

○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	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。 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。 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。 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。 4)株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。 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。 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。 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。
主投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。
収益分配方針	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。 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。

運用報告書(全体版)

しんきんSRIファンド

決算日

(第17期：2023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2023年12月7日に第17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17期の運用経過等	2
1万口当たりの費用明細	7
売買及び取引の状況	9
株式売買比率	9
利害関係人との取引状況等	9
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	9
自社による当ファンドの設定・解約状況	9
組入資産の明細	10
投資信託財産の構成	10
資産、負債、元本及び基準価額の状況	11
損益の状況	11
分配金のお知らせ	12
◇参考情報	
親投資信託の組入資産の明細	13
◇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	15

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)	騰落率		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	期末騰落	騰落率	騰落率			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
17期(2023年12月7日)	11,367	1,350	22.1	2,359.91	21.1	99.2	—	1,440

(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	騰落率		T O P I X (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	
2022年12月7日	10,417	—	1,948.31	—	98.7	—	
12月末	10,098	△ 3.1	1,891.71	△ 2.9	99.0	—	
2023年1月末	10,459	0.4	1,975.27	1.4	99.4	—	
2月末	10,461	0.4	1,993.28	2.3	99.5	—	
3月末	10,635	2.1	2,003.50	2.8	98.3	—	
4月末	10,914	4.8	2,057.48	5.6	98.4	—	
5月末	11,340	8.9	2,130.63	9.4	98.6	—	
6月末	12,262	17.7	2,288.60	17.5	99.4	—	
7月末	12,536	20.3	2,322.56	19.2	99.5	—	
8月末	12,664	21.6	2,332.00	19.7	99.6	—	
9月末	12,592	20.9	2,323.39	19.3	99.0	—	
10月末	12,166	16.8	2,253.72	15.7	98.6	—	
11月末	12,835	23.2	2,374.93	21.9	99.1	—	
(期末)							
2023年12月7日	12,717	22.1	2,359.91	21.1	99.2	—	

(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。

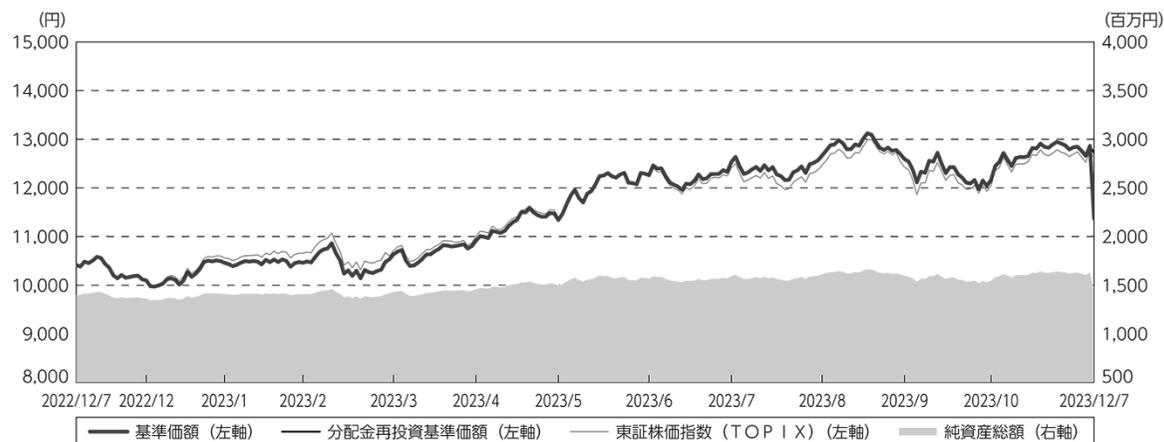
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※東証株価指数（T O P I X）の指数値及び東証株価指数（T O P I X）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（T O P I X）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（T O P I X）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（T O P I X）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17期の運用経過等（2022年12月8日～2023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(2022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>

- ・国内企業の業績に回復が見られたこと。
- ・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。
- ・日銀が大規模な金融緩和策の維持を決めたこと。

<下落要因>

- ・米国の金融引締めによる景気悪化への警戒が広がったこと。
- ・海外金融機関の信用不安が広まったこと。
- ・中国経済の先行きに対する不安感が広がったこと。

＜投資環境＞

(2022年12月)

当期の東証株価指数(TOPIX)は、1,948.31ポイント(2022年12月7日終値)の水準から始まりました。12月の株式市場は米連邦公開市場委員会(FOMC)で金融引締めに積極的なタカ派的姿勢が維持され米国の景気悪化懸念が広がったことや、日銀が金融政策決定会合で許容する長期金利の上限を引き上げたことを受け、軟調に推移しました。

(2023年1月～3月)

1月の株式市場は、前月の軟調な地合いを引き継ぎ、TOPIXは1月4日に期中安値となる1,868.15ポイントまで下落しましたが、日銀が大規模な金融緩和策の維持を決めたことを受け、買いが優勢になりました。2月は、FRBが2会合連続で利上げ幅を縮小したことなどを好感し、買いが広がりました。その後も日銀が早期に政策修正に動くとの思わくが後退し、3月上旬にかけて堅調に推移しましたが、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から月半ばにかけて大きく下落しました。その後は金融当局による迅速な支援などを受け、金融システムへの過度な不安が和らいだことなどから月末にかけて堅調に推移しました。

(2023年4月～6月)

4月の株式市場は、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、米著名投資家のバ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企業の積極的な自社株買い方針、円安の進行などから堅調に推移しました。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。

(2023年7月～9月)

7月の株式市場は、高値警戒感や米国の金融引締めによる景気悪化への警戒が広がったことから、売りに押される場面もありましたが、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などが好感され、下旬にかけて堅調に推移しました。8月は、国内企業の好調な決算から買いが優勢となる場面も見られたものの、米国の格付会社が米国国債や米国の中堅・中小銀行を格下げしたこと、中国経済の先行きに対する不安感などから、一進一退となりました。9月は、9月19日に期中高値となる2,430.30ポイントまで上昇したものの、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、下旬にかけては軟調になりました。

(2023年10月～当期末)

10月の株式市場は、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、日銀の金融政策修正などによる国内金利上昇が投資家心理を圧迫したことなどから、下落しました。11月から期末にかけては、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、期末のTOPIXは2,359.91ポイント(2023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＞

親投資信託である「しんきんフコク S R I 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 S R I マザーファンド

企業の社会的責任（C S R）面、財務面双方の評価などを考慮し、銘柄の入替え、ウエイトの調整を行いました。組入銘柄数は、決算日時点で66銘柄となりました。なお、運用の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ています。

組入銘柄の選定は、個別企業に対する直接取材を通じて「環境」、「社会・倫理」、「ガバナンス」に関するそれぞれの対応を得点化し、総合で4段階（A、B、C、D）に評価します。

評価視点	
環境	環境マネジメント体制、環境パフォーマンスの向上、環境・社会に配慮した事業活動
社会・倫理	品質管理の徹底、顧客満足度の向上、情報管理の徹底、サプライヤーとの共存共栄、人材確保・定着、ダイバーシティ、労働環境の向上、社内コミュニケーション
ガバナンス	マテリアリティ（重要課題）の設定・取組み、ステークホルダーコミュニケーション、企業理念・行動規範の徹底、コーポレートガバナンス体制、コンプライアンスの徹底

S R I 総合評価別投資比率および組入上位10銘柄（決算日時点）は、以下のとおりです。

S R I 総合評価別投資比率

S R I 総合評価	比率
A	81.9%
B	17.4%
C	0.0%
D	0.0%

※上記比率は純資産総額に対する比率です。
 ※富国生命投資顧問株式会社のデータをもとにしんきんアセットマネジメント投信が作成しています。

＜S R I 評価の定義について＞

富国生命投資顧問株式会社では S R I 面の評価を行う目的で、アナリスト、ファンドマネージャーが企業の S R I に関する取組みについて情報を収集しています。個別企業に対する直接取材を通じて「環境」「社会・倫理」「ガバナンス」に関するそれぞれ企業の取組み度合でスコア（0～3点）を算出し、総合で4段階（A、B、C、D）に評価します。評価基準は以下の通りです。「A」「B」は投資適格、「C」「D」は投資不適格と判断します。

S R I 総合評価	点数
A	2.3点以上～3点
B	1.8点以上～2.3点未満
C	0点～1.8点未満
D	取材拒否により算出不能

組入上位10銘柄

	銘柄名	投資比率	S R I の着眼点
1	ソニーグループ	4.9%	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ことを目指し、過去の実績に固執しない自由闊達なアイデアを受け入れる社風、ガバナンスの透明性などを評価。
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	4.2%	「世界が進むチカラになる」というパーパスを体現するため、「挑戦と変革」を支える人材育成に注力し、経営者が社内風土の改革を徹底している点を評価。
3	信越化学工業	3.3%	「優先順位を決め、余計な事をせず、価値を生み出すことに集中」する社風が根付いており、従業員のモチベーションが高い点や、汎用化学品（塩ビ）のリサイクルなど資源循環にも注力している点を評価。
4	伊藤忠商事	3.2%	「三方よし」という理念のもとサステナビリティを重視した経営を推進。先駆的な取組みによる持続的な成長を期待。
5	日立製作所	3.0%	組織・地域・世代を超えた連携力や多様な人材が活躍できるインクルーシブな組織づくりなどにより、社会課題の解決を目指している点や透明性の高いガバナンス体制を評価。
6	三井不動産	2.7%	街づくりを通して社会課題を解決することにより、「持続可能な社会」と「継続的な利益成長」の実現を目指している点を評価。
7	日本電信電話	2.5%	設立時からの使命である公共性と企業性を両立させ、パートナーとの協業、社員の満足度を高める取組みなどにより通信インフラを構築。通信の低電力化を積極的に推進している点などを評価。
8	村田製作所	2.4%	ロードマップに基づく潜在的顧客ニーズに沿った商品開発などソリューションを提供する力や、社系にある徹底した信用の蓄積を実行している点、社員を成長させる文化が浸透している点などを評価。
9	大和ハウス工業	2.4%	パーパス「将来の夢」の実現を目指し、地域社会の再生やサーキュラーエコノミー&カーボンニュートラルなど、6つのマテリアリティを掲げ、統合思考に基づいた取組みが展開されていることを評価。
10	東京エレクトロン	2.3%	早くからグローバルカンパニーを目指しガバナンス体制を整備しているほか、顧客との個別ミーティングによる不満の洗い出しなど徹底した顧客主義をとっている点などを評価。

※上記比率は純資産総額に対する比率です。

※富国生命投資顧問株式会社のデータをもとにしんきんアセットマネジメント投信が作成しています。

富国生命投資顧問株式会社「スチュワードシップ活動の概況（抜粋）」

「当社は、投資先企業やその事業環境等に関する深い理解のほか、サステナビリティの考慮に基づく建設的なエンゲージメント等を通じて、当該企業の企業価値の向上やその持続的成長を促すことにより、お客さまから委託された資金の中長期的な投資リターン拡大を図ることが、スチュワードシップ責任であると考えています。

投資先企業の財務面の情報だけでなく、ESG要素等の非財務情報も勘案して、投資先企業とエンゲージメントを行うこと、また議決権を行使することにより、スチュワードシップ責任を果たしています。」

（概況およびスチュワードシップレポートは同社のホームページでご確認いただけます。）

○スチュワードシップ活動の概況

<https://www.fukoku-cm.co.jp/company-profile/stewardship-overview.html>

○スチュワードシップレポート

<https://www.fukoku-cm.co.jp/company-profile/stewardship-report.html>

＜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+22.1%となり、ベンチマークであるTOP I Xの騰落率+21.1%を1.0ポイント上回りました。

マザーファンドにおいて、市場で軟調であった医薬品やサービス業などの業種の組入比率が低かったこと、市場で堅調であった海運業や銀行業などの業種の組入比率が高かったことなどがプラス要因となり、ファンドの騰落率はTOP I Xを上回りました。

＜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1,350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17期
	2022年12月8日～ 2023年12月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	1,350 10.616%
当期の収益	1,350
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,212

(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、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。なお、運用の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。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年12月8日～2023年12月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 189	% 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 ）	(89)	(0.770)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(89)	(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 ）	(10)	(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	9	0.082	(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 ）	(9)	(0.082)	
(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)	(0.001)	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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	198	1.712	
期中の平均基準価額は、11,580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。

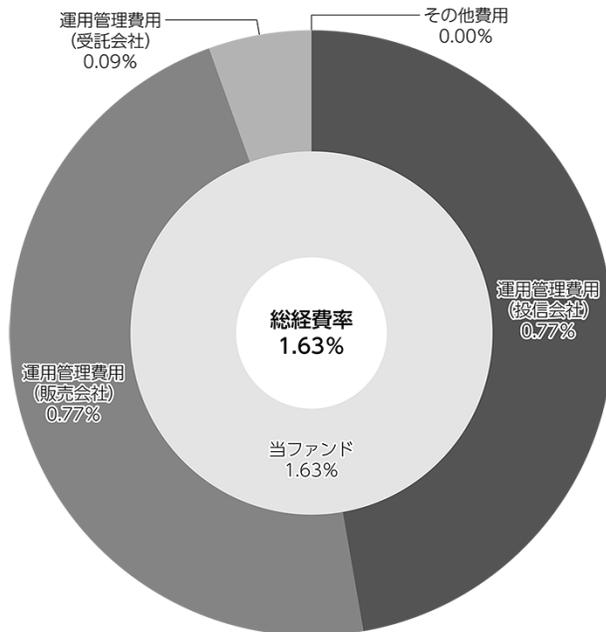
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年12月8日～2023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 2,825	千円 8,000	千口 86,257	千円 290,000

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年12月8日～2023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	5,723,766千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,660,597千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.66

(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

(2022年12月8日～2023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

(2022年12月8日～2023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

(2022年12月8日～2023年12月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023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 495,125	千口 411,693	千円 1,437,922

(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

(2023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 1,437,922	% 88.5
コール・ローン等、その他	186,747	11.5
投資信託財産総額	1,624,669	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 (2023年12月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,624,669,887
コール・ローン等	11,747,120
しんきんフコクSRIマザーファンド(評価額)	1,437,922,767
未収入金	175,000,000
(B) 負債	184,333,978
未払収益分配金	171,059,749
未払解約金	307,618
未払信託報酬	12,954,673
未払利息	34
その他未払費用	11,904
(C) 純資産総額(A-B)	1,440,335,909
元本	1,267,109,254
次期繰越損益金	173,226,655
(D) 受益権総口数	1,267,109,254口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,367円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,342,712,455円、期中追加設定元本額は37,445,476円、期中一部解約元本額は113,048,677円です。

(注2) 当期末における1口当たり純資産額は1,1367円です。

○損益の状況 (2022年12月8日～2023年12月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,515
支払利息	△ 3,515
(B) 有価証券売買損益	312,667,932
売買益	327,228,556
売買損	△ 14,560,624
(C) 信託報酬等	△ 24,531,446
(D) 当期損益金(A+B+C)	288,132,971
(E) 前期繰越損益金	86,628,742
(F) 追加信託差損益金	△ 30,475,309
(配当等相当額)	(76,555,221)
(売買損益相当額)	(△107,030,530)
(G) 計(D+E+F)	344,286,404
(H) 収益分配金	△171,059,749
次期繰越損益金(G+H)	173,226,655
追加信託差損益金	△ 30,475,309
(配当等相当額)	(76,627,831)
(売買損益相当額)	(△107,103,140)
分配準備積立金	203,701,964

(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(31,709,891円)、費用控除後の有価証券等損益額(207,822,099円)、信託約款に規定する収益調整金(76,627,831円)および分配準備積立金(135,229,723円)より分配対象収益は451,389,544円(10,000口当たり3,562円)であり、うち171,059,749円(10,000口当たり1,350円)を分配金額としています。

(注5) 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、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45以内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。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金（税込み）	1,350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) 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。

<約款変更のお知らせ>

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2日実施)

＜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(2,688,378千口)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
水産・農林業 (0.2%)				
サカタのタネ	—	5.3	—	20,908
建設業 (2.4%)				
大林組	76.5	—	—	—
大和ハウス工業	43.4	50.4	—	221,760
食料品 (4.9%)				
日本ハム	16.6	22.6	—	101,722
不二製油グループ本社	11.1	—	—	—
味の素	22.2	21.8	—	120,728
ニチレイ	28.4	27.9	—	92,042
日清食品ホールディングス	11.3	9.2	—	139,518
繊維製品 (1.0%)				
東レ	70.5	121.5	—	89,618
パルプ・紙 (0.7%)				
レンゴー	69.1	67.7	—	62,893
化学 (10.3%)				
レゾナック・ホールディングス	—	75.8	—	213,149
信越化学工業	12.6	61	—	306,586
三井化学	36.1	—	—	—
KHネオケム	9.4	26.9	—	62,085
積水化学工業	41.1	—	—	—
花王	4.3	—	—	—
富士フイルムホールディングス	21.4	21	—	180,894
ファンケル	39	39.5	—	89,704
エフピコ	8.1	9.6	—	27,052
ユニ・チャーム	—	16.5	—	80,470
医薬品 (3.0%)				
協和キリン	38.1	37.5	—	90,412
中外製薬	18.9	18.5	—	100,658
ロート製薬	10.9	9.9	—	30,393
小野薬品工業	17.6	17.2	—	44,651
第一三共	33.8	—	—	—
ベプチドリーム	6.8	13.9	—	16,930

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 (1.8%)				
AGC	31.5	30.9	—	164,017
日本碍子	38.2	—	—	—
鉄鋼 (1.1%)				
JFEホールディングス	50.8	49.8	—	105,327
非鉄金属 (0.6%)				
DOWAホールディングス	14.2	10.6	—	55,098
機械 (6.5%)				
ディスコ	3.2	2.9	—	86,420
小松製作所	43.1	49.8	—	183,463
ダイキン工業	10.2	10	—	210,000
日本精工	33.1	162.7	—	124,677
電気機器 (18.1%)				
コニカミノルタ	—	182.2	—	82,901
日立製作所	39.1	27.8	—	281,058
ニデック	13.1	22.6	—	122,718
オムロン	9.4	—	—	—
ソニーグループ	30.7	35.4	—	457,191
リオン	9.7	9.6	—	20,217
横河電機	50.1	—	—	—
芝浦電子	4.4	9.8	—	55,272
ローム	6	31.4	—	84,042
浜松トトニクス	25.8	25.3	—	140,212
村田製作所	—	79.5	—	226,575
小糸製作所	22	—	—	—
東京エレクトロン	—	9.6	—	215,376
輸送用機器 (3.6%)				
豊田自動織機	19.7	—	—	—
川崎重工業	—	28.3	—	88,097
トヨタ自動車	177.1	68.5	—	191,423
シマノ	2.8	2.7	—	61,060
精密機器 (1.1%)				
テルモ	28.3	—	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
島津製作所	26.5	26	100,594
タムロン	13.3	—	—
その他製品 (4.8%)			
バンダイナムコホールディングス	10.5	31	87,249
フジシールインターナショナル	18.2	34.6	59,027
ヤマハ	—	26.8	87,662
ビジョン	30.1	—	—
任天堂	42.4	30.7	210,663
電気・ガス業 (1.2%)			
大阪瓦斯	41.4	40.6	116,765
陸運業 (1.8%)			
西日本旅客鉄道	29.7	29.1	172,039
海運業 (1.4%)			
商船三井	21.8	33.5	135,440
情報・通信業 (10.3%)			
野村総合研究所	42.2	48.9	202,837
ラクスル	7.4	—	—
オービック	8.6	8.4	200,466
L I N E ヤプー	110.7	314.6	136,473
日本電信電話	73.2	1,365.3	235,650
ソフトバンクグループ	17.8	31.8	181,005
卸売業 (5.5%)			
伊藤忠商事	57.9	52	302,068
三菱商事	38.9	30.9	210,738
小売業 (4.5%)			
J. フロント リテイリング	72.6	71.4	95,033

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
コスモス薬品	5.5	—	—	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	—	41.6	138,486	
しまむら	6.9	—	—	
丸井グループ	38.6	37.8	88,735	
ファーストリテイリング	—	2.8	101,360	
銀行業 (7.6%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	343.5	315.9	396,138	
三井住友トラスト・ホールディングス	28.7	35.9	198,706	
千葉銀行	—	98	110,348	
保険業 (1.7%)				
SOMPOホールディングス	13.3	—	—	
東京海上ホールディングス	43.5	42.8	161,912	
不動産業 (2.7%)				
三井不動産	—	70.1	250,677	
三菱地所	39.7	—	—	
イオンモール	16.4	—	—	
サービス業 (3.2%)				
サイバーエージェント	—	118.5	97,407	
リクルートホールディングス	—	38.2	202,842	
セコム	6.2	—	—	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,515	4,500	9,327,656
	銘柄数 < 比率 >	73	66	< 99.3% >

- (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) ー印は組み入れなし。

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19期

(決算日：2023年4月21日)

しんきんフコク S R I 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
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	騰落率	(ベンチマーク)	(ベンチマーク)			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
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
19期(2023年4月21日)	29,360	8.2	2,035.06	5.6	98.4	—	8,186

(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)	(ベンチマーク)		
(期首) 2022年4月21日	円	%	ポイント	%	%	%
	27,147	—	1,928.00	—	98.4	—
4月末	26,845	△1.1	1,899.62	△1.5	98.4	—
5月末	27,066	△0.3	1,912.67	△0.8	98.4	—
6月末	26,828	△1.2	1,870.82	△3.0	99.1	—
7月末	27,871	2.7	1,940.31	0.6	99.5	—
8月末	28,079	3.4	1,963.16	1.8	99.5	—
9月末	26,544	△2.2	1,835.94	△4.8	98.5	—
10月末	27,878	2.7	1,929.43	0.1	98.5	—
11月末	28,705	5.7	1,985.57	3.0	98.5	—
12月末	27,294	0.5	1,891.71	△1.9	99.5	—
2023年1月末	28,314	4.3	1,975.27	2.5	99.6	—
2月末	28,356	4.5	1,993.28	3.4	99.5	—
3月末	28,868	6.3	2,003.50	3.9	98.3	—
(期末) 2023年4月21日	29,360	8.2	2,035.06	5.6	98.4	—

(注1) 騰落率は期首比です。

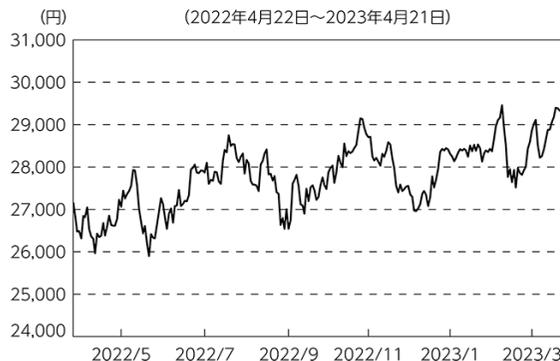
(注2) 株先物比率=買建比率-売建比率。

※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。

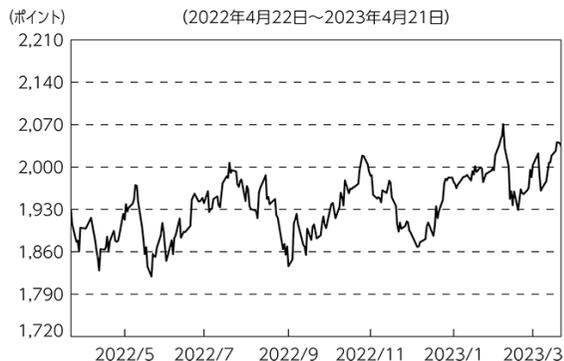
○第19期の運用経過等（2022年4月22日～2023年4月21日）

＜当期中の基準価額等の推移＞

【基準価額の推移】



【東証株価指数（TOPIX）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。
- ・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。

＜下落要因＞

- ・米国の金融引締めによる景気悪化への警戒が広がったこと。
- ・日銀が許容する長期金利の上限を引き上げたこと。
- ・海外金融機関の信用不安が広まったこと。

＜投資環境＞

(2022年4月～6月)

当期のTOPIXは1,928.00ポイント（2022年4月21日終値）の水準から始まりました。期初から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、一部地域で都市封鎖（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国内外の株式市場が下落する中、6月20日にはTOPIXは期中安値となる1,818.94ポイントまで下落しました。

(2022年7月～9月)

7月の株式市場は、米連邦公開市場委員会（FOMC）の議事要旨が一段の金融引締めには積極的な内容では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から堅調に推移し、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、FRBが0.75%の大幅利上げ継続を決めたことから、米国の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～12月)

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米国の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。12月は、FOMCでは利上げ幅が縮小されたものの、金融引締めには積極的なタカ派的姿勢が維持され米国の景気悪化懸念が広がったことや、日銀が金融政策決定会合で許容する長期金利の上限を引き上げたことを受け、大きく下落しました。

(2023年1月～4月)

1月の株式市場は、日銀が大規模な金融緩和策の維持を決めたことを受け、買いが優勢になりました。2月は、FRBが2会合連続で利上げ幅を縮小したことなどを好感し、買いが広がりました。その後も日銀が早期に政策修正に動くとの思わくが後退し、堅調に推移しました。3月は9日にTOPIXは期中高値となる2,071.09ポイントをつけたものの、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から月半ばにかけて大きく下落しました。その後は金融当局による迅速な支援を受け、金融システムへの過度な不安が和らいだことなどから4月にかけて堅調に推移し、期末のTOPIXは2,035.06ポイント（2023年4月21日終値）で終了しました。

<当ファンドのポータルフォリオ>

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70銘柄となりました。なお、運用の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ています。

組入銘柄の選定は、個別企業に対する直接取材を通じて「環境」、「社会」、「ガバナンス」に関するそれぞれの対応を得点化し、総合で4段階（A、B、C、D）に評価しています。

評価視点	
環境	環境マネジメント体制、環境パフォーマンスの向上、環境・社会に配慮した事業活動
社会	品質管理の徹底、顧客満足度の向上、情報管理の徹底、サプライヤーとの共存共栄、人材確保・定着、ダイバーシティ、労働環境の向上、社内コミュニケーション
ガバナンス	マテリアリティ（重要課題）の設定・取組み、ステークホルダーコミュニケーション、企業理念・行動規範の徹底、コーポレートガバナンス体制、コンプライアンスの徹底

SRI総合評価別投資比率および組入上位10銘柄（決算日時点）は、以下のとおりです。

SRI総合評価別投資比率

SRI総合評価	比率
A	82.1%
B	16.3%
C	0.0%
D	0.0%

<SRI評価の定義について>

富国生命投資顧問株式会社ではSRI面の評価を行う目的で、アナリスト、ファンドマネージャーが企業のSRIに関する取組みについて情報を収集しています。個別企業に対する直接取材を通じて「環境」「社会」「ガバナンス」に関するそれぞれ企業の取組み度合でスコア（0～3点）を算出し、総合で4段階（A、B、C、D）に評価します。評価基準は以下の通りです。「A」「B」は投資適格、「C」「D」は投資不適格と判断します。

SRI総合評価	点数
A	2.3点以上～3点
B	1.8点以上～2.3点未満
C	0点～1.8点未満
D	取材拒否により算出不能

組入上位10銘柄

	銘柄名	投資比率	SRIの着眼点
1	ソニーグループ	4.6%	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ことを目指し、過去の実績に固執しない自由闊達なアイデアを受け入れる社風、ガバナンスの透明性などを評価。
2	日立製作所	3.7%	組織・地域・世代を超えた連携力や多様な人財が活躍できるインクルーシブな組織づくりなどにより、社会課題の解決を目指している点や透明性の高いガバナンス体制を評価。
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	3.7%	「世界が進むチカラになる」というパーパスを体現するため、「挑戦と変革」を支える人材育成に注力し、経営者が社内風土の改革を徹底している点を評価。
4	トヨタ自動車	3.6%	経営トップのコミットメントの下、自動車業界の環境活動をけん引しているほか、水素社会の構築にも注力している点などを評価。
5	日本電信電話	3.6%	設立時からの使命である公共性と企業性を両立させ、パートナーとの協業、社員の満足度を高める取組みなどにより通信インフラを構築。通信の低電力化を積極的に推進している点などを評価。
6	伊藤忠商事	3.2%	「三方よし」という理念のもとサステナビリティを重視した経営を推進。先駆的な取組みによる持続的な成長を期待。
7	信越化学工業	3.1%	「優先順位を決め、余計な事をせず、価値を生み出すことに集中」する社風が根付いており、従業員のモチベーションが高い点や、汎用化学品（塩ビ）のリサイクルなど資源循環にも注力している点を評価。
8	ダイキン工業	2.9%	冷媒と空調機の両方を作っている世界唯一の企業で、環境対応が事業に直結している。重要特許の公開など環境に対する先進的な取組みを評価。
9	三菱商事	2.4%	経営環境に応じて業態を変化させてきた強みや、環境への取組み、ガバナンスの透明性が高い点などを評価。
10	浜松ホトニクス	2.3%	光技術で世界トップ。同社技術によりノーベル賞が複数誕生するなど、開発意欲の高い従業員のモチベーションに応える環境を構築している点や、採算重視のビジネス体制などを高く評価。

※上記比率は純資産総額に対する比率です。

※富国生命投資顧問株式会社のデータをもとにしんきんアセットマネジメント投信が作成しています。

富国生命投資顧問株式会社「スチュワードシップ活動の概況（抜粋）」

「当社は、投資先企業やその事業環境等に関する深い理解のほか、サステナビリティの考慮に基づく建設的なエンゲージメント等を通じて、当該企業の企業価値の向上やその持続的成長を促すことにより、お客さまから委託された資金の中長期的な投資リターン拡大を図ることが、スチュワードシップ責任であると考えています。

投資先企業の財務面の情報だけではなく、ESG要素等の非財務情報も勘案して、投資先企業とエンゲージメントを行うこと、また議決権を行使することにより、スチュワードシップ責任を果たしています。」

（概況およびスチュワードシップレポートは同社のホームページでご確認いただけます。）

○スチュワードシップ活動の概況

<https://www.fukoku-cm.co.jp/company-profile/stewardship-overview.html>

○スチュワードシップレポート

<https://www.fukoku-cm.co.jp/company-profile/stewardship-report.html>

＜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+8.2%となり、同期間のTOPIXの騰落率である+5.6%を2.6%上回りました。市場で軟調であったサービス業が非保有であったことや、同じく軟調であった輸送用機器の組入比率が低かったことなどが、プラス効果となり、ファンドの騰落率はTOPIXを上回りました。

＜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。なお、運用の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。

○1万口当たりの費用明細

(2022年4月22日～2023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 19 (19)	% 0.068 (0.068)	(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	19	0.068	
期中の平均基準価額は、27,720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

(2022年4月22日～2023年4月21日)

株式

国 内	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
		947	2,070,501	762	1,979,046
		(164)	()		

(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

(2022年4月22日～2023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	4,049,547千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,712,478千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52

(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

(2022年4月22日～2023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

(2023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 (1.7%)			
大林組	75.6	—	—
大和ハウス工業	42.9	43.5	139,852
食料品 (5.2%)			
明治ホールディングス	10.8	—	—
日本ハム	16.4	16.6	64,657
キリンホールディングス	23.8	—	—
不二製油グループ本社	11	11.1	22,588
味の素	—	22.3	108,801
ニチレイ	28.1	28.5	77,577
日清食品ホールディングス	11.2	11.4	144,210
繊維製品 (0.7%)			
東レ	119.7	70.6	53,062
パルプ・紙 (0.8%)			
レンゴー	68.2	69.2	60,342
化学 (10.7%)			
信越化学工業	12.5	62.2	253,962
三井化学	35.6	36.1	123,281
KHネオケム	6.3	14.1	32,599
積水化学工業	40.6	41.2	77,868
花王	13.6	—	—
富士フィルムホールディングス	21.2	21.4	146,611
資生堂	8.8	—	—
ファンケル	—	47.6	117,334
エフピコ	8	8.1	26,649
ユニ・チャーム	—	16	87,376
医薬品 (3.7%)			
協和キリン	21.5	38.3	118,155

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中外製薬	18.7	18.9	62,029
ロート製薬	10.8	21.8	61,018
小野薬品工業	19.5	17.6	47,194
第一三共	33.4	—	—
ペプチドリーム	6.7	6.8	12,654
ゴム製品 (0.4%)			
TOYO TIRE	—	22.2	34,831
ガラス・土石製品 (2.8%)			
AGC	31.1	31.5	157,027
日本碍子	37.8	38.3	67,561
鉄鋼 (1.0%)			
JFEホールディングス	50.2	50.9	83,883
非鉄金属 (0.8%)			
DOWAホールディングス	14.1	14.2	62,054
住友電気工業	40.4	—	—
機械 (7.4%)			
ディスコ	3.1	9.3	154,752
小松製作所	42.5	43.1	140,764
ダイキン工業	8.4	10.2	238,731
ダイフク	2.9	—	—
日本精工	32.7	84.9	64,184
電気機器 (18.1%)			
日立製作所	38.7	39.2	302,937
ニデック	13	19.7	129,054
オムロン	4.9	9.4	71,769
ソニーグループ	30.4	30.8	378,532
リオン	6	9.8	19,364
横河電機	49.5	50.2	108,733

しんきんフコクSRIマザーファンド－第19期－

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芝浦電子	—	6	34,260
ローム	6	8	85,600
浜松ホトニクス	25.5	25.8	186,534
小糸製作所	10.9	22	53,724
東京エレクトロン	—	5.8	90,422
輸送用機器 (5.8%)			
豊田自動織機	19.5	14.2	107,352
トヨタ自動車	125.1	164.7	296,789
シマノ	—	2.8	64,064
精密機器 (1.7%)			
テルモ	28	—	—
島津製作所	26.2	26.6	111,587
タムロン	20.8	7.9	23,700
HOYA	5.2	—	—
その他製品 (4.2%)			
バンダイナムコホールディングス	8.1	31.5	93,980
フジシールインターナショナル	13.7	21.9	32,521
ビジョン	29.7	20	40,620
任天堂	4.1	31.4	173,328
電気・ガス業 (1.1%)			
大阪瓦斯	40.9	41.4	90,459
陸運業 (2.2%)			
東急	43.9	—	—
東日本旅客鉄道	8.4	—	—
西日本旅客鉄道	15.5	29.8	173,376
海運業 (1.0%)			
商船三井	24.3	21.9	76,540
情報・通信業 (10.1%)			
ユーザベース	29.4	—	—
野村総合研究所	31.9	42.4	138,436
ラクスル	7.4	—	—
オービック	6.4	8.5	181,305
Zホールディングス	109.3	110.9	41,232

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日本電信電話	62.1	73.5	294,882	
ソフトバンク	73.6	—	—	
ソフトバンクグループ	22.6	31.7	158,373	
卸売業 (5.6%)				
伊藤忠商事	57	58	258,506	
三菱商事	38.4	38.9	193,877	
小売業 (5.2%)				
J. フロント リテイリング	—	72.9	105,267	
コスモス薬品	5.4	5.5	70,510	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	—	28.9	73,579	
しまむら	—	6.9	86,457	
丸井グループ	72.6	38.6	81,175	
銀行業 (7.0%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	52.9	345	299,011	
三井住友トラスト・ホールディングス	28.4	36.6	176,778	
三井住友フィナンシャルグループ	43.7	—	—	
千葉銀行	—	100	88,300	
保険業 (1.5%)				
SOMPOホールディングス	13.2	—	—	
東京海上ホールディングス	17.2	43.7	116,788	
不動産業 (1.3%)				
三井不動産	—	41.7	105,146	
三菱地所	39.2	—	—	
イオンモール	11.5	—	—	
サービス業 (—%)				
博報堂DYホールディングス	48.3	—	—	
セコム	6.2	—	—	
合 計	株 数・金 額	2,303	2,652	8,056,492
	銘柄数<比率>	79	70	<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) 一印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2023年4月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	8,056,492	98.4
コール・ローン等、その他	130,269	1.6
投資信託財産総額	8,186,761	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 (2023年4月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,186,761,238
コール・ローン等	34,937,854
株式(評価額)	8,056,492,030
未収配当金	95,331,354
(B) 負債	1,591
未払利息	26
その他未払費用	1,565
(C) 純資産総額(A-B)	8,186,759,647
元本	2,788,387,238
次期繰越損益金	5,398,372,409
(D) 受益権総口数	2,788,387,238口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,360円

(注1) 当親投資信託の期首元本額は2,825,728,259円、期中追加設定元本額は20,517,830円、期中一部解約元本額は57,858,851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
 フコクSRI(社会的責任投資)ファンド 2,296,511,152円
 しんきんSRIファンド 491,876,086円

(注3) 1口当たり純資産額は2.9360円です。

○損益の状況 (2022年4月22日~2023年4月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	204,798,255
受取配当金	204,821,554
その他収益金	1,392
支払利息	△ 24,691
(B) 有価証券売買損益	416,127,890
売買益	807,905,467
売買損	△ 391,777,577
(C) 保管費用等	△ 11,428
(D) 当期損益金(A+B+C)	620,914,717
(E) 前期繰越損益金	4,845,316,671
(F) 追加信託差損益金	36,482,170
(G) 解約差損益金	△ 104,341,149
(H) 計(D+E+F+G)	5,398,372,409
次期繰越損益金(H)	5,398,372,409

(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。