

○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／国内／株式 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 主要投資対象 | 「しんきんフコクSRIマザーファンド」(以下、「親投資信託」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することがあります。 |
| 運用方針 | <p>①投資にあたっては、主として親投資信託の受益証券への投資を通じ、原則として以下の方針に基づき運用を行います。</p> <p>1)投資にあたっては、我が国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>2)東証株価指数(TOPIX)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ます。</p> <p>3)銘柄選定にあたっては、持続的に成長する可能性が高いと考えられる、財務面・環境面、社会・倫理面を強く意識する企業への投資を基本とします。</p> <p>4)株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>5)親投資信託の運用指図に関する権限は、富国生命投資顧問株式会社に委託します。</p> <p>②株式以外の資産への実質投資割合(投資信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と投資信託財産に属する親投資信託の受益証券の時価総額に親投資信託の投資信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が投資信託財産の総額に占める割合)は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>③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> |
| 主投資制限 | <p>①株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> |
| 収益分配方針 | <p>①分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>②分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないこともあります。</p> |

運用報告書(全体版)

しんきんSRIファンド

決算日

(第16期：2022年12月7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SRIファンド」は2022年12月7日に第16期の決算を行いました。

ここに、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・PHSからは03-5524-8181
 9:00~17:00

 しんきんアセットマネジメント投信株式会社

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。

〒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SRIファンド | 頁 |
|------------------------------|----|
| 最近5期の運用実績 | 1 |
| 当期中の基準価額と市況等の推移 | 1 |
| 第16期の運用経過等 | 2 |
| 1万口当たりの費用明細 | 5 |
| 売買及び取引の状況 | 7 |
| 株式売買比率 | 7 |
| 利害関係人との取引状況等 | 7 |
| 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 | 7 |
| 自社による当ファンドの設定・解約状況 | 7 |
| 組入資産の明細 | 8 |
| 投資信託財産の構成 | 8 |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 9 |
| 損益の状況 | 9 |
| 分配金のお知らせ | 10 |
| ◇参考情報 | |
| 親投資信託の組入資産の明細 | 11 |
| ◇親投資信託の運用報告書 | |
| しんきんフコクSRIマザーファンド | 13 |

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5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配落) | 基準価額 | | | T O P I X (ベンチマーク) | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|---------------|------|------|----------|-----------------------|------|--------|--------|------|
| | | 税金分配 | み金騰落 | 期中率 | 騰落 | 期中率 | | | |
| | 円 | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 | |
| 12期(2018年12月7日) | 10,252 | 300 | △7.4 | 1,620.45 | △9.3 | 98.9 | — | 1,170 | |
| 13期(2019年12月9日) | 10,748 | 600 | 10.7 | 1,722.07 | 6.3 | 99.0 | — | 1,220 | |
| 14期(2020年12月7日) | 10,612 | 700 | 5.2 | 1,760.75 | 2.2 | 98.2 | — | 1,237 | |
| 15期(2021年12月7日) | 11,078 | 800 | 11.9 | 1,989.85 | 13.0 | 98.9 | — | 1,462 | |
| 16期(2022年12月7日) | 10,417 | 350 | △2.8 | 1,948.31 | △2.1 | 98.7 | — | 1,398 | |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 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 | 基準価額 | | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|------------|--------|------|-----------------------|------|--------|--------|
| | | 騰落率 | T O P I X (ベンチマーク) | 騰落率 | | |
| (期首) | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| 2021年12月7日 | 11,078 | — | 1,989.85 | — | 98.9 | — |
| 12月末 | 11,029 | △0.4 | 1,992.33 | 0.1 | 98.8 | — |
| 2022年1月末 | 10,419 | △5.9 | 1,895.93 | △4.7 | 98.8 | — |
| 2月末 | 10,278 | △7.2 | 1,886.93 | △5.2 | 98.9 | — |
| 3月末 | 10,664 | △3.7 | 1,946.40 | △2.2 | 97.8 | — |
| 4月末 | 10,379 | △6.3 | 1,899.62 | △4.5 | 97.9 | — |
| 5月末 | 10,449 | △5.7 | 1,912.67 | △3.9 | 98.0 | — |
| 6月末 | 10,345 | △6.6 | 1,870.82 | △6.0 | 98.6 | — |
| 7月末 | 10,731 | △3.1 | 1,940.31 | △2.5 | 99.3 | — |
| 8月末 | 10,795 | △2.6 | 1,963.16 | △1.3 | 99.4 | — |
| 9月末 | 10,191 | △8.0 | 1,835.94 | △7.7 | 98.5 | — |
| 10月末 | 10,688 | △3.5 | 1,929.43 | △3.0 | 98.5 | — |
| 11月末 | 10,990 | △0.8 | 1,985.57 | △0.2 | 98.4 | — |
| (期末) | | | | | | |
| 2022年12月7日 | 10,767 | △2.8 | 1,948.31 | △2.1 | 98.7 | — |

(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。

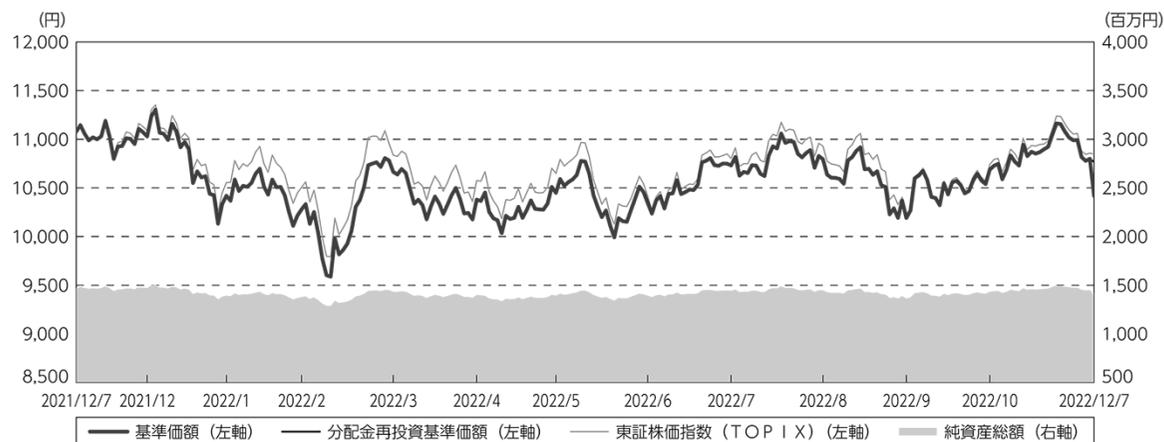
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 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JPIX総研又は株式会社JPIX総研の関連会社(以下「JPIX」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JPIXが有します。JPIX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、JPIX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JPIXは責任を負いません。

○第16期の運用経過等（2021年12月8日～2022年12月7日）

<当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および東証株価指数(TOPIX)は、期首(2021年12月7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。

(注3) ベンチマークは、東証株価指数(TOPIX)です。

<基準価額の主な変動要因>

当ファンドは、親投資信託である「しんきんフコクSRIマザーファンド」の受益証券への投資を通じ、社会的責任を果たすことにより、持続的に成長する可能性が高いと考えられる国内の企業に投資しています。

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>

- ・多くの主要国で、新型コロナウイルスの感染防止策と経済社会活動の両立が進んだこと。
- ・国内企業の業績に回復が見られたこと。

<下落要因>

- ・ウクライナ情勢の緊迫化や、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、投資家にリスク回避姿勢が広がったこと。
- ・米国でインフレへの警戒感から早期金融引締め観測が高まったこと。

<投資環境>

(2021年12月)

当期の東証株価指数(TOPIX)は、1,989.85ポイント(2021年12月7日終値)の水準から始まりました。12月の株式市場は、新型コロナウイルスのオミクロン株をめぐる過度な警戒感が後退したことに加え、好調な企業業績を背景に、堅調に推移しました。

(2022年1月～3月)

1月の株式市場は、米国でインフレへの警戒感から早期金融引締め観測が高まったことや、国内での新型コロナウイルスの感染急拡大から、大きく値を下げる動きになりました。2月は、米国の株高や企業の好決算を受け堅調な場面も見られましたが、ウクライナ情勢の緊迫化などから3月にかけて値を下げる動きになり、3月9日には、TOPIXは期中安値となる1,758.89ポイントまで下落しました。その後、ロシアとウクライナの停戦への期待や、米連邦公開市場委員会(FOMC)でパウエル米連邦準備制度理事会(FRB)議長が経済成長に楽観的な姿勢を示し米国景気の先行き懸念が後退したこと、円安の進行などを背景に上昇しました。

(2022年4月～6月)

4月の株式市場は、米国で金融引締め観測が高まったことや、一部地域で都市閉鎖(ロックダウン)が続く中国の景気減速懸念などから下落しましたが、5月半ばから6月初旬にかけては、上海のロックダウン解除や国内での水際対策緩和への期待、好調な企業業績などから値を戻しました。その後、欧米の金融引締めが世界景気を冷やすとの見方から、大きく下落しました。

(2022年7月～9月)

7月の株式市場は、FOMC議事要旨が一段の金融引締めに積極的な内容でなかったことなどから、買いが優勢になりました。8月は、米利上げペースが緩やかになるとの観測や、FOMC議事要旨が警戒していたほど金融引締めに積極的でなかったことから、8月17日にはTOPIXは2,000ポイントを上回りました。9月は、8月の米消費者物価指数(CPI)の伸びが市場予想を上回ったことや、FOMCで0.75%の大幅利上げ継続を決めたことから、米金融引締めによる景気悪化への警戒が広がり、大きく下落しました。

(2022年10月～当期末)

10月の株式市場は、景気減速を示す米経済指標やオーストラリア中央銀行による小幅な利上げを受け、欧米の中央銀行の利上げペースが鈍化するとの期待から、9月の下げを縮小する動きになりました。11月は、10月の米CPIの伸びが市場予想を下回ったことを受けてインフレのピークアウトが意識され、FRBが利上げを緩めるとの観測などから堅調に推移しました。期末のTOPIXは1,948.31ポイント(2022年12月7日終値)となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

「しんきんフコクSRIマザーファンド」の受益証券への投資を行い、当期を通じて組入比率が高位となるように調整しました。

●しんきんフコクSRIマザーファンド

企業の社会的責任（CSR）面、財務面双方の評価などを考慮し、銘柄の入替え、ウェイトの調整を行いました。組入銘柄数は決算日時点で73銘柄であり、前期末比で8銘柄減少しました。

<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（分配金込み）は $\Delta 2.8\%$ となり、ベンチマークであるTOPIXの騰落率 $\Delta 2.1\%$ を0.7ポイント下回りました。

信託報酬等が主なマイナス要因となり、ファンドの騰落率はTOPIXを下回りました。

<分配金>

当期の収益分配金については、経費控除後の配当等収益や期末の基準価額の水準等を勘案して、1万口当たり350円（税込み）としました。

なお、収益分配に充てなかった部分については、信託財産中に留保し、運用の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16期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2021年12月8日～ 2022年12月7日 |
| 当期分配金 | 350 |
| （対基準価額比率） | 3.251% |
| 当期の収益 | 102 |
| 当期の収益以外 | 247 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,671 |

（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、運用の基本方針に従い、主として「しんきんフコクSRIマザーファンド」の受益証券に投資し、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。

●しんきんフコクSRIマザーファンド

CSR評価や財務評価の変更を総合的に考慮しながら、適宜入替えを行う方針です。また、CSRに関する調査を継続的に行い、環境面、社会・倫理面および財務面に優れた銘柄を組み入れていく方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年12月8日～2022年12月7日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|----------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 172 | % 1.628 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (81) | (0.770) | 委託した資金の運用の対価 |
| （ 販 売 会 社 ） | (81) | (0.770) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座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 ） | (9) | (0.088) | 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 | 6 | 0.056 | (b) 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 |
| （ 株 式 ） | (6) | (0.056) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 0 | 0.002 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 178 | 1.686 | |
| 期中の平均基準価額は、10,579円です。 | | | |

(注1) 期中の費用（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。

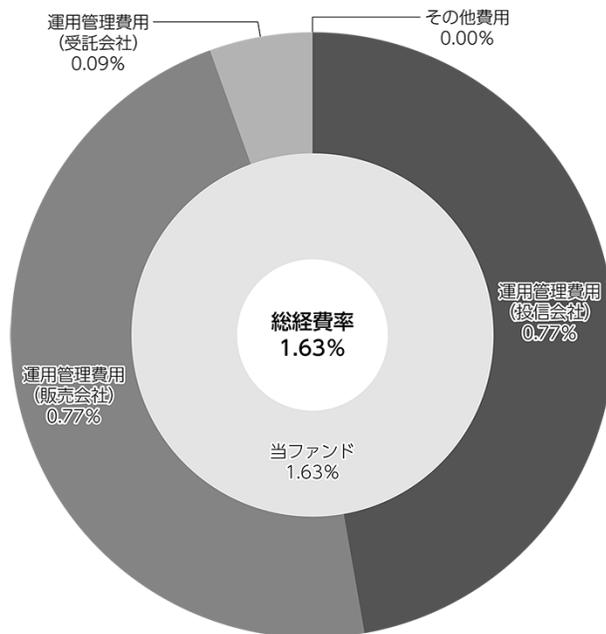
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・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1.63%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

(2021年12月8日～2022年12月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|---------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| しんきんフコクSR I マザーファンド | 千口 12,780 | 千円 35,000 | 千口 29,525 | 千円 82,400 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年12月8日～2022年12月7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 |
|---------------------|---------------------|
| | しんきんフコクSR I マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 3,501,446千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 7,646,990千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.45 |

(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

(2021年12月8日～2022年12月7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

(2021年12月8日～2022年12月7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

(2021年12月8日～2022年12月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年12月7日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| しんきんフコク S R I マザーファンド | 千口 511,870 | 千口 495,125 | 千円 1,392,738 |

(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

(2022年12月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| しんきんフコク S R I マザーファンド | 千円 1,392,738 | % 95.6 |
| コール・ローン等、その他 | 64,594 | 4.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,457,332 | 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 (2022年12月7日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,457,332,167 |
| コール・ローン等 | 12,593,553 |
| しんきんフコクSRIマザーファンド(評価額) | 1,392,738,614 |
| 未収入金 | 52,000,000 |
| (B) 負債 | 58,651,372 |
| 未払収益分配金 | 46,994,935 |
| 未払信託報酬 | 11,645,197 |
| 未払利息 | 37 |
| その他未払費用 | 11,203 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,398,680,795 |
| 元本 | 1,342,712,455 |
| 次期繰越損益金 | 55,968,340 |
| (D) 受益権総口数 | 1,342,712,455口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 10,417円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,319,906,627円、期中追加設定元本額は61,757,768円、期中一部解約元本額は38,951,940円です。

(注2) 当期末における1口当たり純資産額は1.0417円です。

○損益の状況 (2021年12月8日～2022年12月7日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 8,062 |
| 支払利息 | △ 8,062 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 16,128,529 |
| 売買益 | 1,349,440 |
| 売買損 | △ 17,477,969 |
| (C) 信託報酬等 | △ 23,103,106 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 39,239,697 |
| (E) 前期繰越損益金 | 180,687,938 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 38,484,966 |
| (配当等相当額) | (76,861,342) |
| (売買損益相当額) | (△115,346,308) |
| (G) 計(D+E+F) | 102,963,275 |
| (H) 収益分配金 | △ 46,994,935 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 55,968,340 |
| 追加信託差損益金 | △ 38,484,966 |
| (配当等相当額) | (76,977,351) |
| (売買損益相当額) | (△115,462,317) |
| 分配準備積立金 | 147,444,068 |
| 繰越損益金 | △ 52,990,762 |

(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(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(13,751,065円)、費用控除後の有価証券等損益額(0.0円)、信託約款に規定する収益調整金(76,977,351円)および分配準備積立金(180,687,938円)より分配対象収益は271,416,354円(10,000口当たり2,021円)であり、うち46,994,935円(10,000口当たり350円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

| | |
|------------------|------|
| 1 万口当たり分配金 (税込み) | 350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、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、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) 個人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)の税率が適用されます。

(注3) 法人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、15.315% (所得税15%および復興特別所得税0.315%)が源泉徴収されます。

(注4) 当ファンドは少額投資非課税制度「N I S A (ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアN I S A (ニーサ)」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

(注5) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2022年12月7日現在)

<しんきんフコクSRIマザーファンド>

下記は、しんきんフコクSRIマザーファンド全体(2,798,620千口)の内容です。

国内株式

| 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 |
| 建設業 (2.7%) | | | | |
| 大林組 | 75 | 76.5 | 77 | 494 |
| 大和ハウス工業 | 42.6 | 43.4 | 134 | 496 |
| 食料品 (4.9%) | | | | |
| 明治ホールディングス | 10.6 | — | — | — |
| 日本ハム | 16.2 | 16.6 | 61 | 005 |
| キリンホールディングス | 23.5 | — | — | — |
| 不二製油グループ本社 | 10.8 | 11.1 | 22 | 732 |
| 味の素 | — | 22.2 | 98 | 035 |
| ニチレイ | 27.8 | 28.4 | 80 | 428 |
| 日清食品ホールディングス | 7.4 | 11.3 | 117 | 746 |
| 繊維製品 (0.7%) | | | | |
| 東レ | 118.8 | 70.5 | 51 | 747 |
| パルプ・紙 (0.8%) | | | | |
| レンゴー | 67.7 | 69.1 | 59 | 495 |
| 化学 (9.4%) | | | | |
| 信越化学工業 | 12.4 | 12.6 | 214 | 704 |
| 三井化学 | 35.3 | 36.1 | 111 | 007 |
| KHネオケム | — | 9.4 | 26 | 179 |
| 積水化学工業 | 40.3 | 41.1 | 77 | 185 |
| 花王 | 13.5 | 4.3 | 23 | 564 |
| 富士フィルムホールディングス | 21 | 21.4 | 150 | 998 |
| 資生堂 | 8.7 | — | — | — |
| ファンケル | — | 39 | 98 | 709 |
| エフピコ | 7.9 | 8.1 | 29 | 362 |
| ニフコ | 8.5 | — | — | — |
| 医薬品 (5.8%) | | | | |
| 協和キリン | 21.3 | 38.1 | 117 | 157 |
| 中外製薬 | 18.5 | 18.9 | 68 | 985 |
| ロート製薬 | 10.6 | 10.9 | 47 | 415 |
| 小野薬品工業 | 13.8 | 17.6 | 59 | 734 |
| 第一三共 | 33.1 | 33.8 | 146 | 692 |
| ペプチドリーム | 6.6 | 6.8 | 10 | 580 |

| 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 |
| ガラス・土石製品 (2.7%) | | | | |
| AGC | 30.9 | 31.5 | 143 | 325 |
| 日本碍子 | 37.4 | 38.2 | 68 | 798 |
| 鉄鋼 (1.0%) | | | | |
| JFEホールディングス | 49.8 | 50.8 | 79 | 705 |
| 非鉄金属 (0.8%) | | | | |
| DOWAホールディングス | 17.4 | 14.2 | 63 | 190 |
| 住友電気工業 | 40.1 | — | — | — |
| 機械 (6.5%) | | | | |
| ディスコ | 3.1 | 3.2 | 127 | 520 |
| 小松製作所 | 42.2 | 43.1 | 132 | 920 |
| ダイキン工業 | 8.9 | 10.2 | 223 | 533 |
| ダイフク | 2.8 | — | — | — |
| 日本精工 | 32.4 | 33.1 | 24 | 196 |
| マキタ | 14.9 | — | — | — |
| 電気機器 (15.9%) | | | | |
| 日立製作所 | 38.4 | 39.1 | 278 | 157 |
| 日本電産 | 12.8 | 13.1 | 108 | 716 |
| オムロン | 4.8 | 9.4 | 65 | 847 |
| ソニーグループ | 30.1 | 30.7 | 333 | 862 |
| リオン | 5.9 | 9.7 | 19 | 021 |
| 横河電機 | 49.1 | 50.1 | 121 | 141 |
| カシオ計算機 | 16.7 | — | — | — |
| 芝浦電子 | — | 4.4 | 22 | 880 |
| ローム | 5.9 | 6 | 62 | 820 |
| 浜松トニクス | 25.3 | 25.8 | 180 | 084 |
| 小糸製作所 | 10.7 | 22 | 45 | 760 |
| 輸送用機器 (7.1%) | | | | |
| 豊田自動織機 | 19.3 | 19.7 | 147 | 553 |
| トヨタ自動車 | — | 177.1 | 345 | 256 |
| 本田技研工業 | 44.6 | — | — | — |
| シマノ | — | 2.8 | 63 | 560 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 精密機器 (3.3%) | | | |
| テルモ | 31.4 | 28.3 | 111,785 |
| 島津製作所 | 26 | 26.5 | 106,265 |
| タムロン | 20.6 | 13.3 | 44,089 |
| HOYA | 5.2 | — | — |
| その他製品 (5.6%) | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 8 | 10.5 | 92,946 |
| フジシールインターナショナル | 6.9 | 18.2 | 32,323 |
| ビジョン | 29.5 | 30.1 | 65,106 |
| 任天堂 | 4 | 42.4 | 245,156 |
| 電気・ガス業 (1.1%) | | | |
| 大阪瓦斯 | 40.5 | 41.4 | 87,147 |
| 陸運業 (2.2%) | | | |
| 東急 | 43.6 | — | — |
| 東日本旅客鉄道 | 8.3 | — | — |
| 西日本旅客鉄道 | — | 29.7 | 169,230 |
| 海運業 (0.9%) | | | |
| 商船三井 | 8 | 21.8 | 71,068 |
| 情報・通信業 (9.7%) | | | |
| ユーザベース | 23.6 | — | — |
| 野村総合研究所 | 40.5 | 42.2 | 137,783 |
| ラクスル | 7.3 | 7.4 | 21,770 |
| オービック | 7.2 | 8.6 | 176,386 |
| Zホールディングス | 108.5 | 110.7 | 40,283 |
| 日本電信電話 | 61.6 | 73.2 | 272,304 |
| ソフトバンク | 73 | — | — |
| ソフトバンクグループ | 22.4 | 17.8 | 106,212 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|---------------------|---------|-------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 卸売業 (5.3%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 63.8 | 57.9 | 243,122 | |
| 三菱商事 | 38.1 | 38.9 | 174,699 | |
| 小売業 (4.3%) | | | | |
| J. フロント リテイリング | — | 72.6 | 83,199 | |
| コスモス薬品 | 5.3 | 5.5 | 76,615 | |
| しまむら | — | 6.9 | 86,181 | |
| 丸井グループ | 72 | 38.6 | 87,969 | |
| 銀行業 (4.9%) | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | — | 343.5 | 259,617 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 28.1 | 28.7 | 121,372 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 43.4 | — | — | |
| 保険業 (2.5%) | | | | |
| SOMPOホールディングス | 13 | 13.3 | 75,278 | |
| 東京海上ホールディングス | 17 | 43.5 | 122,017 | |
| 不動産業 (1.3%) | | | | |
| パーク24 | 14 | — | — | |
| 三菱地所 | 38.9 | 39.7 | 73,266 | |
| イオンモール | 11.4 | 16.4 | 27,781 | |
| サービス業 (0.6%) | | | | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 27.6 | — | — | |
| 博報堂DYホールディングス | 47.9 | — | — | |
| セコム | 6.1 | 6.2 | 51,243 | |
| 計 | 株数・金額 | 2,198 | 2,515 | 7,805,525 |
| | 銘柄数<比率> | 81 | 73 | <99.2%> |

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 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。

運用報告書

親投資信託

しんきんフコク S R I マザーファンド

第18期

(決算日：2022年4月21日)

しんきんフコク S R I 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 |
| 主要投資対象 | 我が国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 運用方針 | <p>①投資にあたっては、我が国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、投資信託財産の成長を目指して運用を行います。</p> <p>② T O P I X（東証株価指数）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ます。</p> <p>③銘柄選定にあたっては、持続的に成長する可能性が高いと考えられる、財務面、環境面、社会・倫理面を強く意識する企業への投資を基本とします。</p> <p>④株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>⑤運用指図に関する権限は、富国生命投資顧問株式会社に委託します。</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> |
| 投資制限 | <p>①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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20%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 | | TOPIX※ | | 株組入比率 | 株先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|----------|-------|-------|-------|-------|
| | 騰落率 | 中率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | | |
| | 円 | % | ポイント | % | % | % | 百万円 |
| 14期(2018年4月23日) | 22,350 | 26.1 | 1,750.79 | 17.6 | 98.8 | — | 6,722 |
| 15期(2019年4月22日) | 21,549 | △3.6 | 1,618.62 | △7.5 | 98.4 | — | 6,407 |
| 16期(2020年4月21日) | 19,119 | △11.3 | 1,415.89 | △12.5 | 98.2 | — | 5,515 |
| 17期(2021年4月21日) | 26,984 | 41.1 | 1,888.18 | 33.4 | 98.5 | — | 7,661 |
| 18期(2022年4月21日) | 27,147 | 0.6 | 1,928.00 | 2.1 | 98.4 | — | 7,671 |

(注) 株先物比率＝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 | | TOPIX※ | | 株組入比率 | 株先物比率 |
|--------------------|--------|------|----------|------|-------|-------|
| | 騰落率 | 騰落率 | (ベンチマーク) | 騰落率 | | |
| (期首) 2021年4月21日 | 円 | % | ポイント | % | % | % |
| | 26,984 | — | 1,888.18 | — | 98.5 | — |
| 4月末 | 27,103 | 0.4 | 1,898.24 | 0.5 | 98.5 | — |
| 5月末 | 27,081 | 0.4 | 1,922.98 | 1.8 | 98.5 | — |
| 6月末 | 27,420 | 1.6 | 1,943.57 | 2.9 | 99.3 | — |
| 7月末 | 26,691 | △1.1 | 1,901.08 | 0.7 | 99.5 | — |
| 8月末 | 27,828 | 3.1 | 1,960.70 | 3.8 | 99.5 | — |
| 9月末 | 28,942 | 7.3 | 2,030.16 | 7.5 | 98.8 | — |
| 10月末 | 28,618 | 6.1 | 2,001.18 | 6.0 | 98.7 | — |
| 11月末 | 27,657 | 2.5 | 1,928.35 | 2.1 | 98.8 | — |
| 12月末 | 28,383 | 5.2 | 1,992.33 | 5.5 | 99.4 | — |
| 2022年1月末 | 26,847 | △0.5 | 1,895.93 | 0.4 | 99.4 | — |
| 2月末 | 26,513 | △1.7 | 1,886.93 | △0.1 | 99.5 | — |
| 3月末 | 27,550 | 2.1 | 1,946.40 | 3.1 | 98.3 | — |
| (期末) 2022年4月21日 | 27,147 | 0.6 | 1,928.00 | 2.1 | 98.4 | — |

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株先物比率＝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18期の運用経過等（2021年4月22日～2022年4月21日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、東証株価指数（TOPIX）をベンチマークとして、社会的責任を果たすことにより、持続的に成長する可能性が高いと考えられる国内の企業に投資をしています。

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＞

- ・各国で、新型コロナウイルス感染拡大による景気への影響軽減のため、経済対策がとられたこと。
- ・首相交代に伴い経済対策への期待感が広がったこと。
- ・企業の業績に回復が見られたこと。

＜下落要因＞

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、投資家にリスク回避姿勢が広がったこと。
- ・米国でインフレへの警戒感から早期金融引締め観測が高まったこと。
- ・ウクライナ情勢が緊迫化したこと。

＜投資環境＞

(2021年4月～6月)

当期のTOPIXは1,888.18ポイント（2021年4月21日終値）の水準から始まりました。

期初から5月の株式市場は新型コロナウイルスの感染拡大や、米国消費者物価指数（CPI）が市場予想を上回ったことを受け、インフレへの警戒感が一段と強まったことなどから、一時大きく値を下げましたが、月末にかけて値を戻しました。6月は、一進一退となりTOPIXは1,950ポイントを挟んだ動きとなりました。

(2021年7月～9月)

7月の株式市場は、世界的な新型コロナウイルスの変異株（デルタ株）の感染拡大が経済活動の正常化を遅らせるとの懸念や、東京都への緊急事態宣言の再発令決定などが重しとなり、下落しました。8月は、国内の新型コロナウイルスの新規感染者数が過去最多を更新したことを受けて、TOPIXは一時1,900ポイントを割り込みました。その後、米連邦下院が3.5兆ドルの財政支出を盛り込んだ予算決議案を可決したことや、9月に菅首相が自民党総裁選に出馬せず、辞任の意向を示したことから、首相交代に伴う経済対策への期待感が広がり、TOPIXは14日に2,100ポイントを回復しました。月末にかけては利益確定売りや中国不動産大手の経営不安により売りが優勢となりました。

(2021年10月～12月)

10月の株式市場は、米国長期金利の上昇に対する警戒感や中国の景気減速懸念、衆議院選挙をめぐる不透明感などから下落しました。11月は衆議院選挙の結果を受け政治不安が後退したことや新政権の経済対策への期待感、好調な企業業績が下支え材料となったものの、米国の早期金融引締めへの警戒が高まったことや欧米の新型コロナウイルスの感染拡大、新たな変異株（オミクロン株）への警戒から下落しました。12月はオミクロン株は重症化リスクが低いとの見方から過度な警戒感が後退し、上昇しました。

(2022年1月～4月)

1月の株式市場は、米国でインフレへの警戒感から早期金融引締め観測が高まったことや、国内での新型コロナウイルスの感染急拡大から、大きく値を下げる動きになりました。2月上旬は米国の株高や企業の好決算を受け、堅調な地合いが続いたものの、ウクライナ情勢の緊迫化などから下落しました。3月は米連邦公開市場委員会（FOMC）で、パウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長が経済成長に楽観的な姿勢を示し、米国景気の先行き懸念が後退したことや、円安の進行などを背景に期末にかけ値を戻し、期末のTOPIXは1,928.00ポイント（2022年4月21日終値）で終了しました。

<当ファンドのポートフォリオ>

企業の社会的責任（CSR）面、財務面双方の評価などを考慮し、銘柄の入替え、ウェイトの調整を行いました。組入銘柄数は、決算日時点で79銘柄であり、前期末比変わらずとなっています。

なお、決算日時点でアクティブウェイト（AW）上位5銘柄のCSR面に関する評価を簡潔にまとめましたので、ご参照ください。

| 銘柄名 | コメント |
|--------|---|
| 丸井グループ | ステークホルダーのしあわせと利益を共に実現するための指標として、「将来世代の未来を共に創る」「一人ひとりの『しあわせ』を共に創る」「共創のプラットフォームを創る」の3つのテーマに絞った「インパクト」を定義し、重点項目については中期経営計画の主要KPIとして設定することで、目指す姿である「ミッション」や「ビジョン2050」の実現に努めています。 |
| 任天堂 | 独創的な商品・サービスを通じて、「関わるすべての人を笑顔にする」ことをCSRと位置づけ、特に、「お客様」「サプライチェーン」「社員」を笑顔にすることを重点項目として活動を推進しています。また、次世代により良い環境を残すため、開発・設計から販売後の修理・サポート、リサイクル対応に至るまで製品に関する様々な側面において、環境負荷低減にも取り組んでいます。 |
| 日立製作所 | サステナビリティを事業戦略の中核に組み入れたサステナブル経営を実践しています。「2021中期経営計画」では、社会イノベーション事業のグローバルリーダーとして持続可能な世界を実現することを目標に掲げ、その実現に向け「環境」「レジリエンス」「安心・安全」を成長領域と位置づけ、社会と企業経営の課題解決への貢献と人々のQoLおよび顧客企業の価値向上に努めています。 |
| 伊藤忠商事 | 創業の精神であり企業理念でもある「三方よし」を核として本業を通じて全てのステークホルダーに貢献する「三方よし資本主義」を標榜しています。2021年度にスタートした中期経営計画の基本方針の1つに「SDGsへの貢献・取組強化」掲げ、脱炭素社会を見据えた事業拡大を通じ競争力強化を図っています。 |

| 銘柄名 | コメント |
|---------|---|
| ソニーグループ | 「クリエイティビティとテクノロジーの力で、世界を感動で満たす」というPurpose（存在意義）と「人に近づく」という経営の方向性のもと、多様な事業ポートフォリオを支える共通の軸である「テクノロジー」と「人材」を長期的な価値創造を支える最重要マテリアリティと位置づけるとともに、事業や技術を通じて付加価値をもたらすことで人、社会、地球への「貢献」にも努めています。 |

<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0.6%となり、同期間のTOPIXの騰落率である2.1%を1.5%下回りました。市場で堅調であった海運業などの組入比率が高かったことが、プラス効果となりましたが、軟調だった化学の組入比率が高かったことや、堅調だった輸送用機器や鉱業などの組入比率が低かったことなどのマイナス効果が上回り、ファンドの騰落率はTOPIXを下回りました。

<今後の運用方針>

CSR評価や財務評価の変更を総合的に考慮しながら、適宜入替えを行う方針です。また、保有銘柄について、不祥事等が発生した場合は、調査・再評価のうえ、売却も検討します。

○1万口当たりの費用明細

(2021年4月22日～2022年4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 11 (11) | % 0.038 (0.038) | (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 | 11 | 0.038 | |
| 期中の平均基準価額は、27,552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

(2021年4月22日～2022年4月21日)

株式

| 国 | 上場 | 買 付 | | 売 付 | |
|---|----|-------------------|------------------------|-----------|-----------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 内 | | 千株 415 (16) | 千円 1,236,780 () | 千株 345 | 千円 1,103,533 |

(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

(2021年4月22日～2022年4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 | 2,340,314千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 7,759,292千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.30 |

(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

(2021年4月22日～2022年4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

(2022年4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 |
| 建設業 (2.7%) | | | |
| 大林組 | 74.2 | 75.6 | 69,098 |
| 大和ハウス工業 | 42.1 | 42.9 | 134,791 |
| 食料品 (4.8%) | | | |
| 明治ホールディングス | 10.6 | 10.8 | 69,012 |
| 日本ハム | 16.1 | 16.4 | 67,568 |
| キリンホールディングス | 23.3 | 23.8 | 43,030 |
| 不二製油グループ本社 | 10.8 | 11 | 20,031 |
| ニチレイ | 27.6 | 28.1 | 64,433 |
| 日清食品ホールディングス | — | 11.2 | 99,232 |
| 繊維製品 (1.0%) | | | |
| 東レ | 117.6 | 119.7 | 75,339 |
| パルプ・紙 (0.7%) | | | |
| レンゴー | 67 | 68.2 | 52,991 |
| 化学 (9.6%) | | | |
| 信越化学工業 | 12.3 | 12.5 | 224,062 |
| 三井化学 | 35 | 35.6 | 106,123 |
| KHネオケム | — | 6.3 | 15,857 |
| 積水化学工業 | 39.9 | 40.6 | 69,101 |
| 花王 | 13.4 | 13.6 | 71,196 |
| 富士フィルムホールディングス | 22.9 | 21.2 | 158,872 |
| 資生堂 | 8.7 | 8.8 | 54,736 |
| エフピコ | 4.3 | 8 | 23,032 |
| ニフコ | 19 | — | — |
| 医薬品 (4.6%) | | | |
| 協和キリン | 23.9 | 21.5 | 59,103 |
| 中外製薬 | — | 18.7 | 78,502 |
| ロート製薬 | 10.6 | 10.8 | 36,612 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 小野薬品工業 | 13.7 | 19.5 | 63,258 |
| 第一三共 | 32.8 | 33.4 | 98,530 |
| パプチドリーム | 6.6 | 6.7 | 13,393 |
| ガラス・土石製品 (2.9%) | | | |
| AGC | 34.7 | 31.1 | 155,033 |
| 日本碍子 | 37.1 | 37.8 | 65,847 |
| 鉄鋼 (1.1%) | | | |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 55.3 | 50.2 | 83,382 |
| 非鉄金属 (1.9%) | | | |
| DOWAホールディングス | 17.3 | 14.1 | 85,023 |
| 住友電気工業 | 39.7 | 40.4 | 58,196 |
| 機械 (5.9%) | | | |
| ディスコ | 3.1 | 3.1 | 97,030 |
| 小松製作所 | 53.4 | 42.5 | 129,157 |
| ダイキン工業 | 8.9 | 8.4 | 174,804 |
| ダイフク | 2.8 | 2.9 | 24,273 |
| 日本精工 | 32.1 | 32.7 | 23,969 |
| マキタ | 16.8 | — | — |
| 電気機器 (14.9%) | | | |
| 日立製作所 | 45.7 | 38.7 | 234,831 |
| 日本電産 | 12.8 | 13 | 116,610 |
| オムロン | 4.8 | 4.9 | 38,151 |
| ソニーグループ | 31.7 | 30.4 | 352,640 |
| リオン | 5.9 | 6 | 13,884 |
| 横河電機 | 48.7 | 49.5 | 107,415 |
| カシオ計算機 | 68.9 | — | — |
| ローム | 5.9 | 6 | 55,380 |
| 浜松ホトニクス | 26.8 | 25.5 | 149,940 |

しんきんフコクSRIマザーファンド－第18期－

| 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 |
| 小糸製作所 | 10.7 | 10.9 | 52,647 | |
| 輸送用機器 (5.8%) | | | | |
| 豊田自動織機 | 19.2 | 19.5 | 156,195 | |
| トヨタ自動車 | — | 125.1 | 281,475 | |
| 日野自動車 | 31.1 | — | — | |
| 本田技研工業 | 47.8 | — | — | |
| 精密機器 (4.5%) | | | | |
| テルモ | 31.1 | 28 | 112,784 | |
| 島津製作所 | 25.8 | 26.2 | 109,516 | |
| タムロン | 20.4 | 20.8 | 48,110 | |
| HOYA | — | 5.2 | 68,380 | |
| その他製品 (5.6%) | | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 8 | 8.1 | 73,143 | |
| フジシールインターナショナル | — | 13.7 | 23,385 | |
| ビジョン | 11 | 29.7 | 62,459 | |
| 任天堂 | 4 | 4.1 | 262,933 | |
| 電気・ガス業 (1.2%) | | | | |
| 大阪瓦斯 | 40.1 | 40.9 | 86,994 | |
| 陸運業 (2.7%) | | | | |
| 東急 | 43.1 | 43.9 | 70,635 | |
| 東日本旅客鉄道 | 8.2 | 8.4 | 58,758 | |
| 西日本旅客鉄道 | — | 15.5 | 77,469 | |
| 日立物流 | 23.9 | — | — | |
| 海運業 (1.1%) | | | | |
| 商船三井 | 8 | 24.3 | 79,461 | |
| 情報・通信業 (10.9%) | | | | |
| ユーザベース | 12.1 | 29.4 | 26,724 | |
| 野村総合研究所 | — | 31.9 | 130,471 | |
| ラクスル | 7.2 | 7.4 | 20,697 | |
| オービック | 7.1 | 6.4 | 116,480 | |
| Zホールディングス | 107.3 | 109.3 | 56,967 | |

| 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 |
| 日本電信電話 | 60.9 | 62.1 | 234,489 | |
| ソフトバンク | 72.3 | 73.6 | 109,774 | |
| ソフトバンクグループ | 22.2 | 22.6 | 126,085 | |
| 卸売業 (5.3%) | | | | |
| 伊藤忠商事 | 63.1 | 57 | 228,171 | |
| 三菱商事 | 37.7 | 38.4 | 172,608 | |
| 小売業 (3.1%) | | | | |
| コスモス薬品 | 5.3 | 5.4 | 66,366 | |
| 丸井グループ | 56.8 | 72.6 | 164,729 | |
| 銀行業 (4.4%) | | | | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | — | 52.9 | 40,971 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 27.9 | 28.4 | 114,537 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 43 | 43.7 | 174,887 | |
| 保険業 (2.4%) | | | | |
| SOMPOホールディングス | 12.9 | 13.2 | 68,362 | |
| 東京海上ホールディングス | 16.9 | 17.2 | 116,340 | |
| 不動産業 (1.2%) | | | | |
| パーク24 | 13.9 | — | — | |
| 三菱地所 | 38.5 | 39.2 | 73,558 | |
| イオンモール | 11.3 | 11.5 | 18,239 | |
| サービス業 (1.7%) | | | | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 27.3 | — | — | |
| 博報堂DYホールディングス | 47.4 | 48.3 | 75,154 | |
| オリエンタルランド | 2.7 | — | — | |
| セコム | 6.1 | 6.2 | 55,471 | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 2,217 | 2,303 | 7,548,909 |
| | 銘柄数<比率> | 79 | 79 | <98.4%> |

(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) ー印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2022年4月21日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 7,548,909 | 98.4 |
| コール・ローン等、その他 | 122,136 | 1.6 |
| 投資信託財産総額 | 7,671,045 | 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 (2022年4月21日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 7,671,045,555 |
| コール・ローン等 | 31,229,475 |
| 株式(評価額) | 7,548,909,590 |
| 未収配当金 | 90,906,490 |
| (B) 負債 | 625 |
| 未払利息 | 87 |
| その他未払費用 | 538 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 7,671,044,930 |
| 元本 | 2,825,728,259 |
| 次期繰越損益金 | 4,845,316,671 |
| (D) 受益権総口数 | 2,825,728,259口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 27,147円 |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は2,839,313,303円、期中追加設定元本額は69,690,798円、期中一部解約元本額は83,275,842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は、フコクSRI(社会的責任投資)ファンド2,307,355,490円、しんきんSRIファンド518,372,769円です。

(注3) 1口当たり純資産額は2.7147円です。

○損益の状況 (2021年4月22日~2022年4月21日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 188,306,973 |
| 受取配当金 | 188,337,390 |
| その他収益金 | 1,855 |
| 支払利息 | △ 32,272 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 134,325,518 |
| 売買益 | 567,802,367 |
| 売買損 | △ 702,127,885 |
| (C) 保管費用等 | △ 5,191 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 53,976,264 |
| (E) 前期繰越損益金 | 4,822,255,363 |
| (F) 追加信託差損益金 | 120,309,202 |
| (G) 解約差損益金 | △ 151,224,158 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 4,845,316,671 |
| 次期繰越損益金(H) | 4,845,316,671 |

(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。