジャクソンホール会議でのパウエルFRB議長の発言への警戒感から売りが優勢となる場面もありましたが、同会議が終了すると月末にかけては、重要イベントを通過した安心感から買いが優勢となりました。

(2023年9月～11月)

9月は、好調な米経済指標や中国の景気刺激策への期待から買いが優勢となった後、FOMCで高金利を長期にわたり維持する見通しが示され、米10年債利回りが4.5%を超える水準に上昇したことが重しとなり、売りが優勢になりました。10月は、イスラエルとハマスの紛争が勃発し中東情勢が悪化したことや、日銀の金融政策修正などによる国内金利の上昇が投資家心理を圧迫したことなどから低調に推移しました。11月は、米雇用統計を受けFRBの利上げ局面は終了したとの見方が強まり、米国長期金利が低下したことなどから堅調に推移しました。

(2023年12月～2024年3月)

12月は、円高や高値を警戒した利益確定売りが重しとなり軟調に推移しました。2024年1月は、円安の進行や、東証が「資本コストや株価を意識した経営の実現に向けた対応」に関する開示企業一覧表を公表したことで、国内企業の資本効率が改善すると期待から買いが優勢となりました。2月は、内田日銀副総裁が政策修正後も緩和的な金融政策を継続する姿勢を示したことや、国内主要企業の決算が堅調な内容であったこと、米半導体関連企業の好決算を受けて、国内企業の業績も拡大すると期待が高まったことから上昇しました。3月は、日銀の金融政策修正観測が高まったことが嫌気され下落したものの、日米の金融政策に関する会合を無事通過した安心感や円安を受けて上昇し、期末のTOPIXは期中高値となる2,796.21ポイントで終了しました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

(運用経過)

当期の売買については、設定・解約に伴い現物株式を売買したほか、ファンドの運用方針に従い、①予想配当利回り、②企業業績、③時価総額、④財務の健全性の4項目により投資対象銘柄を絞り込み、個別銘柄の入替えなどを必要に応じて実施しました。

株式の組入比率は、おおむね95%以上の高位を保ち、期末には99.4%となっています。

(業種構成)

期首は、東証33業種分類中28業種を組み入れ、T O P I X 対比でオーバーウエートとしていた主な業種は、機械、石油・石炭製品、金属製品、ゴム製品および非鉄金属で、アンダーウエートとしている主な業種は、電気機器、食料品、情報・通信業、精密機器およびその他金融業でした。その後は、銘柄の入替えおよび株価の変動に伴い、鉱業、保険業および機械などの業種が増加した一方、電気機器、小売業および医薬品などが減少し、期末現在では29業種を組み入れています。なお、期末現在、T O P I X 対比でオーバーウエートとしている主な業種は、機械、石油・石炭製品、金属製品、ゴム製品および非鉄金属で、アンダーウエートとしている主な業種は、電気機器、輸送用機器、食料品、卸売業およびその他金融業です。

(組入銘柄)

期首88銘柄の組入でスタートした後は、上記運用経過のとおり、銘柄の入替えなどを必要に応じて実施し、期末現在の組入銘柄数は87銘柄となっています。期末現在の組入上位10銘柄は大林組、野村ホールディングス、三菱重工業、ENEOSホールディングス、りそなホールディングス、INPEX、日本瓦斯、東京海上ホールディングス、みずほフィナンシャルグループおよび出光興産となっています。なお、期末現在の保有銘柄の予想平均配当利回りは2.96%（時価ベース。日経予想・会社予想より、しんきん投信算出。）となっています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当期の基準価額の期中騰落率は+51.9%となり、参考指標とするT O P I X の騰落率+44.9%を上回りました。（騰落率差：+7.0%）

<要因分析>

(組入比率)

株式組入比率は、期を通しておおむね95%以上の高位を保ちました。その結果、組入比率による影響は軽微でした。

(業種構成)

期中、市場では、証券、商品先物取引業、輸送用機器、保険業などの業種が大きく上昇した一方で、繊維製品、医薬品、空運業などが小幅に上昇しました。

ファンドでは、相対的に堅調だった証券、商品先物取引業や石油・石炭製品の組入比率が高かったことや、相対的に軟調だった食料品の組入比率が低かったことがプラス要因になりました。一方、相対的に堅調だった輸送用機器や卸売業の組入比率が低かったことや、相対的に軟調だった繊維製品の組入比率が高かったことがマイナス要因になりました。

(個別銘柄)

ファンドの個別銘柄では、S C R E E Nホールディングス、三菱重工業、東京エレクトロン、トヨタ自動車および野村ホールディングスなどが大きく上昇した一方、I D E C、L I X I L、アステラス製薬、マンダムおよびヤマダホールディングスなどが下落しました。

<今後の運用方針>

引き続き運用の基本方針に従い、主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標として運用します。株式組入比率は高位を保ち、配当利回りの向上を狙い、個別銘柄の予想配当利回りの推移などを参考に、銘柄の入替えなどを実施します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年3月21日～2024年3月21日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 円 1 (1) | % 0.002 (0.002) | (a) 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 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 1 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は、33,676円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○ 売買及び取引の状況

(2023年3月21日～2024年3月21日)

株式

| 国 | 上場 | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|---------|-----------|-------|------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 内 | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 3,594 | 5,897,883 | 5,211 | 11,129,706 |
| | | (3,203) | () | | |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○ 株式売買比率

(2023年3月21日～2024年3月21日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 17,027,590千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 33,400,986千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.50 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年3月21日～2024年3月21日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年3月21日現在)

国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (1.0%) | | | |
| ホクト | 178.4 | 188.4 | 354,568 |
| 鉱業 (1.2%) | | | |
| I N P E X | — | 192 | 443,712 |
| 建設業 (2.6%) | | | |
| 大林組 | 329.2 | 275.2 | 526,044 |
| 積水ハウス | 124.6 | 120.6 | 417,155 |
| 食料品 (1.1%) | | | |
| キリンホールディングス | 165.2 | 190.9 | 404,230 |
| 繊維製品 (1.1%) | | | |
| 帝人 | 238 | 282.9 | 398,181 |
| 化学 (7.0%) | | | |
| クラレ | 270 | 265.7 | 426,714 |
| 三菱ケミカルグループ | 421.9 | 456.4 | 432,986 |
| 三洋化成工業 | 77 | 93 | 406,410 |
| 太陽ホールディングス | 139 | 123.4 | 412,773 |
| マンダム | 230.6 | 304 | 407,664 |
| 日東電工 | 39.7 | 29.1 | 416,712 |
| 医薬品 (4.4%) | | | |
| 武田薬品工業 | 77.5 | 91.2 | 399,547 |
| アステラス製薬 | 174.1 | 216.8 | 363,573 |
| 参天製薬 | 319.8 | 267.6 | 389,625 |
| 大塚ホールディングス | 82.7 | 67.2 | 430,617 |
| 石油・石炭製品 (2.5%) | | | |
| 出光興産 | 109.8 | 413.2 | 436,339 |
| E N E O Sホールディングス | 714.5 | 620.2 | 453,428 |
| ゴム製品 (2.3%) | | | |
| 横浜ゴム | 131.9 | 101.9 | 418,707 |
| ブリヂストン | 65.4 | 62.9 | 414,825 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ガラス・土石製品 (1.1%) | | | |
| A G C | 67.6 | 73.8 | 409,442 |
| 鉄鋼 (2.3%) | | | |
| 日本製鉄 | 107 | 107.6 | 399,088 |
| 丸一鋼管 | 113.7 | 100.8 | 410,558 |
| 非鉄金属 (2.3%) | | | |
| 三井金属鉱業 | 98.9 | 87.5 | 405,562 |
| 住友電気工業 | 200.3 | 182.4 | 430,099 |
| 金属製品 (2.3%) | | | |
| 三和ホールディングス | 236.6 | 158.9 | 424,501 |
| L I X I L | 145.9 | 207.4 | 401,526 |
| 機械 (8.2%) | | | |
| アマダ | 269.2 | 240 | 433,920 |
| 小松製作所 | 99.9 | 92.6 | 426,515 |
| SANKYO | 61 | 231.6 | 392,562 |
| マックス | 156.3 | 124.9 | 414,668 |
| 日本精工 | 449.7 | 488.4 | 417,288 |
| 三菱重工業 | 66.1 | 34.1 | 459,156 |
| スター精密 | 193 | 219.9 | 408,574 |
| 電気機器 (11.4%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | 329.5 | 326.8 | 401,147 |
| コニカミノルタ | 569.1 | — | — |
| 三菱電機 | 218.5 | 167.4 | 427,121 |
| マブチモーター | 89.5 | 149.2 | 420,296 |
| 日東工業 | 125 | 88.7 | 392,497 |
| I D E C | 100 | 140.5 | 384,127 |
| パナソニック ホールディングス | 284.5 | 269.9 | 396,078 |
| カシオ計算機 | 259.2 | 330.7 | 424,288 |
| S C R E E Nホールディングス | 29.9 | 21 | 396,690 |
| キヤノン | 115.2 | 92.8 | 419,177 |

しんきん好配当利回り株マザーファンド ー 第 19 期 ー

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 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 | 7.3 | 10.6 | 417,004 | |
| 輸送用機器 (7.0%) | | | | |
| デンソー | 46.4 | 147 | 431,004 | |
| いすゞ自動車 | 207.1 | 189.5 | 399,560 | |
| トヨタ自動車 | 180.3 | 110.6 | 420,169 | |
| アイシン | 90.3 | 71.4 | 431,184 | |
| 本田技研工業 | 95 | 225.4 | 426,006 | |
| SUBARU | 153.3 | 120.8 | 412,048 | |
| 精密機器 (1.2%) | | | | |
| ニコン | 250.7 | 264.4 | 435,202 | |
| その他製品 (1.1%) | | | | |
| 任天堂 | 64.5 | 47.5 | 397,955 | |
| 電気・ガス業 (1.2%) | | | | |
| 中部電力 | 236.7 | 207.3 | 417,502 | |
| 陸運業 (2.3%) | | | | |
| 九州旅客鉄道 | 112 | 115.9 | 415,965 | |
| NIPPON EXPRESSホールディングス | 43.8 | 51.4 | 396,602 | |
| 倉庫・運輸関連業 (1.1%) | | | | |
| 住友倉庫 | 147.5 | 155.2 | 399,950 | |
| 情報・通信業 (6.8%) | | | | |
| B I P R O G Y | 106.4 | 87.1 | 411,634 | |
| 日本テレビホールディングス | 294.9 | 186.7 | 399,538 | |
| 日本電信電話 | 85.4 | 2,163.6 | 389,880 | |
| ソフトバンク | 219.3 | 205.1 | 415,019 | |
| S C S K | 169.3 | 140.9 | 413,259 | |
| T K C | 91.5 | 107.8 | 409,640 | |
| 卸売業 (5.7%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 81.5 | 60.7 | 400,802 | |
| 三井物産 | 82.7 | 60.6 | 430,744 | |
| 住友商事 | 142.2 | 114.3 | 425,310 | |
| サンゲツ | 139.7 | 116.1 | 391,257 | |
| 因幡電機産業 | 117.7 | 113.7 | 399,087 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------------------|---------|--------|---------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小売業 (3.5%) | | | | |
| ローソン | 61.7 | — | — | |
| 日本瓦斯 | 177.3 | 165.2 | 439,762 | |
| ヤマダホールディングス | 705.2 | 916.3 | 411,876 | |
| サンドラッグ | 95.1 | 86.5 | 417,968 | |
| 銀行業 (6.4%) | | | | |
| あおぞら銀行 | 129.6 | 50.8 | 127,254 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 357.3 | 259.2 | 407,592 | |
| りそなホールディングス | 462.3 | 482.6 | 446,163 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 65.8 | 129.8 | 433,012 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 57.3 | 48.2 | 429,558 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 160.5 | 143.4 | 436,366 | |
| 証券、商品先物取引業 (2.5%) | | | | |
| 大和証券グループ本社 | 527.4 | 369 | 433,944 | |
| 野村ホールディングス | 605.8 | 467.2 | 462,060 | |
| 保険業 (3.6%) | | | | |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 75.5 | 54.2 | 433,762 | |
| 東京海上ホールディングス | 118.5 | 91.5 | 437,919 | |
| T&Dホールディングス | 167.4 | 152 | 412,604 | |
| 不動産業 (2.3%) | | | | |
| 大東建託 | 25.5 | 23 | 406,525 | |
| 野村不動産ホールディングス | 112.4 | 101 | 411,777 | |
| サービス業 (4.5%) | | | | |
| H. U. グループホールディングス | 121.7 | 152.2 | 389,023 | |
| ユー・エス・エス | 150.4 | 148.9 | 391,979 | |
| 日本郵政 | 279 | 273.7 | 427,656 | |
| メイテックグループホールディングス | 137.4 | 131.9 | 402,690 | |
| 合 計 | 株数・金額 | 16,033 | 17,619 | 35,894,529 |
| | 銘柄数<比率> | 88 | 87 | <99.4%> |

(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) 評価額欄の< >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り捨て。

(注4) 一印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2024年3月21日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 35,894,529 | 99.0 |
| コール・ローン等、その他 | 363,110 | 1.0 |
| 投資信託財産総額 | 36,257,639 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月21日現在)

○損益の状況 (2023年3月21日～2024年3月21日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 36,257,639,252 |
| コール・ローン等 | 299,812,520 |
| 株式(評価額) | 35,894,529,530 |
| 未収配当金 | 63,297,200 |
| 未収利息 | 2 |
| (B) 負債 | 160,003,177 |
| 未払解約金 | 160,000,000 |
| その他未払費用 | 3,177 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 36,097,636,075 |
| 元本 | 8,738,473,059 |
| 次期繰越損益金 | 27,359,163,016 |
| (D) 受益権総口数 | 8,738,473,059口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 41,309円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,142,821,182 |
| 受取配当金 | 1,142,125,870 |
| 受取利息 | 2 |
| その他収益金 | 805,610 |
| 支払利息 | △ 110,300 |
| (B) 有価証券売買損益 | 12,954,932,105 |
| 売買益 | 13,215,019,516 |
| 売買損 | △ 260,087,411 |
| (C) 保管費用等 | △ 121,247 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 14,097,632,040 |
| (E) 前期繰越損益金 | 17,901,095,160 |
| (F) 追加信託差損益金 | 5,474,040,749 |
| (G) 解約差損益金 | △10,113,604,933 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 27,359,163,016 |
| 次期繰越損益金(H) | 27,359,163,016 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は10,414,858,873円、期中追加設定元本額は2,379,679,251円、期中一部解約元本額は4,056,065,065円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,234,450,421円
 しんきん好配当利回り株ファンド(3ヵ月決算型) 1,631,865,562円
 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 827,903,232円
 しんきん3資産ファンド(1年決算型) 355,754,343円
 しんきん世界アロケーションファンド 229,165,970円
 しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 214,463,020円
 しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 184,555,140円
 しんきん好配当利回り株スペシャルII(適格機関投資家限定) 60,315,371円

(注3) 1口当たり純資産額は4,1309円です。

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年9月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

第19期

(決算日：2024年5月10日)

しんきん世界好配当利回り株マザーファンドの第19期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①日本を除く世界各国の配当利回りの高い企業の株式へ分散投資を行うことにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。</p> <p>②運用指図に関する権限は、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。</p> <p>③株式の銘柄選定にあたっては、銘柄毎の配当利回り・増配期待・流動性に着目しつつ、企業のファンダメンタル分析も勘案して行います。</p> <p>④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑤株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>⑥資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。</p> |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>③新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合には、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>④同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額10%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合には、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑦投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 参考指標※ | | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|--------|--------|-------|--------|------------|--------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | | |
| 15期(2020年5月11日) | 16,723 | △24.6% | 23,573 | △2.8% | 93.0% | — | 15,840 |
| 16期(2021年5月10日) | 27,302 | 63.3% | 35,185 | 49.3% | 98.1% | — | 25,898 |
| 17期(2022年5月10日) | 32,490 | 19.0% | 39,136 | 11.2% | 96.9% | — | 23,763 |
| 18期(2023年5月10日) | 37,853 | 16.5% | 43,478 | 11.1% | 93.5% | — | 27,298 |
| 19期(2024年5月10日) | 47,086 | 24.4% | 62,590 | 44.0% | 98.2% | — | 30,671 |

(注) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 参考指標※ | | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|--------------------|--------|-------|--------|-------|--------|------------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| (期首) 2023年5月10日 | 37,853 | — | 43,478 | — | 93.5% | — |
| 5月末 | 37,806 | △0.1% | 44,947 | 3.4% | 94.0% | — |
| 6月末 | 39,903 | 5.4% | 49,389 | 13.6% | 94.8% | — |
| 7月末 | 40,597 | 7.2% | 50,205 | 15.5% | 97.5% | — |
| 8月末 | 41,079 | 8.5% | 50,238 | 15.5% | 96.5% | — |
| 9月末 | 40,447 | 6.9% | 49,213 | 13.2% | 95.9% | — |
| 10月末 | 38,630 | 2.1% | 48,561 | 11.7% | 96.1% | — |
| 11月末 | 40,941 | 8.2% | 51,899 | 19.4% | 98.5% | — |
| 12月末 | 41,637 | 10.0% | 51,957 | 19.5% | 98.2% | — |
| 2024年1月末 | 42,746 | 12.9% | 54,413 | 25.2% | 98.6% | — |
| 2月末 | 43,309 | 14.4% | 58,145 | 33.7% | 98.5% | — |
| 3月末 | 45,902 | 21.3% | 60,723 | 39.7% | 98.8% | — |
| 4月末 | 46,428 | 22.7% | 60,871 | 40.0% | 97.2% | — |
| (期末) 2024年5月10日 | 47,086 | 24.4% | 62,590 | 44.0% | 98.2% | — |

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※参考指標はMSCI-KOKUSAI インデックス（除く日本・米ドルベース）を円換算し、2005年11月14日を10,000としてしんきんアセットマネジメント投信が算出したものです。（以下同じ。）

※ここに掲載される全ての情報は、信頼の置ける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCIは何ら保証するものではありません。

※この情報はMSCIの営業秘密であり、またその著作権はMSCIに帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いて出版物、資料、データ等の全部または一部を複製・頒布・使用等することは禁じられています。

○第19期の運用経過等（2023年5月11日～2024年5月10日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、世界の先進国・地域（日本を除く）の株式に投資することにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目指して運用を行っています。

当期における基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

＜上昇要因＞

- ・堅調な経済指標を受けて米国の景気後退懸念が和らいだこと。
- ・人工知能（A I）関連テクノロジーに対する需要をめぐり、楽観的な見方が広がったこと。
- ・米国政府の債務上限問題が与野党の合意により解決に至ったこと。

＜下落要因＞

- ・米国インフレ指標の上振れを受けて、米連邦準備制度理事会（F R B）の利下げ開始時期が後ずれするとの懸念が広がったこと。
- ・イスラエルとハマスの紛争が勃発し、地政学リスクが高まったこと。
- ・中国経済の成長に対する懸念が高まったこと。

＜投資環境＞

(2023年5～6月)

グローバル株式市場は上昇しました。A Iの普及に対する期待を背景とした情報技術銘柄の上昇が、相場をけん引しました。

市場別に見ると、米国株式市場は上昇しました。主要テクノロジー企業の好決算などを受け、A Iの普及に対する期待が高まったほか、米国政府の債務上限問題が与野党の合意により解決に至ったことや堅調な経済指標を受けて米国の景気後退懸念が和らいだことなどが、相場のプラス要因となりました。F R Bは5月の米連邦公開市場委員会（F O M C）で0.25%の利上げを実施した後、6月に11会合ぶりに政策金利の据え置きを決定しました。ユーロ圏株式市場は上昇しました。情報技術銘柄に加え、金利の先高観により、金融銘柄が上昇をけん引しました。欧州中央銀行（E C B）は5月の0.25%の利上げに続き、6月も0.25%の利上げを実施しました。

(2023年7～9月)

グローバル株式市場は下落しました。FRBが政策金利を長期間にわたり高水準に維持するとの見通しを示したことで、金利上昇による主要国の経済成長に及ぼす影響や、中国経済の成長に対する懸念がマイナス要因となりました。

市場別に見ると、米国株式市場は下落しました。インフレが鈍化傾向にあることやおおむね米国企業の決算が市場予想を上回る内容であったことなどを受け、景気のソフトランディング期待が高まり、7月は上昇しましたが、8月以降、金融引締めに対する懸念が高まり、下落に転じました。FRBは7月のFOMCで2会合ぶりに0.25%の利上げを実施しました。9月のFOMCでは政策金利を据え置きましたが、参加者の金利予測分布図において、年内あと1回の利上げの可能性に加え、政策金利を長期間にわたり高水準に維持するとの見通しが示されました。ユーロ圏株式市場は下落しました。ECBは7月と9月にそれぞれ0.25%の利上げを実施しました。

(2023年10～12月)

グローバル株式市場は上昇しました。イスラエルとハマスの紛争が勃発し、地政学リスクが高まったことで10月は下落しましたが、中東情勢における過度な懸念が後退したことや、インフレ圧力の低下を受けて、投資家の間では欧米の金利がピークに達したとの楽観的な見方が広がったことで上昇に転じました。

市場別に見ると、米国株式市場は上昇しました。インフレ減速を背景に、FRBによる利下げ開始が目前に迫っているとの期待が支援材料となりました。情報技術や不動産等の金利感応度が高いセクターの上昇が目立った一方で、エネルギーセクターは下落しました。ユーロ圏株式市場は上昇しました。金利がピークに達したとの見方が追い風となりました。米国株式同様、不動産や情報技術セクターが優位に展開する相場となりました。一方で、ヘルスケアやエネルギーセクターは下落しました。

(2024年1～3月)

グローバル株式市場は上昇しました。2024年後半に主要中央銀行が利下げを開始するとの期待が追い風となりました。

市場別に見ると、米国株式市場は上昇しました。2024年後半に利下げが開始されるとの期待や好調な企業決算等が支援材料となりました。ユーロ圏株式市場は上昇しました。AI関連テクノロジーに対する需要をめぐり、楽観的な見方が広がったことを受けて、情報技術セクターが市場をけん引しました。そのほか、金融や一般消費財・サービス、資本財・サービス等のセクターも堅調に推移しました。

(2024年4～5月)

グローバル株式市場はほぼ横ばいとなりました。米国インフレ指標の上振れを受けて、FRBの利下げ開始時期が後ずれするとの懸念が広がったものの、その後に発表された4月の米雇用統計では、非農業部門の雇用者数の伸びが市場予想を下回ったことから、懸念が後退しました。

市場別に見ると、米国株式市場はほぼ横ばいとなりました。市場予想を上回る米国インフレ率の発表を受けて、早期利下げ期待が後退したものの、その後に発表された米雇用統計を受け、米労働市場の過熱感が薄れる方向にあるとの見方が広がりました。ユーロ圏株式市場はほぼ横ばいとなりました。米国における利下げをめぐる思わくから、一時下落しましたが、その後元の価格水準まで値を戻す展開となりました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

設定・解約および個別銘柄の収益見通し、配当方針、株主への利益還元などの要素に加え、株価の割安度合いなどに対する判断結果から、必要に応じて銘柄の加除および入替え等を行った結果、組入銘柄数は期首の40銘柄に対し、期末時点では44銘柄になりました。

なお、運用の指図に関する権限は、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託しています。

（業種構成）

参考指標（MSCI-KOKUSAIインデックス）対比で見た業種別の期中平均組入比率は、次の表のとおりです。

| 業 種 | ポ ー ト フ ォ リ オ | 参 考 指 標 | 差 異 |
|----------------|---------------|---------|--------|
| 金融 | 20.6% | 15.1% | + 5.4% |
| コミュニケーション・サービス | 17.7% | 7.3% | +10.4% |
| ヘルスケア | 13.4% | 12.8% | + 0.7% |
| 生活必需品 | 11.8% | 7.1% | + 4.7% |
| 一般消費財・サービス | 9.6% | 10.3% | △ 0.7% |
| 情報技術 | 7.6% | 23.3% | △15.7% |
| 資本財・サービス | 6.1% | 10.2% | △ 4.1% |
| エネルギー | 5.9% | 4.9% | + 1.0% |
| 素材 | 5.4% | 4.0% | + 1.4% |
| 不動産 | 1.9% | 2.3% | △ 0.4% |
| 公益事業 | 0.0% | 2.7% | △ 2.7% |

※比率は株式部分のみを計算。計算にはBloombergを使用

業種別の期中平均組入比率は、「コミュニケーション・サービス」、「金融」などの業種を参考指標と比較して高位とし、「情報技術」、「資本財・サービス」などの業種を低位としました。

「金融」、「情報技術」などの組入れが、ポートフォリオ（米ドルベース）の騰落率に対して主なプラス要因になり、「ヘルスケア」、「コミュニケーション・サービス」などの組入れが、主なマイナス要因になりました。

(国別構成)

参考指標 (MSCI-KOKUSAIインデックス) 対比で見た国別の期中平均組入比率は、次の表のとおりです。

| 地 域 | 国 名 | ポートフォリオ | 参 考 指 標 | 差 異 |
|--------------|----------|---------|---------|--------|
| 北米地域 | アメリカ | 35.4% | 74.6% | △39.2% |
| | カナダ | 0.0% | 3.4% | △ 3.4% |
| 欧州地域 | イギリス | 21.3% | 4.2% | +17.1% |
| | ドイツ | 16.6% | 2.4% | +14.1% |
| | フランス | 10.0% | 3.5% | + 6.5% |
| | イタリア | 4.5% | 0.8% | + 3.8% |
| | スイス | 4.4% | 2.8% | + 1.5% |
| | ベルギー | 3.0% | 0.3% | + 2.7% |
| | オランダ | 2.7% | 1.3% | + 1.3% |
| | スペイン | 2.1% | 0.8% | + 1.4% |
| | スウェーデン | 0.0% | 0.9% | △ 0.9% |
| | デンマーク | 0.0% | 1.0% | △ 1.0% |
| | フィンランド | 0.0% | 0.3% | △ 0.3% |
| | ノルウェー | 0.0% | 0.2% | △ 0.2% |
| | アイルランド | 0.0% | 0.1% | △ 0.1% |
| | イスラエル | 0.0% | 0.2% | △ 0.2% |
| | ポルトガル | 0.0% | 0.1% | △ 0.1% |
| オーストリア | 0.0% | 0.1% | △ 0.1% | |
| アジア・パシフィック地域 | シンガポール | 0.0% | 0.4% | △ 0.4% |
| | オーストラリア | 0.0% | 2.1% | △ 2.1% |
| | 香港 | 0.0% | 0.6% | △ 0.6% |
| | ニュージーランド | 0.0% | 0.1% | △ 0.1% |

※比率は株式部分のみを計算。計算にはBloombergを使用

国別の期中平均組入比率は、「イギリス」、「ドイツ」などの国を参考指標と比較して高位とし、「アメリカ」、「カナダ」などの国を低位としました。

「アメリカ」、「イギリス」などの組入れが、ポートフォリオ (米ドルベース) の騰落率に対して主なプラス要因になり、「ドイツ」の組入れが、主なマイナス要因になりました。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当ファンドは、世界の先進国・地域 (日本を除く) の株式に投資することにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目指していますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークはありません。

当期の基準価額の騰落率は+24.4%となり、同期間の参考指標の騰落率+44.0%を19.6ポイント下回りました。主な要因は、業種別ではコミュニケーション・サービスやヘルスケアでの銘柄選択、国別ではアメリカやドイツなどでの銘柄選択がマイナスに寄与したことです。

＜今後の運用方針＞

引き続き、経営力に秀で、質の高い、収益見通しのより明瞭な銘柄の発掘に注力し、特に明確な配当方針を持つ企業や、株主への利益還元真剣に取り組む姿勢を明らかにしている企業を選好して投資するとともに、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

また、株式組入比率は、原則として高位を保つこととし、銘柄の加除および入替え等が必要な場合は随時行っていきます。

なお、運用の指図に関する権限は、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 5 月11日～2024年 5 月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|---------------------|-----------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) | 円 9 (9) | % 0.022 (0.022) | (a) 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 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) | 14 (14) | 0.033 (0.033) | (b) 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 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 14 (14) (0) | 0.035 (0.034) (0.001) | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 37 | 0.090 | |
| 期中の平均基準価額は、41,618円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年5月11日～2024年5月10日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|------|-------------|------------------|-------------|------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | 百株 9,740 | 千ドル 35,774 | 百株 8,923 | 千ドル 34,455 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ドイツ | 3,851 | 7,316 | 1,995 | 7,260 |
| | イタリア | 3,017 | 1,306 | 9,165 | 3,559 |
| | フランス | 1,767 | 2,936 | 5,993 | 8,003 |
| | オランダ | 1,935 | 4,523 | 487 | 824 |
| | スペイン | 446 | 633 | 334 | 500 |
| | ベルギー | 177 | 678 | 1,498 | 5,356 |
| | イギリス | 34,415 | 千ポンド 10,111 | 25,671 | 千ポンド 12,000 |
| | スイス | 1,417 | 千スイスフラン 9,737 | 731 | 千スイスフラン 3,806 |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2023年5月11日～2024年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 23,615,767千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 28,983,303千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.81 |

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月11日～2024年5月10日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年5月10日現在)

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------|---------|---------|--------|-----------|------------------------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千ドル | 千円 | | |
| BEST BUY CO INC | — | 501 | 3,718 | 579,021 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 524 | 857 | 3,835 | 597,217 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CITIGROUP INC | 826 | 703 | 4,451 | 693,092 | 銀行 | |
| EBAY INC | 1,006 | 836 | 4,210 | 655,643 | 一般消費財・サービス流通・小売り | |
| HP INC | — | 1,372 | 4,068 | 633,458 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 336 | 153 | 2,547 | 396,659 | ソフトウェア・サービス | |
| INTEL CORP | 2,177 | 676 | 2,034 | 316,772 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MANPOWER INC | — | 632 | 4,822 | 750,888 | 商業・専門サービス | |
| MARCUS & MILLICHAP INC | — | 785 | 2,671 | 415,986 | 不動産管理・開発 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 815 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 | |
| PFIZER INC | 1,043 | 1,633 | 4,602 | 716,538 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 564 | 589 | 5,198 | 809,411 | 資本財 | |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO | 1,045 | 793 | 4,666 | 726,585 | 食品・飲料・タバコ | |
| VIATRIS INC | 3,318 | 2,469 | 2,770 | 431,415 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 1,504 | 1,555 | 6,188 | 963,543 | 電気通信サービス | |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,512 | 1,888 | 3,257 | 507,126 | 生活必需品流通・小売り | |
| WILEY (JOHN) & SONS-CLASS A | — | 672 | 2,627 | 409,113 | メディア・娯楽 | |
| WESTERN UNION CO | 3,518 | 2,891 | 3,843 | 598,403 | 金融サービス | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 18,195 | 19,011 | 65,516 | 10,200,877 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 13 | 17 | — | < 33.3% > |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | | 千ユーロ | |
| BASF SE | 1,009 | 1,053 | 5,253 | 881,625 | 素材 | |
| BAYER AG | 686 | 1,205 | 3,457 | 580,323 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | |
| CONTINENTAL AG | 906 | 946 | 5,737 | 962,922 | 自動車・自動車部品 | |
| HEIDELBERG MATERIALS AG | 518 | — | — | — | 素材 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VOR-PREF | 781 | 815 | 6,728 | 1,129,191 | 家庭用品・パーソナル用品 | |
| RTL GROUP S.A. | 1,129 | 1,178 | 3,494 | 586,544 | メディア・娯楽 | |
| Schaeffler AG Preference NPV | 5,024 | 6,712 | 4,278 | 718,143 | 自動車・自動車部品 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 10,056 | 11,912 | 28,950 | 4,858,751 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 7 | 6 | — | < 15.8% > |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| ENI SPA | 2,733 | 2,355 | 3,541 | 594,373 | エネルギー | |
| INTESA SANPAOLOA | 19,297 | 13,526 | 4,841 | 812,598 | 銀行 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 22,030 | 15,882 | 8,383 | 1,406,972 |
| | 銘柄 数 | < 比 率 > | 2 | 2 | — | < 4.6% > |

しんきん世界好配当利回り株マザーファンド ー第 19 期ー

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------|-------------------------------|---------------|---------------|-------------|-------------------------|------------------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…フランス) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| | AXA SA | 1,537 | 1,605 | 5,369 | 901,094 | 保険 |
| | ORANGE | 5,807 | 4,584 | 4,847 | 813,629 | 電気通信サービス |
| | SANOFI | 601 | 410 | 3,825 | 642,081 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| | SES GLOBAL-FDR | 7,024 | 4,144 | 1,923 | 322,895 | メディア・娯楽 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 14,970 4 | 10,744 4 | 15,966 — | 2,679,701 < 8.7% > | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | — | 1,314 | 3,873 | 650,058 | 生活必需品流通・小売り |
| | ING GROEP NV | 3,035 | 3,168 | 5,080 | 852,668 | 銀行 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 3,035 1 | 4,483 2 | 8,953 — | 1,502,726 < 4.9% > | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| | REPSOL SA | 2,558 | 2,670 | 3,943 | 661,816 | エネルギー |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 2,558 1 | 2,670 1 | 3,943 — | 661,816 < 2.2% > | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| | AGEAS | 1,015 | 1,060 | 4,782 | 802,676 | 保険 |
| | COLRUYT SA | 1,366 | — | — | — | 生活必需品流通・小売り |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 2,382 2 | 1,060 1 | 4,782 — | 802,676 < 2.6% > | |
| ユ ー ロ 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 55,033 17 | 46,753 16 | 70,980 — | 11,912,644 < 38.8% > | |
| (イギリス) | | | | 千ポンド | | |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 500 | 1,699 | 4,649 | 906,511 | 素材 |
| | BT GROUP PLC | 25,221 | 32,618 | 3,457 | 674,046 | 電気通信サービス |
| | GSK PLC | 3,560 | 2,132 | 3,796 | 740,135 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| | ITV PLC | 57,721 | 60,256 | 4,615 | 899,821 | メディア・娯楽 |
| | NATWEST GROUP PLC | 12,803 | 16,880 | 5,364 | 1,045,811 | 銀行 |
| | SHELL PLC | 1,390 | — | — | — | エネルギー |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 5,516 | 5,083 | 3,836 | 747,979 | 銀行 |
| | TESCO PLC | 15,095 | 10,788 | 3,346 | 652,417 | 生活必需品流通・小売り |
| | WPP PLC | 3,674 | 4,769 | 3,964 | 772,867 | メディア・娯楽 |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 125,484 9 | 134,227 8 | 33,032 — | 6,439,591 < 21.0% > | |
| (スイス) | | | | 千スイスフラン | | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | — | 510 | 1,683 | 289,141 | 商業・専門サービス |
| | SWISS RE AG | 340 | 296 | 3,071 | 527,414 | 保険 |
| | SWATCH GROUP AG | — | 217 | 4,274 | 734,023 | 耐久消費財・アパレル |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 340 1 | 1,025 3 | 9,029 — | 1,550,579 < 5.1% > | |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 199,053 40 | 201,018 44 | — — | 30,103,692 < 98.2% > | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2024年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 30,103,692 | 97.4 |
| コール・ローン等、その他 | 797,380 | 2.6 |
| 投資信託財産総額 | 30,901,072 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (30,576,848千円) の投資信託財産総額 (30,901,072千円) に対する比率は99.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年5月10日現在、1ドル=155.70円、1ユーロ=167.83円、1ポンド=194.95円、1スイスフラン=171.72円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月10日現在)

○損益の状況 (2023年5月11日～2024年5月10日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 30,901,072,978 |
| コール・ローン等 | 719,346,205 |
| 株式(評価額) | 30,103,692,950 |
| 未収配当金 | 78,033,735 |
| 未収利息 | 88 |
| (B) 負債 | 230,000,000 |
| 未払解約金 | 230,000,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 30,671,072,978 |
| 元本 | 6,513,821,832 |
| 次期繰越損益金 | 24,157,251,146 |
| (D) 受益権総口数 | 6,513,821,832口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 47,086円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,329,245,563 |
| 受取配当金 | 1,329,350,980 |
| 受取利息 | 1,628 |
| その他収益金 | 47,618 |
| 支払利息 | △ 154,663 |
| (B) 有価証券売買損益 | 5,207,919,973 |
| 売益 | 7,667,355,599 |
| 売買損 | △ 2,459,435,626 |
| (C) 保管費用等 | △ 10,372,902 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 6,526,792,634 |
| (E) 前期繰越損益金 | 20,086,922,511 |
| (F) 追加信託差損益金 | 3,182,003,657 |
| (G) 解約差損益金 | △ 5,638,467,656 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 24,157,251,146 |
| 次期繰越損益金(H) | 24,157,251,146 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は7,211,673,673円、期中追加設定元本額は1,049,196,343円、期中一部解約元本額は1,747,048,184円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
 しんきん世界好配当利回り株ファンド (毎月決算型) 5,064,865,576円
 しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 737,727,539円
 しんきん世界好配当利回り株ファンド (1年決算型) 534,575,674円
 しんきんグローバル6資産ファンド (1年決算型) 176,653,043円

(注3) 1口当たり純資産額は4.7086円です。

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年8月5日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん国内債券マザーファンドⅡ

第18期

(決算日：2024年6月12日)

しんきん国内債券マザーファンドⅡの第18期に係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とおりです。

| | |
|--------|---|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①この投資信託は、主として我が国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。</p> <p>②「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとします。</p> <p>③投資対象とする公社債は、組入れ段階においていずれかの信用格付業者等からBBB格相当以上の長期信用格付けを取得しているものとします。</p> <p>④国内企業およびそれに準じる発行体の発行するユーロ円建資産および外国企業の発行する円建資産・ユーロ円建資産を組入れることがあります。</p> <p>⑤運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築をはかります。</p> |
| 主要投資対象 | 我が国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資は行いません。</p> <p>②同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>③投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | D B I | 総合※ | | 債組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|---------|------|------|--------|------|
| | 円 | 騰落率 | | ポイント | 騰落率 | | |
| 14期(2020年6月12日) | 13,291 | △0.9 | 532.360 | △1.2 | 96.9 | 10,541 | |
| 15期(2021年6月14日) | 13,349 | 0.4 | 532.534 | 0.0 | 99.3 | 13,766 | |
| 16期(2022年6月13日) | 13,004 | △2.6 | 517.112 | △2.9 | 99.0 | 11,845 | |
| 17期(2023年6月12日) | 13,017 | 0.1 | 515.481 | △0.3 | 99.7 | 10,335 | |
| 18期(2024年6月12日) | 12,448 | △4.4 | 492.807 | △4.4 | 99.5 | 17,970 | |

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | D B I | 総合※ | | 債組入比率 |
|--------------------|--------|------|---------|------|------|-------|
| | 円 | 騰落率 | | ポイント | 騰落率 | |
| (期首) 2023年6月12日 | 13,017 | — | 515.481 | — | 99.7 | |
| 6月末 | 13,051 | 0.3 | 516.779 | 0.3 | 99.4 | |
| 7月末 | 12,843 | △1.3 | 508.731 | △1.3 | 99.1 | |
| 8月末 | 12,749 | △2.1 | 505.088 | △2.0 | 98.5 | |
| 9月末 | 12,657 | △2.8 | 501.436 | △2.7 | 98.5 | |
| 10月末 | 12,464 | △4.2 | 493.357 | △4.3 | 98.8 | |
| 11月末 | 12,725 | △2.2 | 503.781 | △2.3 | 98.9 | |
| 12月末 | 12,779 | △1.8 | 505.836 | △1.9 | 99.4 | |
| 2024年1月末 | 12,686 | △2.5 | 502.190 | △2.6 | 98.6 | |
| 2月末 | 12,728 | △2.2 | 503.843 | △2.3 | 98.2 | |
| 3月末 | 12,711 | △2.4 | 503.272 | △2.4 | 99.0 | |
| 4月末 | 12,565 | △3.5 | 497.541 | △3.5 | 98.7 | |
| 5月末 | 12,365 | △5.0 | 489.572 | △5.0 | 99.1 | |
| (期末) 2024年6月12日 | 12,448 | △4.4 | 492.807 | △4.4 | 99.5 | |

(注) 騰落率は期首比です。

※「ダイワ・ボンド・インデックス」(DBI)とは、日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定するように設計された指数で、株式会社大和総研が計算、公表しています。算出対象範囲が広く、日本の債券市場全体の動きを代表しています。債券価格の変動に加えて、日々のクーポン収入も加味されて算出されます。

※ダイワ・ボンド・インデックスに関する著作権等知的財産権は大和証券株式会社および株式会社大和総研に帰属します。なお、大和証券株式会社および株式会社大和総研は当ファンドの運用と何ら関係はありません。

○第18期の運用経過等（2023年6月13日～2024年6月12日）

<当期中の基準価額等の推移>

【基準価額の推移】



【ダイワ・ボンド・インデックス総合の推移】



当ファンドは、「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとし、我が国の公社債に投資を行っています。

当期の基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・日銀がマイナス金利解除などの金融政策の正常化を見送ったこと。
- ・米国でのインフレ鈍化に伴い、米国金利が低下したこと。

<下落要因>

- ・日銀がマイナス金利解除を決定したこと。
- ・日銀が国債の買入れ額を減額したこと。
- ・早期の米利下げ観測が後退したこと。

<投資環境>

(2023年6月～7月中旬)

当期間の長期金利は0.4%近辺での推移が続きました。日銀が大規模な金融緩和を維持したことから0.35%程度まで低下する場面があったものの、30年国債入札が低調だったことや米国の金融引締めが長期化するとの見方から0.4%台に上昇し、その後は0.4%台でもみ合う展開が続きました。

(2023年7月下旬～10月)

当期間の長期金利は上昇基調での推移が続きました。7月下旬、日銀金融政策決定会合で長期金利が許容上限の0.5%を超えることを容認する柔軟な政策運営が決定されたことを受け、長期金利は0.5%台後半まで上昇しました。その後、米国長期金利が上昇したことや植田総裁がマイナス金利解除に言及したこと等から上昇基調が続き、10月末には0.9%台半ばまで上昇しました。10月末の金融政策決定会合で日銀は長期金利の事実上の上限としていた1%を一定程度上回ることを容認しましたが、市場への影響は限定的でした。

(2023年11月～2024年1月中旬)

当期間の長期金利は低下基調での推移が続きました。11月、米国でのインフレ鈍化に伴う米国金利の低下や日銀が国債購入を減額しなかったこと等を受け、長期金利は0.7%を割り込みました。12月、植田総裁が「年末から来年にかけて一段とチャレンジングになる」と述べたことから、早期のマイナス金利解除への思わくが強まり、長期金利は一時0.8%まで上昇しましたが、その後の日銀金融政策決定会合で大規模緩和が維持されたことや、植田総裁が政策修正を示唆しなかったことから、早期のマイナス金利解除への思わくが大きく後退し、長期金利は0.6%程度まで低下しました。2024年1月は1日に発生した能登半島地震が経済に与える影響を見極めるため、1月の日銀金融政策決定会合で政策修正を見送るとの観測が強まり、長期金利は0.55%程度まで低下しました。

(2024年1月下旬～3月中旬)

当期間の長期金利は上昇後、0.7%前後を中心とした動きが続きました。1月中旬から月末にかけては、早期の米利下げ観測が後退したことや植田総裁が2%の物価目標の実現に向けた確度が少しずつ高まっているなどと述べたことから、マイナス金利解除などの金融政策の正常化に向けた思わくが広がり、長期金利は一時0.7%台後半まで上昇しました。

(2024年3月下旬～6月)

当期間の長期金利は上昇基調での推移が続きました。日銀は3月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利の解除を決定し、市場で年内追加利上げへの観測が高まったことで、長期金利は上昇しました。さらに、5月中旬に日銀が5年超10年以下の国債買入れ額を減額したことや、底堅い景気を背景に早期の米利下げ観測が後退したことから、長期金利は一時1.1%と約13年ぶりの水準まで上昇しました。当期末時点での長期金利は1%程度で推移しています。

<当ファンドのポートフォリオ>

当期のベンチマークに対する修正デュレーション（金利感応度）および債券種別構成の調整は、以下のとおり行いました。

①修正デュレーション（金利感応度）

修正デュレーションは、ベンチマーク対比でおおむね中立となるよう調整し、調整範囲はベンチマーク対比で $\Delta 0.30 \sim +0.30$ 年程度としました。

②債券種別構成

債券種別構成は、国債を中心とし、国債以外の債券の構成比率がベンチマーク対比でおおむね中立となるよう調整しました。

2024年6月12日時点におけるファンドの修正デュレーションは8.79年、最終利回りは0.97%、国内債券の組入比率は99.5%となっています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当期の基準価額の騰落率は $\Delta 4.37\%$ となり、ベンチマークである「ダイワ・ボンド・インデックス総合」の騰落率 $\Delta 4.40\%$ を上回りました。

当期を通じて修正デュレーションは、ベンチマーク対比でおおむね中立となるよう調整しましたが、相対的に収益率の高かった残存期間の債券をベンチマークに比べて多めに保有していたことがプラスに寄与しました。

<今後の運用方針>

引き続き、「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとし、主として我が国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2023年6月13日～2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|------------------------------|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 0 | % 0.001 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (そ の 他) | (0) | (0.001) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 0 | 0.001 | |
| 期中の平均基準価額は、12,693円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年6月13日～2024年6月12日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|----------------|------------|-----------------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 12,529,315 | 4,298,493 |
| | 地方債証券 | 100,657 | 100,076 (100,000) |
| 内 | 特殊債券 | 102,452 | — |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | — | — (100,000) |

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月13日～2024年6月12日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年6月12日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 | | | 末 | | | |
|---------------------|--------------|--------------|---------|---------------------|-----------|--------|--------|
| | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 組 入 比 率 | うちB B格以下 組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 16,440,000 | 15,596,763 | 86.8 | — | 65.6 | 13.8 | 7.4 |
| 地方債証券 | 1,100,000 | 1,091,038 | 6.1 | — | 0.5 | 3.9 | 1.7 |
| | (1,100,000) | (1,091,038) | (6.1) | (—) | (0.5) | (3.9) | (1.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 300,000 | 298,629 | 1.7 | — | 0.6 | 1.1 | — |
| | (300,000) | (298,629) | (1.7) | (—) | (0.6) | (1.1) | (—) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 900,000 | 888,252 | 4.9 | — | 0.5 | 2.2 | 2.2 |
| | (900,000) | (888,252) | (4.9) | (—) | (0.5) | (2.2) | (2.2) |
| 合 計 | 18,740,000 | 17,874,682 | 99.5 | — | 67.2 | 20.9 | 11.3 |
| | (2,300,000) | (2,277,919) | (12.7) | (—) | (1.6) | (7.1) | (3.9) |

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 | 柄 | 当 期 | | | 償 還 年 月 日 |
|-----------------|---|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | | | |
| 第150回利付国債 (20年) | | 1.4 | 350,000 | 362,701 | 2034/9/20 |
| 第144回利付国債 (5年) | | 0.1 | 340,000 | 339,687 | 2025/6/20 |
| 第145回利付国債 (5年) | | 0.1 | 500,000 | 499,300 | 2025/9/20 |
| 第147回利付国債 (5年) | | 0.005 | 500,000 | 497,490 | 2026/3/20 |
| 第148回利付国債 (5年) | | 0.005 | 500,000 | 496,740 | 2026/6/20 |
| 第150回利付国債 (5年) | | 0.005 | 500,000 | 495,565 | 2026/12/20 |
| 第154回利付国債 (5年) | | 0.1 | 500,000 | 494,995 | 2027/9/20 |
| 第14回利付国債 (40年) | | 0.7 | 370,000 | 230,484 | 2061/3/20 |
| 第346回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 496,230 | 2027/3/20 |
| 第354回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 489,430 | 2029/3/20 |
| 第355回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 488,650 | 2029/6/20 |
| 第357回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 487,160 | 2029/12/20 |
| 第360回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 483,865 | 2030/9/20 |
| 第361回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 482,645 | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 481,235 | 2031/3/20 |
| 第363回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 479,605 | 2031/6/20 |
| 第364回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 477,920 | 2031/9/20 |

しんきん国内債券マザーファンドⅡ ー第18期ー

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|---------------------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | % | 千 円 | 千 円 | |
| 国債証券 | | | | | |
| 第365回利付国債 (10年) | | 0.1 | 500,000 | 476,185 | 2031/12/20 |
| 第32回利付国債 (30年) | | 2.3 | 400,000 | 443,916 | 2040/3/20 |
| 第34回利付国債 (30年) | | 2.2 | 400,000 | 435,760 | 2041/3/20 |
| 第36回利付国債 (30年) | | 2.0 | 300,000 | 315,945 | 2042/3/20 |
| 第38回利付国債 (30年) | | 1.8 | 150,000 | 152,241 | 2043/3/20 |
| 第42回利付国債 (30年) | | 1.7 | 200,000 | 197,660 | 2044/3/20 |
| 第46回利付国債 (30年) | | 1.5 | 200,000 | 189,072 | 2045/3/20 |
| 第50回利付国債 (30年) | | 0.8 | 260,000 | 210,925 | 2046/3/20 |
| 第54回利付国債 (30年) | | 0.8 | 230,000 | 183,519 | 2047/3/20 |
| 第58回利付国債 (30年) | | 0.8 | 350,000 | 274,813 | 2048/3/20 |
| 第62回利付国債 (30年) | | 0.5 | 330,000 | 235,715 | 2049/3/20 |
| 第66回利付国債 (30年) | | 0.4 | 280,000 | 190,083 | 2050/3/20 |
| 第71回利付国債 (30年) | | 0.7 | 350,000 | 253,095 | 2051/6/20 |
| 第144回利付国債 (20年) | | 1.5 | 420,000 | 442,272 | 2033/3/20 |
| 第145回利付国債 (20年) | | 1.7 | 400,000 | 427,764 | 2033/6/20 |
| 第146回利付国債 (20年) | | 1.7 | 400,000 | 427,748 | 2033/9/20 |
| 第148回利付国債 (20年) | | 1.5 | 400,000 | 419,472 | 2034/3/20 |
| 第152回利付国債 (20年) | | 1.2 | 400,000 | 405,020 | 2035/3/20 |
| 第160回利付国債 (20年) | | 0.7 | 400,000 | 373,720 | 2037/3/20 |
| 第161回利付国債 (20年) | | 0.6 | 450,000 | 413,311 | 2037/6/20 |
| 第168回利付国債 (20年) | | 0.4 | 410,000 | 353,764 | 2039/3/20 |
| 第174回利付国債 (20年) | | 0.4 | 380,000 | 317,235 | 2040/9/20 |
| 第180回利付国債 (20年) | | 0.8 | 360,000 | 312,800 | 2042/3/20 |
| 第181回利付国債 (20年) | | 0.9 | 410,000 | 361,021 | 2042/6/20 |
| 小 計 | | | 16,440,000 | 15,596,763 | |
| 地方債証券 | | | | | |
| 第843回東京都公募公債 | | 0.8 | 100,000 | 98,463 | 2033/6/20 |
| 平成29年度第16回愛知県公募公債 (10年) | | 0.26 | 200,000 | 198,048 | 2028/2/14 |
| 平成28年度第3回埼玉県公募公債 | | 0.08 | 300,000 | 298,110 | 2026/5/25 |
| 平成28年度第6回福岡県公募公債 | | 0.175 | 100,000 | 99,325 | 2026/12/22 |
| 第496回名古屋市長官公債 (10年) | | 0.07 | 200,000 | 198,598 | 2026/6/19 |
| 平成28年度第4回福井県公募公債 | | 0.2 | 200,000 | 198,494 | 2027/4/27 |
| 小 計 | | | 1,100,000 | 1,091,038 | |
| 特殊債券 (除く金融債) | | | | | |
| 第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 1.216 | 100,000 | 100,625 | 2035/3/30 |
| 第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | | 0.155 | 200,000 | 198,004 | 2027/8/31 |
| 小 計 | | | 300,000 | 298,629 | |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | | | | | |
| 第13回日本たばこ産業株式会社社債 (一般担保付) | | 0.355 | 100,000 | 98,033 | 2028/9/8 |
| 第6回ヒューリック株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.494 | 100,000 | 97,959 | 2028/10/20 |
| 第37回王子ホールディングス株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.29 | 100,000 | 96,758 | 2029/7/19 |
| 第14回株式会社オリエントランド無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.23 | 100,000 | 99,536 | 2026/1/23 |
| 第14回株式会社ブリヂストン無担保社債 | | 0.375 | 100,000 | 97,573 | 2029/4/19 |
| 第18回パナソニック株式会社無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.23 | 100,000 | 99,301 | 2026/3/5 |
| 第15回株式会社デンソー無担保社債 (社債間限定同順位特約付) | | 0.245 | 100,000 | 98,846 | 2027/6/18 |

しんきん国内債券マザーファンドⅡ ー第18期ー

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------------------|---|-------|------------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 第100回住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付) | | 0.809 | 200,000 | 200,246 | 2024/9/9 |
| 小 | 計 | | 900,000 | 888,252 | |
| 合 | 計 | | 18,740,000 | 17,874,682 | |

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 17,874,682 | % 99.5 |
| コール・ローン等、その他 | 96,241 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 17,970,923 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| (A) 資産 | 17,970,923,668 円 |
| コール・ローン等 | 65,352,911 |
| 公社債(評価額) | 17,874,682,600 |
| 未収利息 | 21,202,910 |
| 前払費用 | 9,685,247 |
| (B) 負債 | 0 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 17,970,923,668 |
| 元本 | 14,436,945,212 |
| 次期繰越損益金 | 3,533,978,456 |
| (D) 受益権総口数 | 14,436,945,212口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,448円 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は7,940,330,321円、期中追加設定元本額は15,550,854,237円、期中一部解約元本額は9,054,239,346円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
しんきん世界アロケーションファンド 7,081,598,177円
しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 4,092,066,993円
しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 2,586,271,279円
しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 677,008,763円

(注3) 1口当たり純資産額は1.2448円です。

○損益の状況

(2023年6月13日～2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 60,616,362 円 |
| 受取利息 | 60,690,191 |
| 支払利息 | △ 73,829 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 561,773,500 |
| 売買益 | 2,153,700 |
| 売買損 | △ 563,927,200 |
| (C) 保管費用等 | △ 130,025 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 501,287,163 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,395,638,720 |
| (F) 追加信託差損益金 | 3,960,697,763 |
| (G) 解約差損益金 | △ 2,321,070,864 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 3,533,978,456 |
| 次期繰越損益金(H) | 3,533,978,456 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年9月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

第21期

(決算日：2024年2月8日)

しんきん欧州ソブリン債マザーファンドの第21期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①主として欧州経済通貨同盟（EMU）参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。</p> <p>②FTSE EMU国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとします。</p> <p>③運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。</p> <p>④外貨建資産の組入比率については原則として高位を保ちます。</p> <p>⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑥市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</p> |
| 主要投資対象 | EMU参加国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資は行いません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|-------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | FTSE EMU 国債インデックス (ヘッジなし・円ベース) | 騰落率 | | |
| 17期(2020年2月10日) | 15,958 | 2.7% | 231.99 | 4.7% | 98.5% | 13,040百万円 |
| 18期(2021年2月8日) | 16,988 | 6.5% | 249.57 | 7.6% | 98.3% | 12,436 |
| 19期(2022年2月8日) | 16,661 | △1.9% | 244.25 | △2.1% | 98.3% | 12,675 |
| 20期(2023年2月8日) | 15,046 | △9.7% | 225.13 | △7.8% | 98.2% | 12,701 |
| 21期(2024年2月8日) | 17,508 | 16.4% | 264.17 | 17.3% | 98.0% | 13,585 |

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 騰落率 |
|-------------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|-------|-----|
| | 円 | 騰落率 | FTSE EMU 国債インデックス (ヘッジなし・円ベース) | 騰落率 | | |
| (期首) 2023年2月8日 | 15,046 | — | 225.13 | — | 98.2% | |
| 2月末 | 15,139 | 0.6% | 225.89 | 0.3% | 97.9% | |
| 3月末 | 15,509 | 3.1% | 231.57 | 2.9% | 97.9% | |
| 4月末 | 15,668 | 4.1% | 240.53 | 6.8% | 97.9% | |
| 5月末 | 16,015 | 6.4% | 239.31 | 6.3% | 98.4% | |
| 6月末 | 16,808 | 11.7% | 252.64 | 12.2% | 98.2% | |
| 7月末 | 16,529 | 9.9% | 250.55 | 11.3% | 98.3% | |
| 8月末 | 16,984 | 12.9% | 253.58 | 12.6% | 98.3% | |
| 9月末 | 16,288 | 8.3% | 246.73 | 9.6% | 98.1% | |
| 10月末 | 16,575 | 10.2% | 250.98 | 11.5% | 98.4% | |
| 11月末 | 17,419 | 15.8% | 260.56 | 15.7% | 98.4% | |
| 12月末 | 17,638 | 17.2% | 260.58 | 15.7% | 98.1% | |
| 2024年1月末 | 17,577 | 16.8% | 264.54 | 17.5% | 98.1% | |
| (期末) 2024年2月8日 | 17,508 | 16.4% | 264.17 | 17.3% | 98.0% | |

(注) 騰落率は期首比です。

※1 「FTSE EMU国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスで、EMU加盟国の国債で構成されています。

※2 「FTSE EMU国債インデックス」は「FTSE世界国債インデックス」のサブ・インデックスです。

※3 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

※4 上記指数は、FTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

○第21期の運用経過等（2023年2月9日～2024年2月8日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、FTSE EMU国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、主として欧州経済通貨同盟（EMU）参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資しています。

当期における基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

＜上昇要因＞

- ・インフレ高進を抑制するため、欧州中央銀行（ECB）政策理事会が、2023年9月まで継続的な利上げを実施していたことで、ドイツを中心とした欧州国債全体の金利が上昇傾向となったことや、9月のECB政策理事会後、ラガルド総裁が利下げを現段階では議論していないと発言したこと等を受けて、11月までユーロ高円安が大きく進んだこと。
- ・2023年11月の米連邦公開市場委員会（FOMC）で米政策金利の据え置きが決定され、FOMC後に行ったパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長の発言が、利上げ終了を示唆するものと市場で受け止められ、米国債金利が大きく低下した流れが欧州国債にも波及し、年末にかけて欧州国債金利も大きく低下したこと。

＜下落要因＞

- ・インフレ高進を抑制するため、ECB政策理事会が、2023年9月まで継続的な利上げを実施していたことや、米国債金利の上昇の流れを受けて、10月頃までドイツを中心とした欧州国債全体の金利が上昇傾向となったこと。

<投資環境>

(欧州債券市況)

当期初は、ECBが2022年よりインフレ圧力抑制のため利上げを継続的に実施していたため、欧州国債金利は上昇基調で推移しました。2023年3月中旬は、米シリコンバレーバンク(SVB)の経営破綻によるリスク回避の動きが欧州全体にも広がり、欧州国債金利は低下しました。その後は、ECBが継続的な利上げを実施していたことや、9月のECB政策理事会後、ラガルド総裁が利下げを現段階では議論していないと発言したこと等を受けて、10月ごろまで欧州国債金利は上昇基調で推移しました。しかし、11月のFOMCで米政策金利の据え置きが決定され、FOMC後に行ったパウエルFRB議長の発言が利上げ終了を示唆するものと市場で受け止められ、米国債金利が大きく低下した流れが欧州国債にも波及し、年末にかけて欧州国債金利も大きく低下しました。2024年初以降は、ドイツの1月の製造業購買担当者景気指数(PMI)の改定値が速報値から上方修正されたことで、早期の利下げ観測が後退したことや、米雇用関連統計の良好な結果を受けた米国債の金利上昇に連れて、欧州国債金利はやや上昇しました。

(為替市況：ユーロ円市場)

当期初から、インフレ高進を抑制するためにECBが大幅な利上げを行ってきたこと等を背景に、2023年11月まではユーロが円に対して強含みました。一方で、年末にかけては、上記要因等を受けた欧州国債金利の低下や、日本銀行の植田総裁が12月に行われた参議院財政金融委員会で、今後の金融政策について「年末から来年にかけて一段とチャレンジングになる」と発言したことで、12月以降の日銀金融政策決定会合で金融政策修正の可能性が意識されたこと等が材料視され、円が買い戻されました。その後、当期末にかけては、欧州国債金利の上昇に連れて、再びユーロ高円安となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

当期を通じて、欧州ソブリン債の組入比率を高位に保ち、FTSE EMU国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)をベンチマークとして、ポートフォリオを構築しています。

国別配分については、ドイツ、フランス、スペイン、オランダ、オーストリアおよびベルギーの各国債でポートフォリオを構築しています。

投資国各国の国債インデックスに対する修正デュレーション(金利感応度)は、中立を基本としました。2024年2月8日現在におけるファンドの修正デュレーションは7.36年、時価最終利回りは2.76%となっています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当期における基準価額の騰落率は+16.4%となりました。一方、ベンチマークであるFTSE EMU国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)の騰落率は+17.3%でした。この差には、ファンドとベンチマークにおける債券組入銘柄の違い、為替の評価タイミングのずれや、追加設定・解約による要因等が含まれています。

<今後の運用方針>

引き続き、運用の基本方針に従い、主としてEMU参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資し、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年2月9日～2024年2月8日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 7 | % 0.043 | (a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (7) | (0.043) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 7 | 0.043 | |
| 期中の平均基準価額は、16,512円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○ 売買及び取引の状況

(2023年2月9日～2024年2月8日)

公社債

| 外 国 | ユーロ | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|--------|------|-------|-------|
| | | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 | 4,648 | 4,909 |
| | フランス | 国債証券 | 4,859 | 7,891 |
| | オランダ | 国債証券 | 1,568 | 1,284 |
| | スペイン | 国債証券 | 2,723 | 4,157 |
| | ベルギー | 国債証券 | 1,468 | 2,184 |
| | オーストリア | 国債証券 | 1,685 | 1,922 |

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

○ 利害関係人との取引状況等

(2023年2月9日～2024年2月8日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年2月8日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|--------|--------|--------|------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | % | % | % | % | % |
| ドイツ | 21,450 | 22,358 | 3,570,173 | 26.3 | — | 19.4 | 5.8 | 1.0 |
| フランス | 29,250 | 28,711 | 4,584,649 | 33.7 | — | 23.3 | 6.8 | 3.7 |
| オランダ | 5,800 | 5,199 | 830,325 | 6.1 | — | 5.1 | 1.0 | — |
| スペイン | 17,000 | 16,861 | 2,692,445 | 19.8 | — | 14.7 | 4.0 | 1.2 |
| ベルギー | 6,400 | 6,108 | 975,380 | 7.2 | — | 6.1 | 0.7 | 0.5 |
| オーストリア | 4,650 | 4,114 | 656,930 | 4.8 | — | 2.8 | 1.3 | 0.7 |
| 合 計 | 84,550 | 83,353 | 13,309,905 | 98.0 | — | 71.4 | 19.6 | 7.0 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド ー第21期ー

(B)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------|------|-----------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | DBR 0.000 08/15/31 | — | 2,300 | 1,955 | 312,225 | 2031/8/15 |
| | | DBR 0.250 02/15/29 | 0.25 | 2,200 | 1,999 | 319,330 | 2029/2/15 |
| | | DBR 0.500 02/15/26 | 0.5 | 2,300 | 2,205 | 352,235 | 2026/2/15 |
| | | DBR 1.000 08/15/25 | 1.0 | 900 | 875 | 139,803 | 2025/8/15 |
| | | DBR 1.700 08/15/32 | 1.7 | 3,100 | 2,977 | 475,371 | 2032/8/15 |
| | | DBR 3.250 07/04/42 | 3.25 | 1,650 | 1,816 | 290,109 | 2042/7/4 |
| | | DBR 4.000 01/04/37 | 4.0 | 3,400 | 3,983 | 636,127 | 2037/1/4 |
| | | DBR 4.750 07/04/28 | 4.75 | 2,500 | 2,757 | 440,393 | 2028/7/4 |
| | | DBR 4.750 07/04/34 | 4.75 | 3,100 | 3,786 | 604,577 | 2034/7/4 |
| フランス | 国債証券 | FRTR 0.000 11/25/31 | — | 2,500 | 2,038 | 325,464 | 2031/11/25 |
| | | FRTR 0.500 05/25/25 | 0.5 | 2,800 | 2,710 | 432,770 | 2025/5/25 |
| | | FRTR 1.000 05/25/27 | 1.0 | 2,550 | 2,424 | 387,148 | 2027/5/25 |
| | | FRTR 1.250 05/25/34 | 1.25 | 2,300 | 1,975 | 315,484 | 2034/5/25 |
| | | FRTR 1.250 05/25/36 | 1.25 | 1,600 | 1,317 | 210,409 | 2036/5/25 |
| | | FRTR 1.500 05/25/31 | 1.5 | 2,700 | 2,501 | 399,475 | 2031/5/25 |
| | | FRTR 2.250 05/25/24 | 2.25 | 400 | 398 | 63,555 | 2024/5/25 |
| | | FRTR 2.500 05/25/30 | 2.5 | 2,400 | 2,389 | 381,599 | 2030/5/25 |
| | | FRTR 2.750 10/25/27 | 2.75 | 3,300 | 3,319 | 530,105 | 2027/10/25 |
| | | FRTR 3.250 05/25/45 | 3.25 | 2,900 | 2,892 | 461,832 | 2045/5/25 |
| | | FRTR 4.000 10/25/38 | 4.0 | 2,900 | 3,215 | 513,457 | 2038/10/25 |
| | | FRTR 4.500 04/25/41 | 4.5 | 700 | 822 | 131,314 | 2041/4/25 |
| | | FRTR 5.750 10/25/32 | 5.75 | 2,200 | 2,705 | 432,030 | 2032/10/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHER 0.000 07/15/31 | — | 500 | 416 | 66,517 | 2031/7/15 |
| | | NETHER 0.250 07/15/29 | 0.25 | 500 | 445 | 71,105 | 2029/7/15 |
| | | NETHER 0.500 01/15/40 | 0.5 | 1,400 | 995 | 159,030 | 2040/1/15 |
| | | NETHER 0.500 07/15/26 | 0.5 | 100 | 95 | 15,197 | 2026/7/15 |
| | | NETHER 0.750 07/15/27 | 0.75 | 800 | 755 | 120,715 | 2027/7/15 |
| | | NETHER 2.500 01/15/33 | 2.5 | 2,500 | 2,490 | 397,758 | 2033/1/15 |
| スペイン | 国債証券 | SPGB 0.800 07/30/29 | 0.8 | 3,700 | 3,315 | 529,498 | 2029/7/30 |
| | | SPGB 1.500 04/30/27 | 1.5 | 2,000 | 1,921 | 306,753 | 2027/4/30 |
| | | SPGB 1.950 04/30/26 | 1.95 | 1,500 | 1,470 | 234,799 | 2026/4/30 |
| | | SPGB 1.950 07/30/30 | 1.95 | 3,000 | 2,829 | 451,830 | 2030/7/30 |
| | | SPGB 2.150 10/31/25 | 2.15 | 1,000 | 986 | 157,599 | 2025/10/31 |
| | | SPGB 2.350 07/30/33 | 2.35 | 400 | 373 | 59,602 | 2033/7/30 |
| | | SPGB 4.200 01/31/37 | 4.2 | 2,700 | 2,910 | 464,701 | 2037/1/31 |
| | | SPGB 4.700 07/30/41 | 4.7 | 2,700 | 3,053 | 487,659 | 2041/7/30 |
| ベルギー | 国債証券 | BGB 0.800 06/22/25 | 0.8 | 400 | 388 | 61,988 | 2025/6/22 |
| | | BGB 0.800 06/22/27 | 0.8 | 600 | 566 | 90,399 | 2027/6/22 |
| | | BGB 0.900 06/22/29 | 0.9 | 1,200 | 1,101 | 175,819 | 2029/6/22 |
| | | BGB 1.600 06/22/47 | 1.6 | 1,500 | 1,075 | 171,759 | 2047/6/22 |
| | | BGB 3.000 06/22/34 | 3.0 | 1,300 | 1,310 | 209,233 | 2034/6/22 |
| | | BGB 5.000 03/28/35 | 5.0 | 1,400 | 1,666 | 266,180 | 2035/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | RAGB 0.000 02/20/31 | — | 250 | 207 | 33,117 | 2031/2/20 |
| | | RAGB 0.500 04/20/27 | 0.5 | 500 | 468 | 74,767 | 2027/4/20 |
| | | RAGB 0.750 02/20/28 | 0.75 | 700 | 651 | 104,051 | 2028/2/20 |

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド ー第 21 期ー

| 銘 柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|--------|------|---------------------|-------|-------|-------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | RAGB 1.200 10/20/25 | 1.2 | 600 | 583 | 93,192 | 2025/10/20 |
| | | RAGB 1.500 02/20/47 | 1.5 | 1,300 | 956 | 152,689 | 2047/2/20 |
| | | RAGB 2.400 05/23/34 | 2.4 | 1,300 | 1,246 | 199,111 | 2034/5/23 |
| 合 計 | | | | | | 13,309,905 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年2月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 13,309,905 | % 98.0 |
| コール・ローン等、その他 | 275,184 | 2.0 |
| 投資信託財産総額 | 13,585,089 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (13,504,844千円) の投資信託財産総額 (13,585,089千円) に対する比率は99.4%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年2月8日現在、1ユーロ＝159.68円です。

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド ー 第 21 期 ー

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年2月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | 円 |
|-----------------|----------------|---|
| (A) 資産 | 13,585,089,751 | |
| コール・ローン等 | 127,439,896 | |
| 公社債(評価額) | 13,309,905,235 | |
| 未収利息 | 139,935,965 | |
| 前払費用 | 7,808,655 | |
| (B) 負債 | 1,456 | |
| 未払利息 | 233 | |
| その他未払費用 | 1,223 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 13,585,088,295 | |
| 元本 | 7,759,452,871 | |
| 次期繰越損益金 | 5,825,635,424 | |
| (D) 受益権総口数 | 7,759,452,871口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,508円 | |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は8,441,728,106円、期中追加設定元本額は1,124,842,247円、期中一部解約元本額は1,807,117,482円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,933,180,203円
 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 632,735,669円
 しんきん3資産ファンド(1年決算型) 377,606,627円
 しんきん世界アロケーションファンド 208,896,065円
 しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 194,437,895円
 欧米ソブリン債ポートフォリオ 149,873,095円
 欧州ソブリン債ポートフォリオ 137,568,596円
 しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 125,154,721円

(注3) 1口当たり純資産額は1.7508円です。

○損益の状況 (2023年2月9日~2024年2月8日)

| 項 目 | 当 期 | 円 |
|------------------|----------------|---|
| (A) 配当等収益 | 315,592,607 | |
| 受取利息 | 315,628,584 | |
| その他収益金 | 719 | |
| 支払利息 | △ 36,696 | |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,722,558,349 | |
| 売買益 | 1,866,068,751 | |
| 売買損 | △ 143,510,402 | |
| (C) 保管費用等 | △ 5,951,688 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 2,032,199,268 | |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,260,108,893 | |
| (F) 追加信託差損益金 | 696,597,753 | |
| (G) 解約差損益金 | △1,163,270,490 | |
| (H) 計(D+E+F+G) | 5,825,635,424 | |
| 次期繰越損益金(H) | 5,825,635,424 | |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年9月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん米国ソブリン債マザーファンド

第21期

(決算日：2024年2月8日)

しんきん米国ソブリン債マザーファンドの第21期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。</p> <p>②FTSE米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとします。</p> <p>③運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。</p> <p>④外貨建資産の組入比率については原則として高位を保ちます。</p> <p>⑤外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑥市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</p> |
| 主要投資対象 | 米国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資は行いません。</p> <p>②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|------------------------------------|-------|-------|--------|
| | 期騰落 | 中率 | FTSE米国 国債インデックス (ヘッジなし・円ベース) | 期騰落 | | |
| 17期(2020年2月10日) | 円 | % | ポイント | % | % | 百万円 |
| 17期(2020年2月10日) | 17,061 | 8.5 | 393.90 | 8.7 | 98.5 | 13,343 |
| 18期(2021年2月8日) | 17,139 | 0.5 | 392.59 | △ 0.3 | 98.6 | 12,510 |
| 19期(2022年2月8日) | 18,027 | 5.2 | 415.21 | 5.8 | 98.5 | 12,921 |
| 20期(2023年2月8日) | 18,693 | 3.7 | 433.40 | 4.4 | 98.6 | 12,701 |
| 21期(2024年2月8日) | 21,473 | 14.9 | 497.07 | 14.7 | 98.5 | 14,047 |

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 券率 |
|-------------------|--------|------|------------------------------------|------|-------|----|
| | 騰落 | 率 | FTSE米国 国債インデックス (ヘッジなし・円ベース) | 騰落 | | |
| (期首) 2023年2月8日 | 円 | % | ポイント | % | % | |
| | 18,693 | — | 433.40 | — | 98.6 | |
| 2月末 | 19,165 | 2.5 | 442.00 | 2.0 | 99.0 | |
| 3月末 | 19,244 | 2.9 | 444.26 | 2.5 | 98.7 | |
| 4月末 | 19,416 | 3.9 | 456.98 | 5.4 | 98.6 | |
| 5月末 | 20,052 | 7.3 | 463.48 | 6.9 | 99.0 | |
| 6月末 | 20,674 | 10.6 | 475.93 | 9.8 | 98.8 | |
| 7月末 | 20,068 | 7.4 | 466.21 | 7.6 | 98.3 | |
| 8月末 | 20,698 | 10.7 | 475.27 | 9.7 | 98.8 | |
| 9月末 | 20,711 | 10.8 | 476.42 | 9.9 | 98.7 | |
| 10月末 | 20,478 | 9.5 | 477.67 | 10.2 | 98.5 | |
| 11月末 | 20,894 | 11.8 | 482.32 | 11.3 | 98.2 | |
| 12月末 | 20,790 | 11.2 | 475.38 | 9.7 | 98.8 | |
| 2024年1月末 | 21,444 | 14.7 | 491.59 | 13.4 | 98.4 | |
| (期末) 2024年2月8日 | 21,473 | 14.9 | 497.07 | 14.7 | 98.5 | |

(注) 騰落率は期首比です。

- ※1 「FTSE米国国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスで、米国の国債で構成されています。
- ※2 「FTSE米国国債インデックス」は「FTSE世界国債インデックス」のサブ・インデックスです。
- ※3 「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
- ※4 上記指数は、FTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

○第21期の運用経過等 (2023年2月9日～2024年2月8日)

<当期中の基準価額等の推移>



当ファンドは、FTSE米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資しています。

当期における基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・米連邦準備制度理事会（FRB）がインフレ高進を抑制するため、利上げを継続的に実施していたことや、米政策金利がより長期にわたって高水準で維持される公算が大きいと市場で見られていたこと等を背景として、米国債金利が上昇傾向となる中、日米金利差の拡大を意識した米ドル買い円売りが優勢となり、米ドル高円安が進んだこと。

<下落要因>

- ・米連邦公開市場委員会（FOMC）において、継続的に利上げが決定されていたことや、その後も政策金利を高い水準でしばらく維持する可能性が高いとFRB高官等が示唆していたこと等を受けて、米国債金利が上昇したこと。

＜投資環境＞

（米国国債市況）

当期初から2023年10月ごろまでは、FRBがインフレ高進を抑制するため、利上げを継続的に実施していたことや、利上げ停止後も米政策金利がより長期にわたって高水準で維持される公算が大きいと市場で見られていたこと等を背景に、米国債金利は上昇傾向で推移しました。その後は、11月のFOMCで米政策金利の据え置きが決定され、FOMC後に行ったパウエルFRB議長の発言が、利上げ終了を示唆するものと市場で受け止められたことや、12月のFOMCで、2024年に複数回の金利引下げを行うとの見通しが示されたこと等を要因として、当期末にかけて米国債金利は大きく低下しました。

（為替市況：ドル円市場）

当期初から2023年10月ごろまでは、FRBがインフレ高進を抑制するため、利上げを継続的に実施したことで米国債金利が上昇したことを受けて、米ドル高円安基調で推移しました。11月から12月までの米ドル円相場は、利下げ終了を示唆する発言をパウエルFRB議長が行ったこと等を受けて、米国債金利が大きく低下したことで米ドルが売られ、米ドル安円高が進みました。一方で、2024年に入ってから、市場の早期利下げ期待をけん制する旨のFRB高官の発言等が材料視され、米国の早期利下げ観測がやや後退したことや、元日に発生した能登半島地震の影響を考慮し、1月の日銀金融政策決定会合では金融政策の修正は行われないと市場で予想されていたことで、米ドルが買い戻されました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

当期を通じて、米国国債等の組入比率を高位に保ち、FTSE米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとして、ポートフォリオを構築しています。

ベンチマークに対する修正デュレーション（金利感応度）は、中立を基本としました。2024年2月8日現在におけるファンドの修正デュレーションは5.95年、時価最終利回りは4.42%となっています。また、ファンドの利回り向上を図るため、米国国債のほか、国際復興開発銀行（世界銀行：IBRD）、米州開発銀行（IADB）、アジア開発銀行（ADB）発行の債券を組み入れています。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当期における基準価額の騰落率は+14.9%となりました。ベンチマークであるFTSE米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）の騰落率は+14.7%となっています。この差には、ファンドとベンチマークにおける組入銘柄の違い、債券および為替の評価タイミングのずれや、追加設定・解約による要因等が含まれています。

＜今後の運用方針＞

引き続き、運用の基本方針に従い、主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資し、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2023年2月9日～2024年2月8日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 5 | % 0.024 | (a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (5) | (0.023) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 5 | 0.024 | |
| 期中の平均基準価額は、20,302円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年2月9日～2024年2月8日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|-----|------|------|---------------|---------------|
| 外 国 | アメリカ | 国債証券 | 千ドル 21,745 | 千ドル 22,661 |

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年2月9日～2024年2月8日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年2月8日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|------|----------------|---------------|------------------|-----------|-----------------|-----------|-----------|-----------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| アメリカ | 千ドル 103,700 | 千ドル 93,387 | 千円 13,835,421 | % 98.5 | % — | % 49.4 | % 19.6 | % 29.4 |
| 合 計 | 103,700 | 93,387 | 13,835,421 | 98.5 | — | 49.4 | 19.6 | 29.4 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

しんきん米国ソブリン債マザーファンド ー第21期ー

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 当 | | 期 | | 償還年月日 |
|------|-----------------------|-------|-------|-------|------------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | % | 千ドル | 千ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | | | | | |
| | T-BOND 1.750 08/15/41 | 1.75 | 3,800 | 2,561 | 379,476 | 2041/8/15 |
| | T-BOND 2.500 05/15/46 | 2.5 | 4,300 | 3,106 | 460,289 | 2046/5/15 |
| | T-BOND 3.000 02/15/47 | 3.0 | 2,500 | 1,971 | 292,075 | 2047/2/15 |
| | T-BOND 3.125 02/15/42 | 3.125 | 4,600 | 3,859 | 571,839 | 2042/2/15 |
| | T-BOND 3.125 05/15/48 | 3.125 | 3,700 | 2,964 | 439,166 | 2048/5/15 |
| | T-BOND 3.500 02/15/39 | 3.5 | 2,500 | 2,299 | 340,687 | 2039/2/15 |
| | T-BOND 3.625 02/15/44 | 3.625 | 4,000 | 3,561 | 527,599 | 2044/2/15 |
| | T-BOND 4.375 05/15/40 | 4.375 | 3,000 | 3,022 | 447,713 | 2040/5/15 |
| | T-BOND 4.750 02/15/37 | 4.75 | 2,300 | 2,455 | 363,731 | 2037/2/15 |
| | T-BOND 5.250 02/15/29 | 5.25 | 1,100 | 1,158 | 171,673 | 2029/2/15 |
| | T-BOND 6.500 11/15/26 | 6.5 | 1,000 | 1,058 | 156,778 | 2026/11/15 |
| | T-NOTE 0.625 08/15/30 | 0.625 | 1,600 | 1,284 | 190,243 | 2030/8/15 |
| | T-NOTE 0.875 11/15/30 | 0.875 | 3,450 | 2,802 | 415,243 | 2030/11/15 |
| | T-NOTE 1.125 01/15/25 | 1.125 | 4,200 | 4,057 | 601,132 | 2025/1/15 |
| | T-NOTE 1.250 08/15/31 | 1.25 | 3,200 | 2,615 | 387,430 | 2031/8/15 |
| | T-NOTE 1.375 11/15/31 | 1.375 | 3,800 | 3,114 | 461,349 | 2031/11/15 |
| | T-NOTE 1.500 02/15/30 | 1.5 | 1,600 | 1,380 | 204,530 | 2030/2/15 |
| | T-NOTE 1.625 02/15/26 | 1.625 | 3,900 | 3,692 | 546,977 | 2026/2/15 |
| | T-NOTE 1.625 05/15/26 | 1.625 | 3,700 | 3,485 | 516,357 | 2026/5/15 |
| | T-NOTE 1.625 08/15/29 | 1.625 | 1,900 | 1,675 | 248,157 | 2029/8/15 |
| | T-NOTE 2.000 08/15/25 | 2.0 | 4,900 | 4,716 | 698,740 | 2025/8/15 |
| | T-NOTE 2.250 11/15/24 | 2.25 | 650 | 636 | 94,292 | 2024/11/15 |
| | T-NOTE 2.250 11/15/25 | 2.25 | 4,500 | 4,329 | 641,388 | 2025/11/15 |
| | T-NOTE 2.250 11/15/27 | 2.25 | 2,950 | 2,756 | 408,429 | 2027/11/15 |
| | T-NOTE 2.375 08/15/24 | 2.375 | 3,900 | 3,843 | 569,479 | 2024/8/15 |
| | T-NOTE 2.625 01/31/26 | 2.625 | 1,500 | 1,449 | 214,768 | 2026/1/31 |
| | T-NOTE 2.625 02/15/29 | 2.625 | 2,550 | 2,381 | 352,872 | 2029/2/15 |
| | T-NOTE 2.750 02/28/25 | 2.75 | 600 | 587 | 87,025 | 2025/2/28 |
| | T-NOTE 2.875 05/31/25 | 2.875 | 5,100 | 4,984 | 738,476 | 2025/5/31 |
| | T-NOTE 3.125 11/15/28 | 3.125 | 3,400 | 3,259 | 482,853 | 2028/11/15 |
| | 特殊債券 (除く金融債) | | | | | |
| | ASIA 1.875 01/24/30 | 1.875 | 5,300 | 4,635 | 686,727 | 2030/1/24 |
| | IADB 2.125 01/15/25 | 2.125 | 3,400 | 3,312 | 490,710 | 2025/1/15 |
| | IBRD 0.750 11/24/27 | 0.75 | 2,200 | 1,932 | 286,292 | 2027/11/24 |
| | IBRD 1.875 10/27/26 | 1.875 | 2,600 | 2,436 | 360,911 | 2026/10/27 |
| 合 | 計 | | | | 13,835,421 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年2月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 13,835,421 | 98.5 |
| コール・ローン等、その他 | 212,516 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 14,047,937 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (13,992,863千円) の投資信託財産総額 (14,047,937千円) に対する比率は99.6%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年2月8日現在、1ドル=148.15円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年2月8日現在)

○損益の状況 (2023年2月9日~2024年2月8日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 14,047,937,700 |
| コール・ローン等 | 93,707,750 |
| 公社債(評価額) | 13,835,421,993 |
| 未収利息 | 114,358,534 |
| 前払費用 | 4,449,423 |
| (B) 負債 | 1,416 |
| 未払利息 | 160 |
| その他未払費用 | 1,256 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 14,047,936,284 |
| 元本 | 6,542,253,274 |
| 次期繰越損益金 | 7,505,683,010 |
| (D) 受益権総口数 | 6,542,253,274口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,473円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 370,483,406 |
| 受取利息 | 370,518,029 |
| 支払利息 | △ 34,623 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,501,503,193 |
| 売買益 | 1,850,131,222 |
| 売買損 | △ 348,628,029 |
| (C) 保管費用等 | △ 3,237,742 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 1,868,748,857 |
| (E) 前期繰越損益金 | 5,906,333,637 |
| (F) 追加信託差損益金 | 916,667,280 |
| (G) 解約差損益金 | △1,186,066,764 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 7,505,683,010 |
| 次期繰越損益金(H) | 7,505,683,010 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は6,794,667,025円、期中追加設定元本額は908,642,720円、期中一部解約元本額は1,161,056,471円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,002,261,771円
 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 532,517,868円
 しんきん3資産ファンド(1年決算型) 307,397,956円
 しんきん世界アロケーションファンド 171,255,418円
 しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 159,731,399円
 米国ソブリン債ポートフォリオ 145,143,887円
 欧米ソブリン債ポートフォリオ 121,566,782円
 しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 102,378,193円

(注3) 1口当たり純資産額は2.1473円です。

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年9月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん高格付外国債券マザーファンド

第18期

(決算日：2024年6月12日)

しんきん高格付外国債券マザーファンドの第18期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①この投資信託は、主として日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国を除く世界各国の公社債に投資することにより、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。</p> <p>②投資対象とする公社債は、組入れ時において、信用格付業者であるムーディーズ社またはスタンダード&プアーズ社のいずれかからAA格以上の信用格付けを取得しているものとします。</p> <p>③国別の投資配分比率は、各国の市場規模・経済規模等を勘案し決定します。</p> <p>④各国のマクロ経済等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、債券ポートフォリオの構築を図ります。</p> |
| 主要投資対象 | 日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①株式への投資は行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> |

○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|--------|-------|-----|-----------|---------|
| | | 期 騰 落 | 中 率 | | |
| | 円 | | % | | 百万円 |
| 14期(2020年6月12日) | 12,534 | △ 0.8 | | 98.4 | 1,623 |
| 15期(2021年6月14日) | 14,460 | 15.4 | | 98.7 | 2,389 |
| 16期(2022年6月13日) | 14,469 | 0.1 | | 99.0 | 2,378 |
| 17期(2023年6月12日) | 14,297 | △ 1.2 | | 99.2 | 2,494 |
| 18期(2024年6月12日) | 16,561 | 15.8 | | 98.4 | 2,403 |

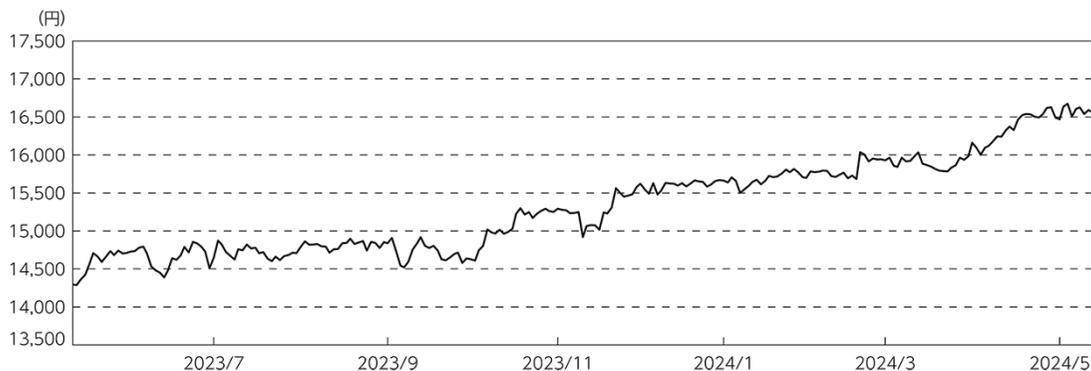
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 率 |
|---------------------|--------|-----|------|-----------|
| | | 騰 落 | 率 | |
| (期 首) 2023年6月12日 | 円 | | % | % |
| | 14,297 | | — | 99.2 |
| 6月末 | 14,728 | | 3.0 | 99.2 |
| 7月末 | 14,648 | | 2.5 | 98.7 |
| 8月末 | 14,863 | | 4.0 | 98.6 |
| 9月末 | 14,839 | | 3.8 | 98.5 |
| 10月末 | 14,612 | | 2.2 | 98.1 |
| 11月末 | 15,291 | | 7.0 | 99.1 |
| 12月末 | 15,547 | | 8.7 | 99.4 |
| 2024年1月末 | 15,664 | | 9.6 | 98.5 |
| 2月末 | 15,709 | | 9.9 | 98.4 |
| 3月末 | 15,931 | | 11.4 | 98.3 |
| 4月末 | 16,163 | | 13.1 | 97.7 |
| 5月末 | 16,470 | | 15.2 | 97.4 |
| (期 末) 2024年6月12日 | 16,561 | | 15.8 | 98.4 |

(注) 騰落率は期首比です。

○第18期の運用経過等（2023年6月13日～2024年6月12日）

<当期中の基準価額の推移>



当ファンドは、日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国を除く世界各国の公社債に投資を行っています。

当期の基準価額は、上昇して期を終えました。基準価額の変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・2024年前半には、欧米各国において底堅い経済指標や根強いインフレ懸念などを背景に利下げ観測が後退し、欧米各国で金利が上昇基調で推移する中、投資対象としている各国通貨が対円で上昇したため。

<下落要因>

- ・物価上昇や労働需給のひっ迫を受け、各国の中央銀行が利上げなどの金融引締めを実施する中、オーストラリアの金利が上昇し、債券価格が下落したため。

<投資環境>

決算日現在組入れを行っている各国の投資環境は、以下のとおりです。

(1) 英国

英国中央銀行が2023年8月まで利上げを継続する中、英国金利が上昇する局面が見られたものの、景気後退懸念等から利下げ観測が高まり、2023年末にかけて金利は低下基調で推移しました。その後、2024年前半は欧米各国で利下げ観測が後退する中、英国金利およびポンドは対円で上昇基調で推移しました。

(2) カナダ

カナダ中央銀行が2023年7月まで利上げを継続する中、カナダ金利が上昇する局面が見られたものの、景気後退懸念等から利下げ観測が高まり、2023年末にかけて金利は低下基調で推移しました。その後、2024年前半は欧米各国で利下げ観測が後退する中、カナダ金利およびカナダドルは対円で上昇基調で推移しました。

(3) オーストラリア

オーストラリア準備銀行が2023年11月まで利上げを継続する中、オーストラリア金利が上昇する局面が見られたものの、景気後退懸念等から利下げ観測が高まり、2023年末にかけて金利は低下基調で推移しました。その後、2024年前半は欧米各国で利下げ観測が後退する中、オーストラリア金利およびオーストラリアドルは対円で上昇基調で推移しました。

(4) ノルウェー

ノルウェー中央銀行が2023年12月まで利上げを継続する中、ノルウェー金利が上昇する局面が見られたものの、景気後退懸念等から利下げ観測が高まり、2023年末にかけて金利は低下基調で推移しました。その後、2024年前半は欧米各国で利下げ観測が後退する中、ノルウェー金利およびノルウェークローネは対円で上昇基調で推移しました。

<当ファンドのポートフォリオ>

当期の国別配分、各国の修正デュレーションの調整は、以下のように行いました。

| | 英国 | カナダ | オーストラリア | ノルウェー |
|---------------|------------|------------|-------------|------------|
| 国別配分 | 25% (± 5%) | 25% (± 5%) | 25% (± 5%) | 25% (± 5%) |
| 修正デュレーション調整範囲 | 6年 (± 2年) | 6年 (± 2年) | 4.5年 (± 2年) | 5年 (± 2年) |

2024年6月12日時点におけるポートフォリオの構成は、英国、カナダ、オーストラリアおよびノルウェーの各国国債等で構成しています。ファンド全体の修正デュレーションは5.12年、最終利回りは3.81%、外国債券の組入比率は98.4%となっています。国別修正デュレーション（債券部分）等については以下のとおりです。

| | 英国 | カナダ | オーストラリア | ノルウェー |
|---------------|------|------|---------|-------|
| 修正デュレーション (年) | 5.62 | 5.49 | 4.58 | 4.77 |
| 最終利回り (%) | 4.08 | 3.44 | 4.12 | 3.59 |

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当ファンドは、日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国を除く世界各国の公社債に投資を行っていますが、特定の指数を上回る、または連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指標はありません。

＜今後の運用方針＞

引き続き、日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とし、安定した収益の確保および投資信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2023年6月13日～2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 7 | % 0.046 | (a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (7) | (0.045) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 7 | 0.046 | |
| 期中の平均基準価額は、15,372円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年6月13日～2024年6月12日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|---------|------------------------------|----------------------|
| 外 | カナダ | 千カナダドル 国債証券 7,292 | 千カナダドル 7,528 |
| | | 特殊債券 - | 477 |
| | イギリス | 千ポンド 国債証券 2,910 | 千ポンド 3,325 |
| | | 特殊債券 - | 195 |
| 国 | ノルウェー | 千ノルウェークローネ 国債証券 32,691 | 千ノルウェークローネ 42,587 |
| | オーストラリア | 千オーストラリアドル 国債証券 2,168 | 千オーストラリアドル 1,085 |
| | | 地方債証券 - | 1,931 |

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月13日～2024年6月12日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年6月12日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|----------------------|----------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|----------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| カナダ | 千カナダドル 5,831 | 千カナダドル 5,252 | 千円 600,225 | % 25.0 | % — | % 18.4 | % 6.5 | % — |
| イギリス | 千ポンド 3,246 | 千ポンド 2,963 | 593,254 | 24.7 | — | 24.7 | — | — |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 42,610 | 千ノルウェークローネ 38,647 | 567,343 | 23.6 | — | 16.8 | 6.8 | — |
| オーストラリア | 千オーストラリアドル 6,281 | 千オーストラリアドル 5,821 | 603,773 | 25.1 | — | 10.9 | 14.2 | — |
| 合 計 | — | — | 2,364,596 | 98.4 | — | 70.8 | 27.5 | — |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

しんきん高格付外国債券マザーファンド ー第18期ー

(B) 外国(外貨建) 公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 利 率 | 額面金額 | 期 末 | | 償還年月日 | |
|-----------------|----------------------|--------|------------|------------|-----------|------------|
| | | | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| カナダ | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | | |
| 国債証券 | CAN 0.500 12/01/30 | 0.5 | 2,311 | 1,920 | 219,413 | 2030/12/1 |
| | CAN 1.250 06/01/30 | 1.25 | 1,750 | 1,544 | 176,485 | 2030/6/1 |
| | CAN 2.250 06/01/29 | 2.25 | 355 | 336 | 38,476 | 2029/6/1 |
| | CAN 2.250 12/01/29 | 2.25 | 340 | 321 | 36,708 | 2029/12/1 |
| | CAN 4.000 03/01/29 | 4.0 | 465 | 475 | 54,286 | 2029/3/1 |
| | CAN 5.750 06/01/29 | 5.75 | 510 | 564 | 64,449 | 2029/6/1 |
| 地方債証券 | BRCOL 2.200 06/18/30 | 2.2 | 100 | 91 | 10,404 | 2030/6/18 |
| 小 計 | | | | | 600,225 | |
| イギリス | | | 千ポンド | 千ポンド | | |
| 国債証券 | UKT 0.375 10/22/30 | 0.375 | 1,050 | 833 | 166,802 | 2030/10/22 |
| | UKT 0.875 10/22/29 | 0.875 | 765 | 648 | 129,727 | 2029/10/22 |
| | UKT 4.750 12/07/30 | 4.75 | 1,431 | 1,482 | 296,723 | 2030/12/7 |
| 小 計 | | | | | 593,254 | |
| ノルウェー | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | |
| 国債証券 | NGB 1.375 08/19/30 | 1.375 | 16,020 | 14,048 | 206,234 | 2030/8/19 |
| | NGB 1.750 09/06/29 | 1.75 | 14,800 | 13,499 | 198,177 | 2029/9/6 |
| | NGB 2.000 04/26/28 | 2.0 | 11,790 | 11,098 | 162,931 | 2028/4/26 |
| 小 計 | | | | | 567,343 | |
| オーストラリア | | | 千オーストラリアドル | 千オーストラリアドル | | |
| 国債証券 | ACGB 1.000 12/21/30 | 1.0 | 700 | 575 | 59,669 | 2030/12/21 |
| | ACGB 2.250 05/21/28 | 2.25 | 574 | 537 | 55,790 | 2028/5/21 |
| | ACGB 2.500 05/21/30 | 2.5 | 1,037 | 950 | 98,549 | 2030/5/21 |
| | ACGB 2.750 11/21/27 | 2.75 | 820 | 787 | 81,703 | 2027/11/21 |
| | ACGB 2.750 11/21/29 | 2.75 | 971 | 909 | 94,311 | 2029/11/21 |
| | ACGB 3.250 04/21/29 | 3.25 | 639 | 617 | 64,009 | 2029/4/21 |
| 地方債証券 | NSWTC 3.000 04/20/29 | 3.0 | 1,330 | 1,244 | 129,054 | 2029/4/20 |
| | NSWTC 3.000 05/20/27 | 3.0 | 110 | 105 | 10,988 | 2027/5/20 |
| 特殊債券 (除く金融債) | IADB 3.150 06/26/29 | 3.15 | 100 | 93 | 9,697 | 2029/6/26 |
| 小 計 | | | | | 603,773 | |
| 合 計 | | | | | 2,364,596 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 2,364,596 | % 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 39,212 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 2,403,808 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (2,396,553千円) の投資信託財産総額 (2,403,808千円) に対する比率は99.7%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年6月12日現在、1カナダドル=114.27円、1ポンド=200.19円、1ノルウェークローネ=14.68円、1オーストラリアドル=103.71円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 2,403,808,896 |
| コール・ローン等 | 29,757,814 |
| 公社債(評価額) | 2,364,596,777 |
| 未収利息 | 8,121,203 |
| 前払費用 | 1,333,102 |
| (B) 負債 | 0 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 2,403,808,896 |
| 元本 | 1,451,498,867 |
| 次期繰越損益金 | 952,310,029 |
| (D) 受益権総口数 | 1,451,498,867口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,561円 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は1,744,440,093円、期中追加設定元本額は311,116,717円、期中一部解約元本額は604,057,943円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 703,265,056円
 しんきん高格付外国債券スペシャル(適格機関投資家限定) 578,216,417円
 しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 170,017,394円

(注3) 1口当たり純資産額は1.6561円です。

○損益の状況 (2023年6月13日～2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 60,459,231 |
| 受取利息 | 60,463,787 |
| 支払利息 | △ 4,556 |
| (B) 有価証券売買損益 | 310,126,812 |
| 売買益 | 330,571,930 |
| 売買損 | △ 20,445,118 |
| (C) 保管費用等 | △ 1,172,972 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 369,413,071 |
| (E) 前期繰越損益金 | 749,657,160 |
| (F) 追加信託差損益金 | 154,383,283 |
| (G) 解約差損益金 | △321,143,485 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 952,310,029 |
| 次期繰越損益金(H) | 952,310,029 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<約款変更のお知らせ>

当ファンドを投資対象とするベビーファンドを新NISA制度における成長投資枠の対象商品とするため、デリバティブ取引を行う目的について投資信託約款に所要の変更を行いました。(2023年9月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきんJリートマザーファンドⅡ

第18期

(決算日：2024年6月12日)

しんきんJリートマザーファンドⅡの第18期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | <p>①この投資信託は、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。</p> <p>②我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指します。</p> <p>③運用にあたっては、「東証REIT指数（配当込み）」をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果を目指して運用を行います。</p> <p>④不動産投資信託証券の銘柄の選定にあたっては、主に次の項目に着目して行うことを基本とします。</p> <p>1) 財務分析 不動産投資信託証券の財務内容を分析し、信用リスクが高いと判断される銘柄を除外します。</p> <p>2) 収益性分析 不動産投資信託証券の収益性および予想配当利回りの水準を分析します。</p> <p>3) 流動性・価格分析 不動産投資信託証券の流動性（時価総額・売買代金など）や価格水準の側面から分析します。</p> |
| 主要投資対象 | 我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | <p>①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。</p> <p>③株式への投資は行いません。</p> <p>④外貨建資産への投資は行いません。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 東証REIT指数※ (配当込み) | | 投資信託 組入比 | 純資産 総額 |
|-----------------|--------|------|---------------------|------|-------------|-----------|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| 14期(2020年6月12日) | 21,718 | △5.0 | 3,619.53 | △7.6 | 97.8 | 2,858 |
| 15期(2021年6月14日) | 28,538 | 31.4 | 4,736.27 | 30.9 | 99.0 | 5,838 |
| 16期(2022年6月13日) | 27,467 | △3.8 | 4,527.45 | △4.4 | 99.2 | 6,093 |
| 17期(2023年6月12日) | 27,734 | 1.0 | 4,415.85 | △2.5 | 99.0 | 6,640 |
| 18期(2024年6月12日) | 26,766 | △3.5 | 4,246.01 | △3.8 | 98.7 | 5,654 |

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | 東証REIT指数※ (配当込み) | | 投資信託 組入比 | 託券率 |
|--------------------|--------|------|---------------------|------|-------------|-----|
| | 円 | 騰落率 | ポイント | 騰落率 | | |
| (期首) 2023年6月12日 | 27,734 | — | 4,415.85 | — | 99.0 | — |
| 6月末 | 27,705 | △0.1 | 4,421.28 | 0.1 | 99.0 | — |
| 7月末 | 28,079 | 1.2 | 4,472.88 | 1.3 | 99.0 | — |
| 8月末 | 28,510 | 2.8 | 4,539.20 | 2.8 | 97.9 | — |
| 9月末 | 28,079 | 1.2 | 4,468.30 | 1.2 | 98.2 | — |
| 10月末 | 27,559 | △0.6 | 4,372.14 | △1.0 | 98.5 | — |
| 11月末 | 28,146 | 1.5 | 4,455.46 | 0.9 | 99.0 | — |
| 12月末 | 27,730 | △0.0 | 4,382.85 | △0.7 | 98.6 | — |
| 2024年1月末 | 27,656 | △0.3 | 4,378.56 | △0.8 | 98.4 | — |
| 2月末 | 26,325 | △5.1 | 4,166.74 | △5.6 | 98.2 | — |
| 3月末 | 27,812 | 0.3 | 4,410.17 | △0.1 | 98.3 | — |
| 4月末 | 28,102 | 1.3 | 4,455.74 | 0.9 | 98.0 | — |
| 5月末 | 27,079 | △2.4 | 4,302.09 | △2.6 | 98.8 | — |
| (期末) 2024年6月12日 | 26,766 | △3.5 | 4,246.01 | △3.8 | 98.7 | — |

(注) 騰落率は期首比です。

※東証REIT指数とは、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託（Jリート）全銘柄を対象とした時価総額加重平均型の指数で、2003年3月31日の時価総額を基準として株式会社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。）が算出・公表しています。

※銘柄数の増減など市況動向によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額が修正されます。

※東証REIT指数（配当込み）の算出は、配当金落ち、有償減資の場合も基準時価総額の修正が行われます。

※東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数に係る標章又は商標は、J P Xの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT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が有します。J P Xは、東証REIT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、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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は責任を負いません。

○第18期の運用経過等（2023年6月13日～2024年6月12日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、東証REIT指数（配当込み）をベンチマークとし、我が国の不動産投資信託証券に投資を行っています。

当期の基準価額は、2023年9月5日に期中高値まで上昇した後は軟調な動きとなり、2024年3月13日に期中安値をつけました。その後は回復に転じたものの、5月以降は再び軟調となり、下落しました。基準価額の変動要因は以下のとおりです。

＜上昇要因＞

- ・オフィス賃貸市況に改善傾向が見られるようになったこと。
- ・インバウンド（訪日外国人）の増加によって国内消費が活性化したこと。

＜下落要因＞

- ・Ｊリート市場が軟調な中で公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化懸念が強まったこと。
- ・日銀の金融政策正常化に対する警戒感から国内金利が上昇したこと。
- ・米国の早期金融緩和期待が後退したこと。

＜投資環境＞

当期のＪリート市場は下落しました。

（期初～2023年12月）

2023年6月下旬から9月上旬までは、オフィス市況の先行き改善期待などからＪリート市場は上昇し、堅調に推移しました。ただ、その後は内外の長期金利が上昇したことや複数銘柄の公募増資の発表による需給悪化懸念などから下落に転じ、軟調な推移となりました。

(2024年1月～期末)

2024年1月は東京都心部のオフィス賃料に下げ止まりの兆しが見られたことなどからＪリート市場は強含む場面もありましたが、米国の早期金融緩和期待が後退したことや日銀の金融政策修正観測によって国内長期金利が上昇したことなどから売り優勢となり、3月中旬まで下落基調が続きました。その後は反発し、5月上旬まで上昇しましたが、国内長期金利の上昇が続いたこともあって上値は重く、期末にかけて軟調な動きとなりました。

投資法人の運用する不動産のサブセクター別動向では、インバウンドの増加や収益向上期待からホテル銘柄などが市場平均の動きより相対的に好調となる一方で、内外金利の変動に対して感応度の高い傾向にある物流施設銘柄などは相対的に不調となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

ファンドの運用方針に従い、①財務の健全性、②収益性および分配金利回り、③流動性および価格水準の観点から銘柄を精査し、期末時点で39銘柄を組み入れています。追加設定・解約のほか、個別銘柄の入替えや保有比率の調整に応じてＪリートの売買を実施しました。Ｊリートの組入比率は、高位を保ち、当期末では98.7%となっています。

各銘柄の保有比率については、時価総額比率をベースに前述の3つの観点を勘案し、投資判断を行いました。期を通じたサブセクターの主な調整では、ホテルおよび物流施設の銘柄の保有比率を市場平均よりも高めにする一方で、住宅および商業施設銘柄などを市場平均よりも低めにしました。なお、期末時点では、ホテル、総合型および物流施設の銘柄の保有比率を市場平均よりやや高めとし、住宅および商業施設の銘柄をやや低めとしています。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

当期の基準価額の騰落率は $\Delta 3.5\%$ となり、東証REIT指数(配当込み)の騰落率 $\Delta 3.8\%$ をやや上回りました(騰落率差: $+0.3\%$)。主に物流施設や一部の総合型銘柄のオーバーウエイトはマイナス寄与となりましたが、期を通じて投資口価格が好調なホテル銘柄の組入比率を高めていたことがプラスに寄与しました。

<今後の運用方針>

引き続き運用の基本方針に従い、Ｊリートの組入比率を高位に保ちながら、①財務の健全性、②収益性および分配金利回り、③流動性および価格水準に着目した銘柄選定を行うことにより、安定した収益の確保と投資信託財産の着実な成長を目標として運用します。

○1万口当たりの費用明細

(2023年6月13日~2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--------------------------------------|---------------|-----------------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 円 4 (4) | % 0.015 (0.015) | (a) 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 |
| (b) そ の 他 費 用 (そ の 他) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 4 | 0.015 | |
| 期中の平均基準価額は、27,731円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年6月13日～2024年6月12日)

投資信託証券

| 銘柄 | 買付 | | 売付 | |
|-------------------------|-------------------|----------------------|-------|---------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| | 千口 | 千円 | 千口 | 千円 |
| SOSiLA物流リート投資法人 | 0.09 | 10,808 | 0.4 | 49,547 |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | 0.05 | 31,090 | 0.12 | 76,450 |
| 森ヒルズリート投資法人 | 0.31 | 43,509 | 0.405 | 56,156 |
| 産業ファンド投資法人 | 0.8 | 109,054 | 0.93 | 123,856 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | 0.115 | 38,404 | 0.21 | 71,341 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | — (△ 0.25) | — (△ 52,350) | 0.365 | 80,375 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 0.32 | 129,382 | 0.23 | 92,253 |
| GLP投資法人 | 1.11 | 150,405 | 1.665 | 217,175 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | — | — | 0.395 | 135,229 |
| 日本プロジスリート投資法人 | 0.495 | 133,735 | 0.705 | 193,996 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | 0.28 | 157,242 | 0.1 | 58,117 |
| Oneリート投資法人 | 0.04 | 10,502 | 0.07 | 18,258 |
| イオンリート投資法人 | — | — | 0.345 | 49,132 |
| ヒューリックリート投資法人 | 0.425 | 66,224 | 0.325 | 49,320 |
| 日本リート投資法人 | 0.185 | 64,456 | 0.19 | 66,586 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | 0.52 | 41,426 | 1.505 | 124,048 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | 1.28 | 201,955 | 1.135 | 179,705 |
| いちごホテルリート投資法人 | 0.09 | 9,245 | 0.04 | 4,736 |
| ラサールロジポート投資法人 | 0.595 | 88,958 | 0.56 | 83,777 |
| スターアジア不動産投資法人 | 2.675 | 151,557 | 1.255 | 74,285 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | 0.085 | 39,028 | 0.23 | 107,917 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | 0.14 | 53,337 | 0.195 | 75,645 |
| CREロジスティクスファンド投資法人 | 0.175 | 26,402 | 0.475 | 77,910 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | — | — | 0.225 | 28,625 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 0.415 | 246,924 | 0.445 | 267,271 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | 0.472 | 266,586 | 0.405 | 226,248 |
| 日本都市ファンド投資法人 | 2.495 | 242,678 | 1.62 | 154,971 |
| オリックス不動産投資法人 | 0.725 | 125,535 | 1.15 | 197,045 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 0.455 | 163,647 | 0.305 | 105,812 |
| NTT都市開発リート投資法人 | 0.11 | 14,195 | 0.315 | 41,289 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | 0.565 | 96,961 | 0.2 | 32,182 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | 0.19 | 21,779 | 0.81 | 87,530 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | 0.85 | 127,221 | 0.86 | 131,174 |
| 森トラストリート投資法人 | 0.855 | 63,044 | 1.12 | 81,478 |
| インヴェンシブル投資法人 | 2.88 | 169,362 | 3.645 | 236,023 |
| フロンティア不動産投資法人 | — | — | 0.09 | 41,260 |
| 平和不動産リート投資法人 | 0.665 | 91,517 | 0.38 | 54,015 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | 0.13 | 36,909 | 0.29 | 85,428 |
| 福岡リート投資法人 | 0.255 | 42,022 | 0.32 | 53,111 |
| KDX不動産投資法人 | 1.355 (0.775) | 240,301 (52,350) | 0.67 | 110,657 |
| いちごオフィスリート投資法人 | 0.155 | 12,888 | 0.77 | 63,466 |
| 大和証券オフィス投資法人 | 0.134 (0.166) | 87,455 (—) | 0.085 | 53,568 |
| 大和ハウスリート投資法人 | 0.73 | 197,253 | 0.54 | 141,486 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 2.24 | 163,704 | 2.415 | 184,038 |
| 大和証券リビング投資法人 | 0.225 | 25,008 | 0.755 | 81,532 |

しんきんJリートマザーファンドⅡ ー第18期ー

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|--------|----------------|--------------------|------------------|------------|--------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国 内 | ジャパンエクセレント投資法人 | 千口 0.53 | 千円 68,960 | 千口 0.58 | 千円 75,030 |
| 合 計 | | 26.211 (0.691) | 4,060,686 () | 29.845 | 4,599,076 |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 金額の単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は分割・償還による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月13日～2024年6月12日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年6月12日現在)

国内投資信託証券

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 比 率 |
|-------------------------|---------|-------|-------|---------|-----|
| | 口 数 | 千口 | 口 数 | 評 価 額 | |
| | | 千口 | | 千円 | % |
| S O S i L A 物 流 リート投資法人 | | 0.31 | — | — | — |
| 日本アコモデーションファンド投資法人 | | 0.2 | 0.13 | 83,720 | 1.5 |
| 森ヒルズリート投資法人 | | 0.73 | 0.635 | 81,851 | 1.4 |
| 産業ファンド投資法人 | | 1.34 | 1.21 | 150,040 | 2.7 |
| アドバンス・レジデンス投資法人 | | 0.4 | 0.305 | 98,210 | 1.7 |
| ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 | | 0.615 | — | — | — |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 | | 0.265 | 0.355 | 129,930 | 2.3 |
| G L P 投資法人 | | 2.89 | 2.335 | 311,956 | 5.5 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 | | 0.395 | — | — | — |
| 日本プロロジスリート投資法人 | | 1.195 | 0.985 | 245,166 | 4.3 |
| 星野リゾート・リート投資法人 | | 0.1 | 0.28 | 144,760 | 2.6 |
| O n e リート投資法人 | | 0.125 | 0.095 | 24,139 | 0.4 |
| イオンリート投資法人 | | 0.345 | — | — | — |
| ヒューリックリート投資法人 | | 0.33 | 0.43 | 62,350 | 1.1 |
| 日本リート投資法人 | | 0.18 | 0.175 | 58,537 | 1.0 |
| 積水ハウス・リート投資法人 | | 2.76 | 1.775 | 138,627 | 2.5 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 | | 1.88 | 2.025 | 281,677 | 5.0 |
| いちごホテルリート投資法人 | | 0.9 | 0.95 | 103,550 | 1.8 |
| ラサールロジポート投資法人 | | 0.88 | 0.915 | 135,786 | 2.4 |
| スターアジア不動産投資法人 | | 1.44 | 2.86 | 169,884 | 3.0 |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 | | 0.38 | 0.235 | 100,580 | 1.8 |
| 三菱地所物流リート投資法人 | | 0.31 | 0.255 | 97,410 | 1.7 |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人 | | 0.62 | 0.32 | 45,920 | 0.8 |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人 | | 0.225 | — | — | — |
| 日本ビルファンド投資法人 | | 0.69 | 0.66 | 376,200 | 6.7 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 | | 0.525 | 0.592 | 298,960 | 5.3 |
| 日本都市ファンド投資法人 | | 2.15 | 3.025 | 271,947 | 4.8 |
| オリックス不動産投資法人 | | 1.78 | 1.355 | 214,090 | 3.8 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | | 0.32 | 0.47 | 153,455 | 2.7 |
| N T T 都市開発リート投資法人 | | 0.57 | 0.365 | 42,559 | 0.8 |
| 東急リアル・エステート投資法人 | | — | 0.365 | 56,210 | 1.0 |
| グローバル・ワン不動産投資法人 | | 0.62 | — | — | — |
| ユナイテッド・アーバン投資法人 | | 1.47 | 1.46 | 206,590 | 3.7 |
| 森トラストリート投資法人 | | 1.35 | 1.085 | 74,865 | 1.3 |
| インヴィンシブル投資法人 | | 4.74 | 3.975 | 271,095 | 4.8 |
| フロンティア不動産投資法人 | | 0.105 | 0.015 | 6,750 | 0.1 |
| 平和不動産リート投資法人 | | 0.36 | 0.645 | 84,301 | 1.5 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人 | | 0.52 | 0.36 | 96,336 | 1.7 |
| 福岡リート投資法人 | | 0.345 | 0.28 | 44,016 | 0.8 |
| K D X 不動産投資法人 | | 0.34 | 1.8 | 271,080 | 4.8 |
| いちごオフィスリート投資法人 | | 0.615 | — | — | — |
| 大和証券オフィス投資法人 | | 0.12 | 0.335 | 93,230 | 1.6 |
| 大和ハウスリート投資法人 | | 0.775 | 0.965 | 240,092 | 4.2 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人 | | 3.14 | 2.965 | 235,717 | 4.2 |

しんきんJリートマザーファンドⅡ ー第18期ー

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------|------------------|--------|-----------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千口 | 千口 | 千円 | % |
| 大和証券リビング投資法人 | 0.75 | 0.22 | 22,550 | 0.4 |
| ジャパンエクセレント投資法人 | 0.54 | 0.49 | 58,800 | 1.0 |
| 合 計 | 40.64 | 37.697 | 5,582,941 | |
| | 口数・金額 銘柄数<比率> | 39 | <98.7%> | |

(注1) 合計欄のく>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注3) 一印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 5,582,941 | 98.7 |
| コール・ローン等、その他 | 71,952 | 1.3 |
| 投資信託財産総額 | 5,654,893 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月12日現在)

○損益の状況 (2023年6月13日～2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 5,654,893,821 |
| コール・ローン等 | 25,253,935 |
| 投資証券(評価額) | 5,582,941,000 |
| 未収配当金 | 46,698,880 |
| 未収利息 | 6 |
| (B) 負債 | 0 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,654,893,821 |
| 元本 | 2,112,739,043 |
| 次期繰越損益金 | 3,542,154,778 |
| (D) 受益権総口数 | 2,112,739,043口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 26,766円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 297,755,622 |
| 受取配当金 | 297,778,395 |
| 受取利息 | 921 |
| 支払利息 | △ 23,694 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 454,561,653 |
| 売買益 | 166,224,796 |
| 売買損 | △ 620,786,449 |
| (C) 保管費用等 | △ 29,023 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 156,835,054 |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,246,122,688 |
| (F) 追加信託差損益金 | 2,076,929,950 |
| (G) 解約差損益金 | △ 2,624,062,806 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 3,542,154,778 |
| 次期繰越損益金(H) | 3,542,154,778 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は2,394,311,267円、期中追加設定元本額は1,183,400,050円、期中一部解約元本額は1,464,972,274円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 1,205,510,894円
しんきん3資産ファンド(1年決算型) 592,510,758円
しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 314,717,391円

(注3) 1口当たり純資産額は2.6766円です。

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

運用報告書

親投資信託

しんきんグローバルリートマザーファンド

第18期

(決算日：2024年6月12日)

しんきんグローバルリートマザーファンドの第18期に係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とおりです。

| | |
|--------|--|
| 商品分類 | 親投資信託 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 運用方針 | ①この投資信託は、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。 ②日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ③運用指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。 |
| 主要投資対象 | 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。 |
| 投資制限 | ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券へS & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。 ③原則として、株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | S & P 先進国※ R E I T 指数 (除く日本、 ヘッジなし、 円ベース) | | 株組入比率 | 投資信託 組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|---|-------|-------|--------------|-------|
| | 期騰落 | 中率 | 期騰落 | 中率 | | | |
| 14期(2020年6月12日) | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| | 15,006 | △17.2 | 15,636 | △17.2 | — | 99.8 | 2,474 |
| 15期(2021年6月14日) | 21,351 | 42.3 | 22,860 | 46.2 | — | 99.7 | 5,189 |
| 16期(2022年6月13日) | 23,608 | 10.6 | 25,364 | 11.0 | — | 99.8 | 4,692 |
| 17期(2023年6月12日) | 23,459 | △0.6 | 25,106 | △1.0 | — | 99.7 | 5,515 |
| 18期(2024年6月12日) | 27,792 | 18.5 | 30,101 | 19.9 | — | 99.7 | 4,277 |

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | S & P 先進国※ R E I T 指数 (除く日本、 ヘッジなし、 円ベース) | | 株組入比率 | 投資信託 組入比率 |
|--------------------|--------|------|---|------|-------|--------------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | | |
| (期首) 2023年6月12日 | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| | 23,459 | — | 25,106 | — | — | 99.7 |
| 6月末 | 24,378 | 3.9 | 26,109 | 4.0 | — | 99.2 |
| 7月末 | 24,500 | 4.4 | 26,263 | 4.6 | — | 99.5 |
| 8月末 | 24,871 | 6.0 | 26,672 | 6.2 | — | 99.5 |
| 9月末 | 23,476 | 0.1 | 25,180 | 0.3 | — | 98.8 |
| 10月末 | 22,148 | △5.6 | 23,725 | △5.5 | — | 99.7 |
| 11月末 | 24,281 | 3.5 | 26,204 | 4.4 | — | 99.7 |
| 12月末 | 26,234 | 11.8 | 28,355 | 12.9 | — | 99.2 |
| 2024年1月末 | 26,007 | 10.9 | 28,117 | 12.0 | — | 99.7 |
| 2月末 | 26,462 | 12.8 | 28,623 | 14.0 | — | 99.6 |
| 3月末 | 27,481 | 17.1 | 29,762 | 18.5 | — | 99.2 |
| 4月末 | 27,003 | 15.1 | 29,240 | 16.5 | — | 99.6 |
| 5月末 | 27,461 | 17.1 | 29,732 | 18.4 | — | 99.5 |
| (期末) 2024年6月12日 | 27,792 | 18.5 | 30,101 | 19.9 | — | 99.7 |

(注) 騰落率は期首比です。

※S & P先進国 R E I T 指数 (除く日本、ヘッジなし、円ベース) は、S&P Dow Jones Indices LLC (以下「S & P」といいます。) が有する S & P グローバル株価指数の採用銘柄の中から不動産投資信託 (R E I T) および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。

○第18期の運用経過等（2023年6月13日～2024年6月12日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとし、日本を除く世界各国の不動産投資信託証券へ投資を行っています。

当期の基準価額は上昇しました。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

| | |
|---------------------------|---------|
| 前期末基準価額 | 23,459円 |
| 当期末基準価額 | 27,792円 |
| 基準価額の変動 | 4,333円 |
| うち 有価証券の変動や配当・利息収入などによるもの | 1,340円 |
| うち 外国通貨の変動によるもの | 3,020円 |
| うち その他の要因によるもの | △27円 |

※要因分析の数値は概算値です。実際の数値と異なる可能性があります。傾向を知るための参考としてご覧ください。

＜上昇要因＞

- ・米連邦準備制度理事会（FRB）が追加利上げに慎重な姿勢を示したこと。
- ・欧米の好調な企業業績を受けて、リスクオン姿勢が強まったこと。
- ・国内外の金融政策の方向性の違いから、円安が進んだこと。

＜下落要因＞

- ・米国の長期金利が上昇したこと。
- ・中東情勢が悪化したこと。
- ・原油高に伴うインフレが懸念されたこと。

＜投資環境＞

（外国リート（不動産投資信託）市況）

現地通貨ベースで見ると、イタリア、アイルランドを除く欧州地域などの指数構成国のリートが値上がりしました。国別に見ると、スペイン、フランス、オーストラリアなどの指数構成国が相対的に大きく上昇しました。

また、円ベースで最も上昇率が高かった国はスペインであり、現地通貨ベースの+33.4%に対して円ベースでは+44.2%となりました。なお、最も組入比率の高い米国は、現地通貨ベースの+7.1%に対し、円ベースでは+19.6%となりました。円ベースで最も不振だった投資国は香港でした。

（外国為替市場の市況（対円での動き））

当期の外国為替市場については、全ての投資対象国通貨に対して円安での推移となったため、外貨建資産への投資を行う当ファンドにとって、為替変動は基準価額に対するプラス要因として働きました。

対円で上昇率の大きかった通貨は英ポンドで、一方、対円で最も上昇率の小さかった通貨は韓国ウォンとなりました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行いました。原則として、S & P先進国REIT指数の指数構成銘柄全てに投資を行う投資方針を採用しています。

期中の売買に関しては、設定・解約に伴う外国リートの売買のほか、指数構成銘柄および指数採用株数（比率）の変更に伴う入替えなどを必要に応じて実施しました。また、外国リートの組入比率は、高位の水準を保つように努めました。なお、運用の指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託しています。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当期の基準価額の騰落率は+18.5%となり、同期間のベンチマークの騰落率である+19.9%を1.4%下回りました。

＜今後の運用方針＞

引き続き、運用の基本方針に従い、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

また、外国不動産投資信託の組入比率は、原則として高位を保つこととし、銘柄の入替え、追加・削除等が必要な場合は随時行っていきます。なお、運用の指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 6 月13日～2024年 6 月12日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|---|-----------------------|-----------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券) | 円 5 (5) | % 0.020 (0.020) | (a) 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 |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券) | 5 (5) | 0.019 (0.019) | (b) 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 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他) | 107 (106) (1) | 0.422 (0.418) (0.004) | (c) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 117 | 0.461 | |
| 期中の平均基準価額は、25,358円です。 | | | |

(注1) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

○売買及び取引の状況

(2023年6月13日～2024年6月12日)

投資信託証券

| 銘 | 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|----------------------------|--------------------------------------|-------|------------|-------|------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | アメリカ | | | | |
| | | 千口 | 千ドル | 千口 | 千ドル |
| | AMERICAN ASSETS TRUST INC | 0.526 | 10 | 1.137 | 23 |
| | AGREE REALTY CORP | 1.579 | 93 | 2.289 | 129 |
| | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 1.189 | 12 | 1.982 | 21 |
| | ASHFORD HOSPITALITY TRUST INC | 0.536 | 1 | 0.524 | 1 |
| | APARTMENT INCOME REIT CORP | 1.753 | 53 | 3.438 | 116 |
| | APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 1.485 | 9 | 3.557 | 26 |
| | ACADIA REALTY TRUST | 2.557 | 38 | 2.058 | 32 |
| | ALEXANDER & BALDWIN INC | 0.769 | 12 | 1.512 | 25 |
| | ALEXANDER'S INC | 0.053 | 10 | 0.078 | 15 |
| | AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 4.045 | 140 | 7.084 | 245 |
| | APPLE HOSPITALITY REIT INC | 2.286 | 37 | 4.575 | 69 |
| | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 1.954 | 204 | 3.631 | 398 |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 1.766 | 302 | 3.215 | 573 |
| | BRANDYWINE REALTY TRUST | 1.797 | 7 | 3.522 | 15 |
| | SAUL CENTERS INC | 0.108 | 3 | 0.247 | 8 |
| | BLUEROCK HOMES TRUST INC | 0.131 | 1 | 0.314 | 4 |
| | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 0.564 | 1 | 1.612 | 4 |
| | BROADSTONE NET LEASE INC | 2.72 | 40 | 4.235 | 62 |
| | BRT APARTMENTS CORP | 0.346 | 6 | 0.518 | 9 |
| | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 3.996 | 85 | 7.201 | 154 |
| | BOSTON PROPERTIES INC | 1.768 | 102 | 3.254 | 192 |
| | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 0.302 | 6 | 0.548 | 11 |
| | COPT DEFENSE PROPERTIES | 1.178 | 27 | 2.35 | 55 |
| | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 0.435 | 12 | 0.707 | 19 |
| | CITY OFFICE REIT INC | 0.378 | 1 | 0.86 | 3 |
| | CHATHAM LODGING TRUST | 0.499 | 4 | 1.124 | 10 |
| | CLIPPER REALTY INC | 0.891 | 4 | 1.064 | 5 |
| | AMERICOLD REALTY TRUST | 3.397 | 92 | 6.342 | 172 |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 1.293 | 116 | 2.534 | 245 |
| | CENTERSPACE | 0.171 | 8 | 0.353 | 21 |
| | CTO REALTY GROWTH INC | 0.176 | 2 | 0.445 | 7 |
| | CARETRUST REIT INC | 2.063 | 45 | 2.46 | 55 |
| | CUBESMART | 2.826 | 105 | 5.211 | 208 |
| | COUSINS PROPERTIES INC | 1.768 | 35 | 3.43 | 74 |
| | DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 18.3 | 10 | 13.8 | 7 |
| | | (-) | (0.00306) | (-) | (0.45972) |
| | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES, INC. | 1.509 | 18 | 2.458 | 28 |
| | DOUGLAS EMMETT INC | 0.343 | 4 | 2.423 | 30 |
| | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 3.777 | 9 | 6.986 | 16 |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 4.413 | 580 | 6.746 | 867 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 3.177 | 40 | 9.197 | 153 | |
| | | | (7.063) | (94) | |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 2.953 | 24 | 5.184 | 43 | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 0.658 | 112 | 1.039 | 170 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|---------------------------------------|----------|------------|----------|----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千ドル | 千口 | 千ドル |
| アメリカ | | | | |
| ELME COMMUNITIES | 0.928 | 12 | 1.815 | 25 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 2.549 | 169 | 4.176 | 263 |
| EPR PROPERTIES | 0.87 | 39 | 1.671 | 70 |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 2.149 | 50 | 3.468 | 82 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 1.216 | 23 | 2.454 | 45 |
| EQUINIX INC | 1.152 | 886 | 2.11 | 1,532 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 4.323 | 243 | 7.854 | 477 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 1.781 | 16 | 3.355 | 28 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 0.774 | 167 | 1.47 | 334 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 2.601 | 297 | 4.741 | 621 |
| | (2.303) | (328) | | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 1.47 | 33 | 2.272 | 52 |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1.002 | 11 | 1.775 | 19 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 1.666 | 75 | 3.085 | 146 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 0.919 | 87 | 1.697 | 163 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 0.86 | 1 | 1.936 | 3 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 3.336 | 153 | 5.882 | 262 |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 0.769 | 7 | 1.534 | 13 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 2.732 | 22 | 4.737 | 38 |
| | (2.714) | (27) | | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 0.405 | 4 | 0.777 | 9 |
| GETTY REALTY CORP | 0.76 | 22 | 0.987 | 27 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 1.318 | 26 | 2.44 | 54 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 1.121 | 6 | 2.79 | 16 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 4.574 | 69 | 8.66 | 130 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 8.847 | 150 | 16.654 | 292 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 0.483 | 4 | 1.718 | 15 |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 0.372 | 29 | 0.662 | 58 |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 0.564 | 1 | 1.815 | 6 |
| INDUS REALTY TRUST INC | — | — | 0.179 | 11 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 1.553 | 9 | 2.862 | 17 |
| INVITATION HOMES INC | 7.097 | 225 | 13.394 | 441 |
| IRON MOUNTAIN INC | 3.56 | 219 | 6.628 | 449 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 2.433 | 32 | 4.943 | 73 |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 0.858 | 21 | 1.619 | 39 |
| JBG SMITH PROPERTIES | 0.849 | 11 | 2.162 | 31 |
| KIMCO REALTY CORP | 7.715 | 144 | 14.683 | 267 |
| | (1.363) | (23) | | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 25.2 | 5 | 42.3 | 7 |
| | (—) | (0.00002) | (—) | (0.247) |
| KILROY REALTY CORP | 1.338 | 42 | 2.504 | 81 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 2.679 | 57 | 5.031 | 107 |
| GLADSTONE LAND CORP | 0.356 | 5 | 0.664 | 8 |
| LIFE STORAGE INC | — | — | 0.076 | 10 |
| | | | (2.574) | (328) |
| LTC PROPERTIES INC | 0.557 | 17 | 0.994 | 32 |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 3.57 | 30 | 6.188 | 54 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 1.424 | 176 | 2.628 | 340 |
| MACERICH CO/THE | 3.064 | 35 | 5.297 | 66 |

外

国

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--|----------|------------|----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千口 | 千ドル | 千口 | 千ドル |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 7.457 | 36 | 13.685 | 68 |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 20 | 1 | 61.3 | 5 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 0.51 | 26 | 0.963 | 54 |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | 0.12 | 1 | 0.129 | 2 |
| | (0.312) | (5) | | |
| NNN REIT INC | 2.223 | 86 | 4.143 | 159 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 1.122 | 34 | 2.155 | 73 |
| NETSTREIT CORP | 1.182 | 19 | 1.507 | 24 |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | 0.304 | 2 | 0.64 | 4 |
| | (0.041) | (0.3178) | | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 0.206 | 6 | 0.432 | 14 |
| REALTY INCOME CORP | 11.535 | 609 | 17.042 | 888 |
| | (3.03) | (156) | | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 0.075 | 1 | 0.082 | 1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 3.239 | 103 | 5.517 | 174 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.34 | 6 | 0.56 | 11 |
| ORION OFFICE REIT INC | 1.88 | 10 | 2.594 | 13 |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 0.52 | 2 | 1.617 | 5 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 1.795 | 11 | 3.049 | 19 |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 6.392 | 110 | 7.696 | 139 |
| | (4.76) | (94) | | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 2.805 | 38 | 2.966 | 41 |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY INC | 1.515 | 52 | 2.698 | 89 |
| PARAMOUNT GROUP INC | 2.849 | 13 | 4.517 | 21 |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 0.514 | 8 | 0.719 | 11 |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 2.509 | 33 | 5.237 | 74 |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | 1.57 | 27 | 0.823 | 12 |
| PROLOGIS INC | 11.284 | 1,234 | 21.091 | 2,322 |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 0.616 | 13 | 1.11 | 23 |
| PRIME US REIT | 9.2 | 1 | 25.2 | 3 |
| | (1.77) | (△0.00836) | (-) | (0.09152) |
| PUBLIC STORAGE | 1.934 | 494 | 3.613 | 957 |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A | 0.212 | 2 | 0.381 | 5 |
| REGENCY CENTERS CORP | 2.026 | 124 | 3.76 | 223 |
| | (0.306) | (18) | | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 3.095 | 148 | 4.664 | 218 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 0.86 | 79 | 1.378 | 132 |
| RLJ LODGING TRUST | 1.658 | 17 | 3.58 | 37 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 1.415 | 18 | 2.725 | 33 |
| RPT REALTY | 0.719 | 7 | 1.246 | 13 |
| | | | (2.254) | (23) |
| THE NECESSITY RETAIL REIT INC | - | - | 0.279 | 1 |
| | | | (4.052) | (27) |
| SAFEHOLD INC | 0.718 | 13 | 1.027 | 19 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 3.015 | 41 | 5.422 | 74 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 2.395 | 23 | 4.696 | 46 |
| SITE CENTERS CORP | 2.683 | 34 | 4.728 | 61 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS | 1.246 | 30 | 2.267 | 56 |
| SL GREEN REALTY CORP | 0.528 | 24 | 1.219 | 50 |

外

国

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--|----------------------|------------------|----------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| アメリカ | 千口 | 千ドル | 千口 | 千ドル |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 3.982 | 477 | 7.483 | 927 |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 1.372 | 52 | 1.743 | 61 |
| | | | (3.977) | (156) |
| STAG INDUSTRIAL INC | 2.282 | 80 | 4.161 | 145 |
| STAR HOLDINGS | 0.128 | 1 | 0.52 | 7 |
| SUN COMMUNITIES INC | 1.53 | 182 | 2.837 | 333 |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 1.743 | 13 | 3.627 | 25 |
| TERRENO REALTY CORP | 1.669 | 97 | 2.06 | 115 |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | — | — | 0.095 | 1 |
| | | | (0.884) | (18) |
| UDR INC | 3.692 | 123 | 7.12 | 260 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 1.431 | 23 | 2.691 | 43 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.13 | 5 | 0.285 | 11 |
| UMH PROPERTIES INC | 0.665 | 9 | 1.106 | 16 |
| UNITI GROUP INC | 9.837 | 51 | 4.889 | 25 |
| VICI PROPERTIES INC | 13.081 | 381 | 23.131 | 673 |
| VORNADO REALTY TRUST | 1.878 | 42 | 3.717 | 88 |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 0.85 | 12 | 1.736 | 26 |
| VENTAS INC | 4.859 | 214 | 9.067 | 392 |
| WELLTOWER INC | 8.634 | 745 | 12.001 | 1,056 |
| WP CAREY INC | 2.818 | 159 | 4.895 | 271 |
| | | | (—) | (4) |
| WHITESTONE REIT | 0.786 | 8 | 1.364 | 14 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 1.146 | 14 | 2.27 | 29 |
| 小 計 | 371.008 (16.599) | 12,346 (655) | 661.186 (20.804) | 21,905 (655) |
| カナダ | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 0.687 | 12 | 1.32 | 23 |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | — | — | 0.717 | 7 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.399 | 9 | 2.158 | 14 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.326 | 22 | 0.517 | 35 |
| BTB REIT | 0.648 | 1 | 1.46 | 4 |
| CAN APARTMENT PROP REIT | 0.954 | 43 | 1.853 | 82 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 1.83 | 24 | 3.495 | 44 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.516 | 6 | 0.947 | 11 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.835 | 11 | 1.452 | 20 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.185 | 1 | 0.512 | 6 |
| | | | (0.219) | (—) |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 1.547 | 19 | 2.777 | 35 |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REIT | — | — | 1.144 | 2 |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.938 | 13 | 1.977 | 27 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.381 | 26 | 0.711 | 50 |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.137 | 2 | 0.293 | 4 |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 1.812 | 16 | 3.086 | 27 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.83 | 10 | 1.579 | 19 |
| INOVALIS REIT | — | — | 0.325 | 1 |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 0.773 | 13 | 1.394 | 24 |
| MINTO APARTMENT REIT | 0.148 | 2 | 0.322 | 4 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 0.401 | 5 | 0.678 | 10 |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------|--------|--------|----------|-----------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| カナダ | 千口 | 千カナダドル | 千口 | 千カナダドル |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REIT | 2.309 | 11 | 3.635 | 17 |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 0.298 | 2 | 0.671 | 4 |
| PRIMARIS REIT | 0.648 | 8 | 1.109 | 14 |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.912 | 4 | 1.419 | 6 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.599 | 28 | 3.165 | 56 |
| SLATE GROCERY REIT | 0.193 | 2 | 0.568 | 6 |
| SLATE OFFICE REIT | — | — | 1.037 | 1 |
| SMARTCENTRES REIT VAR VT UN | 0.854 | 19 | 1.581 | 35 |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 1.122 | 4 | 1.358 | 6 |
| | | | (1.303) | (—) |
| 小 計 | 22.282 | 323 | 43.26 | 609 |
| | | | (1.522) | (—) |
| ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| ドイツ | | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | — | — | 0.201 | 0.83499 |
| HAMBORNER REIT AG | 0.739 | 4 | 1.361 | 8 |
| | | | (—) | (0.53356) |
| 小 計 | 0.739 | 4 | 1.562 | 9 |
| | | | (—) | (0.53356) |
| イタリア | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 2.297 | 5 | 3.586 | 7 |
| 小 計 | 2.297 | 5 | 3.586 | 7 |
| フランス | | | | |
| ALTAREA | 0.042 | 3 | 0.085 | 7 |
| | | | (—) | (0.02208) |
| CARMILA | 0.825 | 11 | 1.508 | 22 |
| | | | (—) | (1) |
| COVIVIO | 0.653 | 28 | 1.105 | 49 |
| GECINA SA | 0.632 | 61 | 1.28 | 124 |
| ICADE | 0.483 | 14 | 0.815 | 23 |
| | | | (—) | (1) |
| KLEPIERRE | 2.451 | 58 | 4.533 | 108 |
| | | | (—) | (5) |
| MERCIALYS | 1.468 | 12 | 2.005 | 18 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 1.216 | 64 | 2.453 | 147 |
| | | | (—) | (5) |
| 小 計 | 7.77 | 255 | 13.784 | 501 |
| | | | (—) | (13) |
| オランダ | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 0.478 | 10 | 0.878 | 18 |
| NSI NV | 0.162 | 2 | 0.33 | 5 |
| VASTNED RETAIL NV | 0.161 | 3 | 0.338 | 6 |
| WERELDHAVE NV | 0.618 | 9 | 1.205 | 17 |
| 小 計 | 1.419 | 25 | 2.751 | 48 |
| スペイン | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 3.723 | 20 | 7.065 | 39 |
| | | | (—) | (0.47429) |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 0.441 | 2 | 1.293 | 7 |
| | | | (—) | (0.06846) |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 | 柄 | 買付 | | 売付 | |
|--|------------------------------|----------|--------|-------------|---------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| ユーロ | | 千口 | 千ユーロ | 千口 | 千ユーロ |
| 外 | スペイン | | | | |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 4.223 | 35 | 7.867 | 71 |
| | | | | (-) | (1) |
| | 小計 | 8.387 | 58 | 16.225 | 118 |
| | | | | (-) | (2) |
| | ベルギー | | | | |
| | AEDIFICA | 0.891 | 50 | 1.181 | 67 |
| | | | | (-) | (1) |
| | AEDIFICA SA-RIGHTS | - | - | 1.22 | 0.47859 |
| | | (1.22) | (1) | | |
| | COFINIMMO | 0.56 | 37 | 0.755 | 48 |
| | CARE PROPERTY INVEST | 0.391 | 4 | 0.72 | 9 |
| | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 0.375 | 6 | 1.145 | 21 |
| | MONTEA NV | 0.307 | 22 | 0.369 | 27 |
| | RETAIL ESTATES | 0.272 | 16 | 0.374 | 22 |
| | SHURGARD SELF STORAGE LTD | 0.981 | 39 | 0.335 | 13 |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 2.338 | 59 | 3.558 | 87 |
| | XIOR STUDENT HOUSING NV | 0.618 | 17 | 0.678 | 18 |
| | 小計 | 6.733 | 253 | 10.335 | 317 |
| | | (1.22) | (1) | (-) | (1) |
| アイルランド | | | | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 3.261 | 3 | 7.428 | 7 | |
| 小計 | 3.261 | 3 | 7.428 | 7 | |
| その他 | | | | | |
| CROMWELL EUROPEAN REIT | 3.8 | 4 | 9.1 | 12 | |
| | | | (-) | (0.95482) | |
| 小計 | 3.8 | 4 | 9.1 | 12 | |
| | | | (-) | (0.95482) | |
| ユーロ計 | 34.406 | 610 | 64.771 | 1,022 | |
| | (1.22) | (1) | (-) | (18) | |
| イギリス | | 千ポンド | | 千ポンド | |
| AEW UK REIT PLC | 1.255 | 1 | 3.032 | 2 | |
| ASSURA PLC | 45.034 | 19 | 75.146 | 31 | |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 9.928 | 5 | 15.488 | 7 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 26.714 | 39 | 46.106 | 68 | |
| | (7.773) | (9) | | | |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 9.316 | 6 | 20.457 | 14 | |
| BRITISH LAND CO PLC | 12.224 | 40 | 22.207 | 78 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 2.667 | 28 | 4.211 | 43 | |
| CLS HOLDINGS PLC | 2.295 | 2 | 6.055 | 6 | |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC | 3.247 | 2 | 7.372 | 5 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | - | - | 19.078 | 15 | |
| DERWENT LONDON PLC | 1.32 | 27 | 2.594 | 52 | |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC | - | - | 5.482 | 3 | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 12.232 | 11 | 19.109 | 17 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 3.57 | 14 | 6.591 | 26 | |
| | | | (-) | (4) | |
| GREAT PORTLAND ESTATES-FULL | - | - | - | - | |
| | (3.157) | (11) | | | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--------------------------------------|----------------------|--------------|----------------------|----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| | 千口 | 千ポンド | 千口 | 千ポンド |
| イギリス | | | | |
| GREAT PORTLAND ESTATES -NIL RTS | — (3.157) | — (4) | — (3.157) | — (4) |
| HELICAL PLC | 4.762 | 12 | 2.647 | 5 |
| HAMMERSON PLC | 45.124 | 11 | 87.924 | 23 |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 4.478 | 3 | 8.372 | 7 |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | 14.091 | 9 | 7.413 | 3 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 9.48 | 57 | 17.531 | 108 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 16.094 (27.735) | 29 (49) | 33.044 | 61 |
| LXI REIT PLC | 20.331 | 19 | 23.349 (50.429) | 21 (49) |
| NEWRIVER REIT PLC | 4.569 | 3 | 8.113 | 6 |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 4.012 | 2 | 9.227 | 6 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 15.315 | 14 | 30.553 | 28 |
| PRS REIT PLC/THE | 4.799 | 3 | 12.234 | 9 |
| REGIONAL REIT LTD | 7.442 | 2 | 14.314 | 4 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 2.446 | 18 | 4.741 | 36 |
| SEGRE PLC | 18.553 | 146 | 28.781 | 226 |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 28.623 | 34 | 46.301 | 57 |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 6.111 | 7 | 11.492 | 13 |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 2.076 | 1 | 5.904 | 3 |
| SCHRODER REIT LTD | 8.214 | 3 | 16.351 | 6 |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 13.211 | 10 | 25.387 | 18 |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | 26.237 | 20 | 13.38 | 10 |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 10.066 | 5 | 18.259 (17.509) | 10 (9) |
| UNITE GROUP PLC | 5.97 | 56 | 10.182 | 94 |
| WAREHOUSE REIT PLC | 5.61 | 4 | 9.362 | 7 |
| WORKSPACE GROUP PLC | 1.816 | 9 | 3.424 | 17 |
| 小 計 | 409.232 (41.822) | 689 (74) | 701.213 (71.095) | 1,162 (67) |
| オーストラリア | | 千オーストラリアドル | | 千オーストラリアドル |
| ABACUS GROUP | 3.948 | 4 | 7.13 | 7 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | — | — | 1.116 | 2 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | — (12.074) | — (15) | — (12.074) | — (31) |
| ARENA REIT | 6.596 | 22 | 10.445 | 37 |
| ABACUS STORAGE KING | 8.863 (12.074) | 9 (15) | 9.768 | 10 |
| BWP TRUST | 7.609 | 26 | 11.172 | 38 |
| CHARTER HALL GROUP | 6.45 | 66 | 11.491 | 125 |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 5.736 | 17 | 11.968 | 37 |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 7.654 | 25 | 14.358 | 48 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 13.314 | 4 | 26.317 | 10 |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 12.253 | 16 | 16.954 | 26 |
| CENTURIA OFFICE REIT | 6.12 | 7 | 10.63 | 12 |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE | 6.411 | 16 | 10.134 | 26 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 7.974 | 26 | 13.53 | 44 |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|--|----------------------|-----------------|----------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| オーストラリア | 千口 | 千オーストラリアドル | 千口 | 千オーストラリアドル |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 1.829 | 4 | 3.931 | 10 |
| DEXUS | 12.355 | 86 | 23.579 | 170 |
| GDI PROPERTY GROUP | 8.329 | 4 | 14.899 | 8 |
| GOODMAN GROUP | 21.128 | 481 | 38.993 | 1,014 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 3.628 | 7 | 7.473 | 17 |
| GPT GROUP | 24.065 | 95 | 44.646 | 182 |
| HEALTHCO REIT | 6.885 | 9 | 9.444 | 12 |
| HOMECO DAILY NEEDS REIT | 26.087 | 30 | 38.54 | 45 |
| HMC CAPITAL LTD | 4.911 | 24 | 5.783 | 32 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 1.73 | 4 | 3.716 | 11 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 4.784 | 19 | 8.112 | 35 |
| MIRVAC GROUP | 50.627 | 102 | 93.288 | 197 |
| NATIONAL STORAGE REIT | 13.308 | 28 | 25.43 | 55 |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY | — | — | 10.237 | 7 |
| RURAL FUNDS GROUP | 4.239 | 7 | 7.531 | 14 |
| REGION RE LTD | 11.783 | 24 | 24.492 | 51 |
| SCENTRE GROUP | 63.005 | 165 | 118.251 | 329 |
| STOCKLAND | 29.117 | 112 | 54.791 | 227 |
| VICINITY CENTRES | 44.834 | 81 | 84.919 | 154 |
| WAYPOINT REIT | 11.267 | 26 | 18.637 | 44 |
| 小 計 | 436.839 (24.148) | 1,562 (31) | 791.705 (12.074) | 3,050 (31) |
| ニュージーランド | | 千ニュージーランドドル | | 千ニュージーランドドル |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 20.712 | 23 | 27.974 | 31 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 12.209 | 25 | 23.841 | 51 |
| KIWI PROPERTY GROUP INC | 17.896 | 14 | 35.579 | 30 |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 20.757 | 24 | 31.007 | 36 |
| STRIDE PROPERTY GROUP | — | — | 16.401 | 20 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | — | — | 14.135 | 28 |
| 小 計 | 71.574 | 87 | 148.937 | 198 |
| 香港 | | 千香港ドル | | 千香港ドル |
| CHAMPION REIT | 34 | 77 | 56 | 122 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 33 | 44 | 55 | 63 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 12 | 26 | 24 | 49 |
| FORTUNE REIT | 26 | 122 | 41 | 181 |
| PROSPERITY REIT | 9 | 12 | 27 | 36 |
| LINK REIT | 30.9 | 1,195 | 56.9 | 2,081 |
| 小 計 | 144.9 | 1,479 | 259.9 | 2,534 |
| シンガポール | | 千シンガポールドル | | 千シンガポールドル |
| AIMS APAC REIT | 12.5 (0.564) | 16 (0.6706) | 14.9 (—) | 18 (0.32512) |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 6.8 | 6 | 20.1 (—) | 21 (0.20687) |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 60.3 | 112 | 113.2 (—) | 213 (0.66613) |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 47.3 | 129 | 79.3 (—) | 211 (1) |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 42.1 | 39 | 59.2 (—) | 55 (1) |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | 買 付 | | 売 付 | |
|---|-------------------|------------------|--------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| シンガポール | 千口 | 千シンガポールドル | 千口 | 千シンガポールドル |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 19.1 | 16 | 32 (-) | 26 (1) |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | - | - | 15.3 (-) | 8 (0.39933) |
| EC WORLD REIT | 0.4 | 0.11807 | - | - |
| ESR-LOGOS REIT | 85.2 | 24 | 143.4 (-) | 41 (0.59534) |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 13.7 | 29 | 23.2 | 50 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 20.1 | 12 | 30.2 (-) | 19 (0.13077) |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 10.4 | 2 | 43.746 (-) | 9 (0.11338) |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 37 | 41 | 67.6 (-) | 70 (0.94427) |
| KEPPEL DC REIT | 17 | 30 | 30.2 (-) | 56 (0.70923) |
| KEPPEL REIT | 28.8 | 24 | 43.6 (-) | 37 (0.16565) |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 19.8 | 11 | 44 | 24 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 27 | 60 | 46.8 (-) | 105 (0.16655) |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 41.1 | 63 | 73.1 (-) | 111 (3) |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | 29.4 | 39 | 53.3 (-) | 71 (0.75392) |
| OUE COMMERCIAL REIT | - | - | 80.5 (-) | 17 (0.0435) |
| PARAGON REIT | 18.9 | 15 | 27 | 22 |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 5.7 | 20 | 10 (-) | 36 (0.38896) |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9.8 | 6 | 17.6 (-) | 11 (0.03023) |
| STARHILL GLOBAL REIT | 15.1 | 7 | 28.2 | 13 |
| SUNTEC REIT | 31 | 35 | 54.4 (-) | 61 (0.3563) |
| 小 計 | 598.5 (0.564) | 747 (0.6706) | 1,150.846 (-) | 1,317 (13) |
| 韓国 | | 千韓国ウォン | | 千韓国ウォン |
| E KOCREF CR-REIT CO LTD | - | - | 0.636 | 3,156 |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE | - | - | 2.44 | 9,735 |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 0.618 | 3,802 | 1.448 | 8,880 |
| LOTTE REIT CO LTD | 1.276 | 3,777 | 2.603 | 8,344 |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | - | - | 0.884 (-) | 3,717 (40) |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | - (0.353) | - (40) | 0.353 | 39 |
| JR REIT XXVII | 1.214 | 4,860 | 2.737 | 10,996 |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 0.747 | 4,053 | 0.886 | 4,394 |
| ESR KENDALL SQUARE REIT LTD | 1.458 | 4,759 | 3.07 | 12,697 |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第 18 期ー

| 銘 柄 | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|-------------------------------|-----------|-------------|-----------|-------------|
| | | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 外 国 | 韓国 | | | | |
| | D&D PLATFORM REIT CO LTD | 0.635 | 1,917 | 1.495 | 4,846 |
| | SK REITS CO LTD | 1.976 | 7,938 | 1.965 | 8,150 |
| | | | | (-) | (24) |
| | SK REITS CO LTD RTS | - | - | - | - |
| | | (0.918) | (24) | (0.918) | (24) |
| | NH ALL-ONE REIT CO LTD | 0.596 | 2,014 | 1.235 | 4,205 |
| | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | - | - | 0.725 | 2,327 |
| | 小 計 | 8.52 | 33,125 | 20.477 | 81,491 |
| | | (1.271) | (64) | (0.918) | (88) |
| 国 | イスラエル | | 千イスラエル・シエケル | | 千イスラエル・シエケル |
| | MENIVIM-THE NEW REIT LTD | 6.894 | 9 | 11.155 | 18 |
| | REIT 1 LTD | 1.75 | 26 | 3.881 | 61 |
| | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 1.765 | 13 | 4.476 | 34 |
| | 小 計 | 10.409 | 49 | 19.512 | 114 |

(注1) 金額は受渡代金。

(注2) 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2023年6月13日～2024年6月12日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年6月12日現在)

外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 比 率 |
|-------------------------------------|---------|-------|-------|--------|-----|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 1.621 | 1.01 | 21 | 3,316 | 0.1 |
| AGREE REALTY CORP | 2.758 | 2.048 | 123 | 19,375 | 0.5 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 2.191 | 1.398 | 15 | 2,402 | 0.1 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST INC | 1.005 | 1.017 | 1 | 174 | 0.0 |
| APARTMENT INCOME REIT CORP | 4.63 | 2.945 | 114 | 17,931 | 0.4 |
| APARTMENT INVT & MGMT CO -A | 4.852 | 2.78 | 22 | 3,491 | 0.1 |
| ACADIA REALTY TRUST | 1.621 | 2.12 | 35 | 5,629 | 0.1 |
| ALEXANDER & BALDWIN INC | 2.247 | 1.504 | 24 | 3,889 | 0.1 |
| ALEXANDER'S INC | 0.069 | 0.044 | 9 | 1,445 | 0.0 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT- A | 9.569 | 6.53 | 232 | 36,494 | 0.9 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 6.7 | 4.411 | 63 | 9,930 | 0.2 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 4.91 | 3.233 | 367 | 57,717 | 1.3 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 4.361 | 2.912 | 574 | 90,277 | 2.1 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 5.293 | 3.568 | 15 | 2,479 | 0.1 |
| SAUL CENTERS INC | 0.407 | 0.268 | 9 | 1,531 | 0.0 |
| BLUEROCK HOMES TRUST INC | 0.183 | — | — | — | — |
| BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC | 2.067 | 1.019 | 3 | 478 | 0.0 |
| BROADSTONE NET LEASE INC | 5.397 | 3.882 | 58 | 9,190 | 0.2 |
| BRT APARTMENTS CORP | 0.417 | 0.245 | 4 | 666 | 0.0 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 9.35 | 6.145 | 135 | 21,291 | 0.5 |
| BOSTON PROPERTIES INC | 4.447 | 2.961 | 172 | 27,180 | 0.6 |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC | 0.757 | 0.511 | 11 | 1,806 | 0.0 |
| COPT DEFENSE PROPERTIES | — | 2.326 | 55 | 8,746 | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC | 0.774 | 0.502 | 11 | 1,811 | 0.0 |
| CITY OFFICE REIT INC | 1.308 | 0.826 | 3 | 612 | 0.0 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 1.638 | 1.013 | 8 | 1,315 | 0.0 |
| CLIPPER REALTY INC | 0.555 | 0.382 | 1 | 223 | 0.0 |
| AMERICOLD REALTY TRUST | 8.398 | 5.453 | 143 | 22,494 | 0.5 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 3.433 | 2.192 | 232 | 36,596 | 0.9 |
| CENTERSPACE | 0.494 | 0.312 | 20 | 3,265 | 0.1 |
| CTO REALTY GROWTH INC | 0.688 | 0.419 | 7 | 1,169 | 0.0 |
| CARETRUST REIT INC | 3.102 | 2.705 | 68 | 10,733 | 0.3 |
| CUBESMART | 7.001 | 4.616 | 198 | 31,218 | 0.7 |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|-------|---------|-----|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % | |
| COUSINS PROPERTIES INC | 4.724 | 3.062 | 68 | 10,744 | 0.3 | |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT | 10.4 | 14.9 | 8 | 1,346 | 0.0 | |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES, INC. | 2.922 | 1.973 | 23 | 3,660 | 0.1 | |
| DOUGLAS EMMETT INC | 5.536 | 3.456 | 44 | 7,057 | 0.2 | |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST | 7.695 | 4.486 | 12 | 1,974 | 0.0 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 8.963 | 6.63 | 993 | 156,220 | 3.7 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 7.116 | 14.534 | 278 | 43,847 | 1.0 | |
| DIAMONDRock HOSPITALITY CO | 6.576 | 4.345 | 35 | 5,587 | 0.1 | |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST | 9.1 | 9.1 | — | — | — | |
| EASTGROUP PROPERTIES INC | 1.358 | 0.977 | 162 | 25,561 | 0.6 | |
| ELME COMMUNITIES | 2.708 | 1.821 | 27 | 4,365 | 0.1 | |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 5.454 | 3.827 | 234 | 36,904 | 0.9 | |
| EPR PROPERTIES | 2.363 | 1.562 | 62 | 9,800 | 0.2 | |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 4.484 | 3.165 | 86 | 13,643 | 0.3 | |
| EQUITY COMMONWEALTH | 3.45 | 2.212 | 42 | 6,708 | 0.2 | |
| EQUINIX INC | 2.885 | 1.927 | 1,465 | 230,322 | 5.4 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 10.617 | 7.086 | 464 | 73,022 | 1.7 | |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST INC | 4.286 | 2.712 | 24 | 3,922 | 0.1 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 2.014 | 1.318 | 350 | 55,041 | 1.3 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 4.175 | 4.338 | 656 | 103,176 | 2.4 | |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 2.679 | 1.877 | 45 | 7,093 | 0.2 | |
| FARMLAND PARTNERS INC | 1.675 | 0.902 | 9 | 1,534 | 0.0 | |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC | 4.119 | 2.7 | 126 | 19,856 | 0.5 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 2.282 | 1.504 | 150 | 23,611 | 0.6 | |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP | 2.891 | 1.815 | 2 | 470 | 0.0 | |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | 8.028 | 5.482 | 238 | 37,429 | 0.9 | |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC | 2.043 | 1.278 | 11 | 1,788 | 0.0 | |
| GLOBAL NET LEASE INC | 3.34 | 4.049 | 28 | 4,551 | 0.1 | |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 1.2 | 0.828 | 11 | 1,841 | 0.0 | |
| GETTY REALTY CORP | 1.245 | 1.018 | 26 | 4,242 | 0.1 | |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 3.313 | 2.191 | 53 | 8,435 | 0.2 | |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | 4.295 | 2.626 | 12 | 1,927 | 0.0 | |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 11.864 | 7.778 | 128 | 20,236 | 0.5 | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 22.29 | 14.483 | 260 | 40,915 | 1.0 | |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 1.235 | — | — | — | — | |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC | 0.871 | 0.581 | 61 | 9,722 | 0.2 | |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST | 2.479 | 1.228 | 4 | 722 | 0.0 | |
| INDUS REALTY TRUST INC | 0.179 | — | — | — | — | |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 3.54 | 2.231 | 13 | 2,062 | 0.0 | |
| INVITATION HOMES INC | 18.107 | 11.81 | 414 | 65,168 | 1.5 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 9.063 | 5.995 | 523 | 82,306 | 1.9 | |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST INC | 7.05 | 4.54 | 79 | 12,554 | 0.3 | |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP | 2.161 | 1.4 | 33 | 5,317 | 0.1 | |
| JBG SMITH PROPERTIES | 3.118 | 1.805 | 25 | 4,012 | 0.1 | |
| KIMCO REALTY CORP | 19.281 | 13.676 | 250 | 39,345 | 0.9 | |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT | 26 | 8.9 | 1 | 194 | 0.0 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------|--------|---------|---------|-----|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % | |
| KILROY REALTY CORP | 3.319 | 2.153 | 67 | 10,550 | 0.2 | |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 6.9 | 4.548 | 100 | 15,722 | 0.4 | |
| GLADSTONE LAND CORP | 0.999 | 0.691 | 9 | 1,461 | 0.0 | |
| LIFE STORAGE INC | 2.65 | — | — | — | — | |
| LTC PROPERTIES INC | 1.295 | 0.858 | 28 | 4,534 | 0.1 | |
| LXP INDUSTRIAL TRUST | 8.684 | 6.066 | 52 | 8,296 | 0.2 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 3.6 | 2.396 | 328 | 51,593 | 1.2 | |
| MACERICH CO/THE | 6.71 | 4.477 | 65 | 10,289 | 0.2 | |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 18.645 | 12.417 | 61 | 9,623 | 0.2 | |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 60.968 | 19.668 | 1 | 210 | 0.0 | |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 1.353 | 0.9 | 58 | 9,144 | 0.2 | |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY | — | 0.303 | 7 | 1,165 | 0.0 | |
| NNN REIT INC | 5.657 | 3.737 | 155 | 24,474 | 0.6 | |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 2.634 | 1.601 | 62 | 9,876 | 0.2 | |
| NETSTREIT CORP | 1.749 | 1.424 | 23 | 3,698 | 0.1 | |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST | 0.987 | 0.692 | 3 | 551 | 0.0 | |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST | 0.7 | 0.474 | 17 | 2,769 | 0.1 | |
| REALTY INCOME CORP | 19.551 | 17.074 | 891 | 140,222 | 3.3 | |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST | 3.505 | — | — | — | — | |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | 7.303 | 5.025 | 158 | 24,884 | 0.6 | |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 0.548 | 0.328 | 7 | 1,214 | 0.0 | |
| ORION OFFICE REIT INC | 1.87 | 1.156 | 3 | 621 | 0.0 | |
| OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST | 1.483 | 0.386 | 0.87622 | 137 | 0.0 | |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC | 3.819 | 2.565 | 17 | 2,762 | 0.1 | |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 17.045 | — | — | — | — | |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 2.659 | 2.498 | 33 | 5,333 | 0.1 | |
| PHILLIPS EDISON & COMPANY INC | 3.651 | 2.468 | 77 | 12,183 | 0.3 | |
| PARAMOUNT GROUP INC | 5.092 | 3.424 | 15 | 2,416 | 0.1 | |
| ALPINE INCOME PROPERTY TRUST | 0.383 | 0.178 | 2 | 429 | 0.0 | |
| PARK HOTELS & RESORTS INC | 7.081 | 4.353 | 63 | 10,011 | 0.2 | |
| PEAKSTONE REALTY TRUST | — | 0.747 | 8 | 1,345 | 0.0 | |
| PROLOGIS INC | 28.776 | 18.969 | 2,116 | 332,744 | 7.8 | |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC | 1.254 | 0.76 | 15 | 2,511 | 0.1 | |
| PRIME US REIT | 17.6 | 3.37 | 0.39429 | 61 | 0.0 | |
| PUBLIC STORAGE | 4.928 | 3.249 | 892 | 140,279 | 3.3 | |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A | 0.588 | 0.419 | 5 | 865 | 0.0 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 4.801 | 3.373 | 204 | 32,134 | 0.8 | |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 5.895 | 4.326 | 193 | 30,386 | 0.7 | |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1.737 | 1.219 | 120 | 18,920 | 0.4 | |
| RLJ LODGING TRUST | 5.104 | 3.182 | 30 | 4,827 | 0.1 | |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 3.922 | 2.612 | 32 | 5,083 | 0.1 | |
| RPT REALTY | 2.781 | — | — | — | — | |
| THE NECESSITY RETAIL REIT INC | 4.331 | — | — | — | — | |
| SAFEHOLD INC | 1.237 | 0.928 | 17 | 2,680 | 0.1 | |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 7.2 | 4.793 | 67 | 10,541 | 0.2 | |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 6.56 | 4.259 | 42 | 6,668 | 0.2 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|---------|---------|---------|-----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 千口 | 千口 | 千ドル | 千円 | % | |
| SITE CENTERS CORP | 5.777 | 3.732 | 53 | 8,372 | 0.2 | |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTERS | 3.253 | 2.232 | 60 | 9,509 | 0.2 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 2.033 | 1.342 | 70 | 11,097 | 0.3 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 10.192 | 6.691 | 1,008 | 158,604 | 3.7 | |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 4.348 | — | — | — | — | |
| STAG INDUSTRIAL INC | 5.587 | 3.708 | 130 | 20,449 | 0.5 | |
| STAR HOLDINGS | 0.392 | — | — | — | — | |
| SUN COMMUNITIES INC | 3.862 | 2.555 | 291 | 45,754 | 1.1 | |
| SERVICE PROPERTIES TRUST | 5.32 | 3.436 | 17 | 2,673 | 0.1 | |
| TERRENO REALTY CORP | 2.294 | 1.903 | 109 | 17,262 | 0.4 | |
| URSTADT BIDDLE - CLASS A | 0.979 | — | — | — | — | |
| UDR INC | 9.641 | 6.213 | 244 | 38,386 | 0.9 | |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 3.699 | 2.439 | 41 | 6,595 | 0.2 | |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 0.419 | 0.264 | 10 | 1,614 | 0.0 | |
| UMH PROPERTIES INC | 1.735 | 1.294 | 19 | 3,053 | 0.1 | |
| UNITI GROUP INC | — | 4.948 | 15 | 2,508 | 0.1 | |
| VICI PROPERTIES INC | 31.289 | 21.239 | 597 | 93,958 | 2.2 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 5.074 | 3.235 | 76 | 12,083 | 0.3 | |
| VERIS RESIDENTIAL INC | 2.548 | 1.662 | 24 | 3,885 | 0.1 | |
| VENTAS INC | 12.469 | 8.261 | 409 | 64,403 | 1.5 | |
| WELLTOWER INC | 14.73 | 11.363 | 1,175 | 184,818 | 4.3 | |
| WP CAREY INC | 6.566 | 4.489 | 248 | 38,990 | 0.9 | |
| WHITESTONE REIT | 1.554 | 0.976 | 12 | 2,006 | 0.0 | |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 3.305 | 2.181 | 30 | 4,848 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 808.037 | 513.654 | 21,037 | 3,307,248 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 145 | 138 | — | < 77.3% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ALLIED PROPERTIES REIT | 1.933 | 1.3 | 20 | 2,393 | 0.1 | |
| AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E | 0.717 | — | — | — | — | |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.811 | 1.052 | 6 | 778 | 0.0 | |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.693 | 0.502 | 34 | 3,961 | 0.1 | |
| BTB REIT | 1.466 | 0.654 | 2 | 239 | 0.0 | |
| CAN APARTMENT PROP REIT | 2.602 | 1.703 | 73 | 8,377 | 0.2 | |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 4.995 | 3.33 | 42 | 4,802 | 0.1 | |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.518 | 1.087 | 13 | 1,556 | 0.0 | |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1.718 | 1.101 | 14 | 1,688 | 0.0 | |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT | 0.628 | 0.082 | 1 | 181 | 0.0 | |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 4.005 | 2.775 | 34 | 3,966 | 0.1 | |
| EUROPEAN RESIDENTIAL REIT | 1.144 | — | — | — | — | |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3.194 | 2.155 | 31 | 3,580 | 0.1 | |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.973 | 0.643 | 43 | 4,952 | 0.1 | |
| BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.495 | 0.339 | 5 | 601 | 0.0 | |
| H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS | 3.934 | 2.66 | 23 | 2,732 | 0.1 | |
| INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 2.22 | 1.471 | 17 | 1,986 | 0.0 | |
| INOVALIS REIT | 0.325 | — | — | — | — | |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | 1.824 | 1.203 | 20 | 2,364 | 0.1 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|--------|---------|--------|--------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (カナダ) | 千口 | 千口 | 千カナダドル | 千円 | % | |
| MINTO APARTMENT REIT | 0.56 | 0.386 | 5 | 671 | 0.0 | |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT | 0.66 | 0.383 | 5 | 670 | 0.0 | |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REIT | 3.797 | 2.471 | 12 | 1,397 | 0.0 | |
| NEXUS INDUSTRIAL REIT | 1.012 | 0.639 | 4 | 504 | 0.0 | |
| PRIMARIS REIT | 1.442 | 0.981 | 13 | 1,498 | 0.0 | |
| PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 0.926 | 0.419 | 2 | 239 | 0.0 | |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 4.613 | 3.047 | 51 | 5,863 | 0.1 | |
| SLATE GROCERY REIT | 0.956 | 0.581 | 6 | 726 | 0.0 | |
| SLATE OFFICE REIT | 1.037 | — | — | — | — | |
| SMARTCENTRES REIT VAR VT UN | 2.196 | 1.469 | 32 | 3,701 | 0.1 | |
| TRUE NORTH COMMERCIAL REIT | 1.553 | 0.014 | 0.11872 | 13 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 54.947 | 32.447 | 520 | 59,452 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 30 | 26 | — | <1.4%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | | |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 0.201 | — | — | — | — | |
| HAMBORNER REIT AG | 2.089 | 1.467 | 9 | 1,614 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 2.29 | 1.467 | 9 | 1,614 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2 | 1 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE | 1.94 | 0.651 | 1 | 204 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1.94 | 0.651 | 1 | 204 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| ALTAREA | 0.138 | 0.095 | 8 | 1,470 | 0.0 | |
| CARMILA | 1.835 | 1.152 | 19 | 3,227 | 0.1 | |
| COVIVIO | 1.457 | 1.005 | 46 | 7,901 | 0.2 | |
| GECINA SA | 1.694 | 1.046 | 98 | 16,630 | 0.4 | |
| ICADE | 0.98 | 0.648 | 17 | 2,874 | 0.1 | |
| KLEPIERRE | 6.06 | 3.978 | 104 | 17,564 | 0.4 | |
| MERCIALYS | 2.483 | 1.946 | 21 | 3,695 | 0.1 | |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 3.318 | 2.081 | 156 | 26,447 | 0.6 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 17.965 | 11.951 | 472 | 79,810 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | <1.9%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | 1.296 | 0.896 | 20 | 3,440 | 0.1 | |
| NSI NV | 0.544 | 0.376 | 7 | 1,236 | 0.0 | |
| VASTNED RETAIL NV | 0.552 | 0.375 | 8 | 1,503 | 0.0 | |
| WERELDHAVE NV | 1.324 | 0.737 | 9 | 1,654 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 3.716 | 2.384 | 46 | 7,834 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4 | 4 | — | <0.2%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | 9.271 | 5.929 | 35 | 6,044 | 0.1 | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA | 1.876 | 1.024 | 7 | 1,185 | 0.0 | |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 10.398 | 6.754 | 72 | 12,208 | 0.3 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 21.545 | 13.707 | 115 | 19,438 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3 | 3 | — | <0.5%> | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|--------|--------|--------|----------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ベルギー) | 千口 | 千口 | 千ユーロ | 千円 | % | |
| AEDIFICA | 1.248 | 0.958 | 54 | 9,127 | 0.2 | |
| COFINIMMO | 0.957 | 0.762 | 43 | 7,330 | 0.2 | |
| CARE PROPERTY INVEST | 1.096 | 0.767 | 10 | 1,814 | 0.0 | |
| INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES | 0.77 | — | — | — | — | |
| MONTEA NV | 0.433 | 0.371 | 29 | 5,009 | 0.1 | |
| RETAIL ESTATES | 0.355 | 0.253 | 15 | 2,694 | 0.1 | |
| SHURGARD SELF STORAGE LTD | — | 0.646 | 24 | 4,094 | 0.1 | |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | 4.814 | 3.594 | 91 | 15,443 | 0.4 | |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | 0.749 | 0.689 | 19 | 3,337 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 10.422 | 8.04 | 289 | 48,852 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8 | 8 | — | < 1.1% > | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | 13.059 | 8.892 | 8 | 1,388 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 13.059 | 8.892 | 8 | 1,388 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| (ユーロ…その他) | | | | | | |
| CROMWELL EUROPEAN REIT | 11.78 | 6.48 | 9 | 1,553 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 11.78 | 6.48 | 9 | 1,553 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1 | 1 | — | < 0.0% > | |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 82.717 | 53.572 | 952 | 160,696 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 28 | 27 | — | < 3.8% > | |
| (イギリス) | | | 千ポンド | | | |
| AEW UK REIT PLC | 4.639 | 2.862 | 2 | 491 | 0.0 | |
| ASSURA PLC | 91.985 | 61.873 | 24 | 4,852 | 0.1 | |
| ABRDN PROPERTY INCOME TRUST | 13.462 | 7.902 | 4 | 822 | 0.0 | |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | 58.856 | 47.237 | 71 | 14,383 | 0.3 | |
| BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 25.684 | 14.543 | 10 | 2,168 | 0.1 | |
| BRITISH LAND CO PLC | 29.095 | 19.112 | 80 | 16,214 | 0.4 | |
| BIG YELLOW GROUP PLC | 5.489 | 3.945 | 47 | 9,413 | 0.2 | |
| CLS HOLDINGS PLC | 5.959 | 2.199 | 1 | 380 | 0.0 | |
| CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC | 13.264 | 9.139 | 6 | 1,295 | 0.0 | |
| CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC | 19.078 | — | — | — | — | |
| DERWENT LONDON PLC | 3.535 | 2.261 | 51 | 10,392 | 0.2 | |
| EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC | 5.482 | — | — | — | — | |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | 19.386 | 12.509 | 11 | 2,321 | 0.1 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | 7.829 | 4.808 | 16 | 3,229 | 0.1 | |
| GREAT PORTLAND ESTATES-FULL | — | 3.157 | 10 | 2,117 | 0.0 | |
| HELICAL PLC | — | 2.115 | 4 | 908 | 0.0 | |
| HAMMERSON PLC | 122.645 | 79.845 | 22 | 4,418 | 0.1 | |
| HOME REIT PLC | 19.023 | 19.023 | — | — | — | |
| IMPACT HEALTHCARE REIT PLC | 12.484 | 8.59 | 7 | 1,461 | 0.0 | |
| LIFE SCIENCE REIT PLC | — | 6.678 | 2 | 470 | 0.0 | |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 23.411 | 15.36 | 96 | 19,325 | 0.5 | |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | 30.695 | 41.48 | 81 | 16,342 | 0.4 | |
| LXI REIT PLC | 53.447 | — | — | — | — | |
| NEWRIVER REIT PLC | 10.03 | 6.486 | 4 | 880 | 0.0 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--------------------------------------|---------------|---------|------------|---------|---------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (イギリス) | 千口 | 千口 | 千ポンド | 千円 | % | |
| PICTON PROPERTY INCOME LTD | 16.567 | 11.352 | 7 | 1,461 | 0.0 | |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | 42.943 | 27.705 | 25 | 5,024 | 0.1 | |
| PRS REIT PLC/THE | 18.138 | 10.703 | 8 | 1,654 | 0.0 | |
| REGIONAL REIT LTD | 14.307 | 7.435 | 1 | 328 | 0.0 | |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | 6.823 | 4.528 | 37 | 7,505 | 0.2 | |
| SEGRO PLC | 37.701 | 27.473 | 246 | 49,267 | 1.2 | |
| SHAFTESBURY CAPITAL PLC | 57.139 | 39.461 | 54 | 11,004 | 0.3 | |
| URBAN LOGISTICS REIT PLC | 15.165 | 9.784 | 11 | 2,322 | 0.1 | |
| TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC | 10.641 | 6.813 | 3 | 770 | 0.0 | |
| SCHRODER REIT LTD | 18.221 | 10.084 | 4 | 924 | 0.0 | |
| SUPERMARKET INCOME REIT PLC | 38.01 | 25.834 | 18 | 3,646 | 0.1 | |
| TARGET HEALTHCARE REIT PLC | — | 12.857 | 9 | 1,974 | 0.0 | |
| UK COMMERCIAL PROPERTY REIT | 25.702 | — | — | — | — | |
| UNITE GROUP PLC | 12.434 | 8.222 | 72 | 14,525 | 0.3 | |
| WAREHOUSE REIT PLC | 12.559 | 8.807 | 7 | 1,413 | 0.0 | |
| WORKSPACE GROUP PLC | 4.433 | 2.825 | 15 | 3,133 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 906.261 | 585.007 | 1,083 | 216,847 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 36 | 36 | — | <5.1%> | |
| (オーストラリア) | | | 千オーストラリアドル | | | |
| ABACUS GROUP | — | 8.892 | 9 | 1,032 | 0.0 | |
| ABACUS PROPERTY GROUP | 13.19 | — | — | — | — | |
| ARENA REIT | 11.211 | 7.362 | 26 | 2,786 | 0.1 | |
| ABACUS STORAGE KING | — | 11.169 | 12 | 1,343 | 0.0 | |
| BWP TRUST | 14.828 | 11.265 | 40 | 4,240 | 0.1 | |
| CHARTER HALL GROUP | 14.615 | 9.574 | 119 | 12,381 | 0.3 | |
| CENTURIA INDUSTRIAL REIT | 17.288 | 11.056 | 34 | 3,565 | 0.1 | |
| CHARTER HALL LONG WALE REIT | 20.492 | 13.788 | 47 | 4,890 | 0.1 | |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | 41.776 | 28.773 | 12 | 1,268 | 0.0 | |
| CENTURIA CAPITAL GROUP | 21.39 | 16.689 | 28 | 2,985 | 0.1 | |
| CENTURIA OFFICE REIT | 13.178 | 8.668 | 10 | 1,051 | 0.0 | |
| CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE | 10.732 | 7.009 | 17 | 1,766 | 0.0 | |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | 16.279 | 10.723 | 34 | 3,614 | 0.1 | |
| DEXUS INDUSTRIA REIT | 6.508 | 4.406 | 12 | 1,343 | 0.0 | |
| DEXUS | 33.52 | 22.296 | 149 | 15,515 | 0.4 | |
| GDI PROPERTY GROUP | 17.268 | 10.698 | 6 | 693 | 0.0 | |
| GOODMAN GROUP | 53.346 | 35.481 | 1,232 | 127,797 | 3.0 | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA | 9.471 | 5.626 | 13 | 1,371 | 0.0 | |
| GPT GROUP | 59.62 | 39.039 | 162 | 16,883 | 0.4 | |
| HEALTHCO REIT | 12.454 | 9.895 | 11 | 1,154 | 0.0 | |
| HOMEKO DAILY NEEDS REIT | 49.494 | 37.041 | 44 | 4,590 | 0.1 | |
| HMC CAPITAL LTD | 5.929 | 5.057 | 37 | 3,854 | 0.1 | |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD | 6.029 | 4.043 | 12 | 1,341 | 0.0 | |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | 11.101 | 7.773 | 37 | 3,917 | 0.1 | |
| MIRVAC GROUP | 123.004 | 80.343 | 151 | 15,748 | 0.4 | |
| NATIONAL STORAGE REIT | 38.363 | 26.241 | 59 | 6,123 | 0.1 | |
| RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY | 10.237 | — | — | — | — | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|--|---------------|-----------|-------------|--------|---------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 千口 | 千口 | 千オーストラリアドル | 千円 | % | |
| RURAL FUNDS GROUP | 11.326 | 8.034 | 16 | 1,683 | 0.0 | |
| REGION RE LTD | 35.452 | 22.743 | 49 | 5,118 | 0.1 | |
| SCENTRE GROUP | 161.805 | 106.559 | 332 | 34,479 | 0.8 | |
| STOCKLAND | 74.418 | 48.744 | 217 | 22,596 | 0.5 | |
| VICINITY CENTRES | 120.295 | 80.21 | 151 | 15,763 | 0.4 | |
| WAYPOINT REIT | 21.296 | 13.926 | 32 | 3,365 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,055.915 | 713.123 | 3,126 | 324,270 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 31 | 31 | — | <7.6%> | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| ARGOSY PROPERTY LTD | 24.823 | 17.561 | 18 | 1,829 | 0.0 | |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | 33.449 | 21.817 | 46 | 4,471 | 0.1 | |
| KIWI PROPERTY GROUP INC | 50.684 | 33.001 | 27 | 2,673 | 0.1 | |
| PRECINCT PROPERTIES GROUP | 43.134 | 32.884 | 38 | 3,710 | 0.1 | |
| STRIDE PROPERTY GROUP | 16.401 | — | — | — | — | |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | 14.135 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 182.626 | 105.263 | 131 | 12,685 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6 | 4 | — | <0.3%> | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| CHAMPION REIT | 61 | 39 | 63 | 1,271 | 0.0 | |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 68 | 46 | 46 | 925 | 0.0 | |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 33 | 21 | 36 | 739 | 0.0 | |
| FORTUNE REIT | 46 | 31 | 122 | 2,464 | 0.1 | |
| PROSPERITY REIT | 41 | 23 | 31 | 634 | 0.0 | |
| LINK REIT | 78.8 | 52.8 | 1,710 | 34,436 | 0.8 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 327.8 | 212.8 | 2,010 | 40,473 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > | 6 | 6 | — | <0.9%> | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | | |
| AIMS APAC REIT | 16.115 | 14.279 | 18 | 2,123 | 0.0 | |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | 27.25 | 13.95 | 13 | 1,555 | 0.0 | |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 156.475 | 103.575 | 199 | 23,224 | 0.5 | |
| CAPITALAND ASCENDAS REIT | 104.75 | 72.75 | 186 | 21,721 | 0.5 | |
| CAPITALAND ASCOTT TRUST | 68.589 | 51.489 | 45 | 5,323 | 0.1 | |
| CAPITALAND CHINA TRUST | 37.008 | 24.108 | 15 | 1,834 | 0.0 | |
| DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST | 15.3 | — | — | — | — | |
| EC WORLD REIT | 4 | 4.4 | 0.8184 | 95 | 0.0 | |
| ESR-LOGOS REIT | 182.551 | 124.351 | 35 | 4,117 | 0.1 | |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | 33.079 | 23.579 | 50 | 5,889 | 0.1 | |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 32.1 | 22 | 13 | 1,546 | 0.0 | |
| FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 33.346 | — | — | — | — | |
| FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST | 91.203 | 60.603 | 58 | 6,759 | 0.2 | |
| KEPPEL DC REIT | 41.04 | 27.84 | 49 | 5,789 | 0.1 | |
| KEPPEL REIT | 61.35 | 46.55 | 39 | 4,569 | 0.1 | |
| LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT | 60.321 | 36.121 | 19 | 2,287 | 0.1 | |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 62.669 | 42.869 | 92 | 10,757 | 0.3 | |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 101.192 | 69.192 | 91 | 10,611 | 0.2 | |
| MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | 71.809 | 47.909 | 58 | 6,790 | 0.2 | |

しんきんグローバルリートマザーファンド ー第18期ー

| 銘 柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | | |
|---|----------------------------|------------------|-----------------|-------------|----------------------|--|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (シンガポール) | 千口 | 千口 | 千シンガポールドル | 千円 | % | |
| QUE COMMERCIAL REIT | 80.5 | — | — | — | — | |
| PARAGON REIT | 33.9 | 25.8 | 21 | 2,532 | 0.1 | |
| PARKWAYLIFE REAL ESTATE | 12.3 | 8 | 28 | 3,345 | 0.1 | |
| SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 17.5 | 9.7 | 6 | 749 | 0.0 | |
| STARHILL GLOBAL REIT | 42.1 | 29 | 13 | 1,617 | 0.0 | |
| SUNTEC REIT | 69.8 | 46.4 | 49 | 5,714 | 0.1 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 1,456.247 25 | 904.465 22 | 1,109 — | 128,957 <3.0%> | |
| (韓国) | | | 千韓国ウォン | | | |
| E KOCREF CR-REIT CO LTD | 0.636 | — | — | — | — | |
| MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE | 2.44 | — | — | — | — | |
| SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 2.346 | 1.516 | 9,550 | 1,089 | 0.0 | |
| LOTTE REIT CO LTD | 3.845 | 2.518 | 8,636 | 985 | 0.0 | |
| IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD | 0.884 | — | — | — | — | |
| JR REIT XXVII | 4.919 | 3.396 | 14,076 | 1,606 | 0.0 | |
| KORAMCO LIFE INFRA REIT | 1.185 | 1.046 | 4,958 | 565 | 0.0 | |
| ESR KENDALL SQUARE REIT LTD | 4.925 | 3.313 | 16,101 | 1,837 | 0.0 | |
| D&D PLATFORM REIT CO LTD | 1.911 | 1.051 | 3,731 | 425 | 0.0 | |
| SK REITS CO LTD | 2.453 | 2.464 | 11,950 | 1,363 | 0.0 | |
| NH ALL-ONE REIT CO LTD | 1.284 | 0.645 | 2,351 | 268 | 0.0 | |
| SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | 0.725 | — | — | — | — | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 27.553 12 | 15.949 8 | 71,355 — | 8,141 <0.2%> | |
| (イスラエル) | | | 千イスラエル・シェケル | | | |
| MENIVIM-THE NEW REIT LTD | 20.112 | 15.851 | 25 | 1,084 | 0.0 | |
| REIT 1 LTD | 6.162 | 4.031 | 57 | 2,445 | 0.1 | |
| SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 7.289 | 4.578 | 30 | 1,294 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 33.563 3 | 24.46 3 | 113 — | 4,825 <0.1%> | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 > | 4,935.666 322 | 3,160.74 301 | — — | 4,263,598 <99.7%> | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >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り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注4) —印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2024年6月12日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 4,263,599 | 98.5 |
| コール・ローン等、その他 | 63,865 | 1.5 |
| 投資信託財産総額 | 4,327,464 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (4,280,452千円) の投資信託財産総額 (4,327,464千円) に対する比率は98.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2024年6月12日現在、1ドル=157.21円、1カナダドル=114.27円、1ユーロ=168.78円、1ポンド=200.19円、1オーストラリアドル=103.71円、1ニュージーランドドル=96.45円、1香港ドル=20.13円、1シンガポールドル=116.18円、100ウォン=11.41円、1イスラエル・シェケル=42.4293円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年6月12日現在)

○損益の状況 (2023年6月13日~2024年6月12日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 4,331,428,644 |
| コール・ローン等 | 50,418,543 |
| 投資証券(評価額) | 4,263,599,090 |
| 未収入金 | 9,600,989 |
| 未収配当金 | 7,810,010 |
| 未収利息 | 12 |
| (B) 負債 | 53,982,152 |
| 未払金 | 3,982,152 |
| 未払解約金 | 50,000,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 4,277,446,492 |
| 元本 | 1,539,119,867 |
| 次期繰越損益金 | 2,738,326,625 |
| (D) 受益権総口数 | 1,539,119,867口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 27,792円 |

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 233,712,257 |
| 受取配当金 | 231,840,298 |
| 受取利息 | 1,108 |
| その他収益金 | 1,881,017 |
| 支払利息 | △ 10,166 |
| (B) 有価証券売買損益 | 668,681,033 |
| 売買益 | 1,116,115,449 |
| 売買損 | △ 447,434,416 |
| (C) 保管費用等 | △ 22,857,107 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 879,536,183 |
| (E) 前期繰越損益金 | 3,164,536,826 |
| (F) 追加信託差損益金 | 1,282,787,519 |
| (G) 解約差損益金 | △2,588,533,903 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 2,738,326,625 |
| 次期繰越損益金(H) | 2,738,326,625 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は2,351,176,329円、期中追加設定元本額は933,012,481円、期中一部解約元本額は1,745,068,943円です。

(注2) 当親投資信託を投資対象とする投資信託の当期末元本額
しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 1,231,651,912円
しんきんグローバル6資産ファンド(1年決算型) 307,467,955円

(注3) 1口当たり純資産額は2.7792円です。

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。