

○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／インデックス型
信託期間	14年(当初設定日:2014年6月6日 償還日:2028年6月5日)
主要投資対象	「しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンド」(以下「マザーファンド」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主としてマザーファンドの受益証券への投資を通じて、J P X 日経インデックス 4 0 0 の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ②マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③運用の効率化および J P X 日経インデックス 4 0 0 への連動を図るため、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、通貨ならびに金利に係る先物取引およびオプション取引、および外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。 ④株式以外の資産への実質投資割合は、原則として、投資信託財産の総額の50%以下とします。 ⑤市況動向あるいは資金動向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。
主要投資制限	①株式への実質投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。 ③外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤上場投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。
収益分配方針	年1回の決算日に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益(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、市況動向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があります。

■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。

運用報告書(全体版)

しんきん J P X 日経 4 0 0 オープン

決算日

(第9期:2023年6月5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 J P X 日経 4 0 0 オープン」は2023年6月5日に第9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。

 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J P X日経400オープン	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9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	7
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	8
損益の状況	8
分配金のお知らせ	9
◇親投資信託の運用報告書	
しんきんJ P X日経400マザーファンド	10

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		JPX日経インデックス400※ (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 騰 落	中 率			
	円		円		%	ポイント	%	百万円
5期(2019年6月5日)	12,302		0		△11.8	13,608.16	△13.3	90.9 8.9 6,190
6期(2020年6月5日)	13,118		280		8.9	14,534.54	6.8	97.8 1.9 4,358
7期(2021年6月7日)	15,919		270		23.4	17,706.94	21.8	97.3 2.5 3,868
8期(2022年6月6日)	15,923		40		0.3	17,467.93	△1.3	92.0 8.0 6,033
9期(2023年6月5日)	18,347		420		17.9	20,182.31	15.5	94.7 4.8 5,595

(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		JPX日経インデックス400※ (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6月6日	15,923		—	17,467.93	—	92.0	8.0
6月末	15,355		△3.6	16,811.46	△3.8	92.8	7.1
7月末	15,936		0.1	17,462.60	△0.0	95.1	4.8
8月末	16,132		1.3	17,679.30	1.2	94.7	5.2
9月末	15,195		△4.6	16,468.29	△5.7	93.0	6.9
10月末	15,969		0.3	17,322.84	△0.8	94.7	5.0
11月末	16,492		3.6	17,899.26	2.5	96.0	4.0
12月末	15,722		△1.3	17,039.51	△2.5	93.3	6.6
2023年1月末	16,414		3.1	17,804.63	1.9	97.5	1.9
2月末	16,562		4.0	17,972.44	2.9	96.3	3.6
3月末	16,831		5.7	18,057.76	3.4	93.4	5.6
4月末	17,252		8.3	18,520.14	6.0	94.2	5.0
5月末	17,986		13.0	19,331.68	10.7	95.3	4.6
(期末)							
2023年6月5日	18,767		17.9	20,182.31	15.5	94.7	4.8

(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。

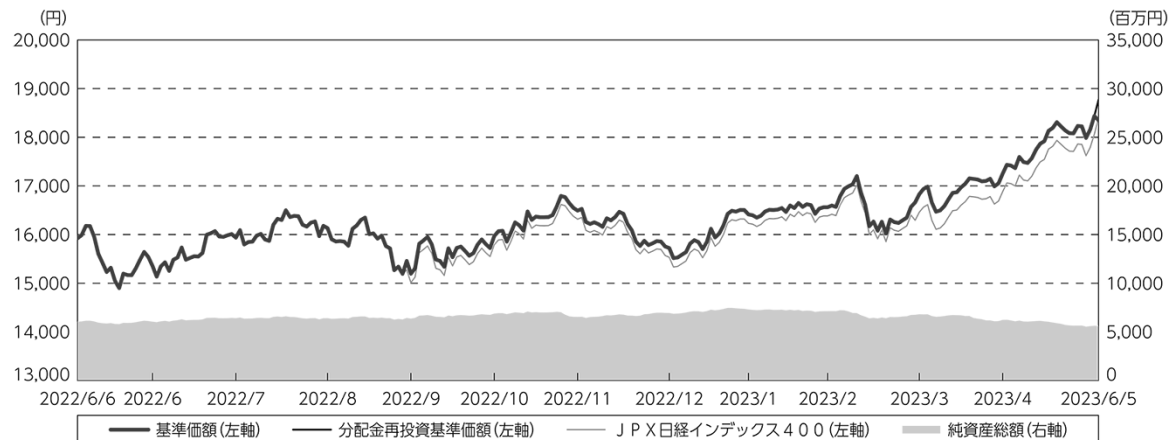
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※「JPX日経インデックス400」は、株式会社JPX総研（以下「JPX総研」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」自体及び「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。JPX総研及び日経は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、JPX総研及び日経は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。

○第9期の運用経過等（2022年6月7日～2023年6月5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J P X日経インデックス400は、期首(2022年6月6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、J P X日経インデックス400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J P X日経400マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、J P X日経インデックス400(以下「J P X日経400」という。)の動きに連動する投資成果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>

- ・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(F R B)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。

＜投資環境＞

(2022年6月～9月)

当期のJ P X日経400は、17,467.93ポイント（2022年6月6日終値）で始まりました。

6月の株式市場は、上海のロックダウン（都市封鎖）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堅調にスタートしたものの、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J P X日経400は期中安値となる16,338.39ポイントまで下落しました。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～3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、3月上旬にかけ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～期末)

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月から期末にかけては、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、期末のJ P X日経400は期中高値である20,182.31ポイント（2023年6月5日終値）で終了しました。当期中のJ P X日経400は15.5%の上昇となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

J P X日経400の動きに連動する投資成果を目指して、親投資信託である「しんきんJ P X日経400マザーファンド」の受益証券の組入れを行い、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J P X日経400マザーファンド

J P X日経400に連動する投資成果を目指し、設定・解約に応じた株式売上のほか、指数構成銘柄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、株式組入比率はT O P I X先物等を利用しながら、高位の水準を保つように努めました。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

決算日時点の基準価額の騰落率(分配金込み)は+17.9%となり、同期間のJ P X日経400の騰落率である+15.5%を、2.4%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因としては、マザーファンドで保有している組入銘柄の配当金計上などのプラス要因が、信託報酬などのマイナス要因を上回ったことが挙げられます。

<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水準などを勘案して1万口当たり420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9期
	2022年6月7日～ 2023年6月5日
当期分配金 (対基準価額比率)	420 2.238%
当期の収益	420
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,453

(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、親投資信託である「しんきんJ P X日経400マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、J P X日経400の動きに連動させることを目指して運用を行います。

●しんきんJ P X日経400マザーファンド

J P X日経400に連動する投資成果を目指し、T O P I X先物等も利用しながら株式組入比率を高位に保つように努めます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年6月7日～2023年6月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 107	% 0.658	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(45)	(0.274)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(54)	(0.329)	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)	(0.055)	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	2	0.011	(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)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(2)	(0.010)	
(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
(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	109	0.671	
期中の平均基準価額は、16,320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。

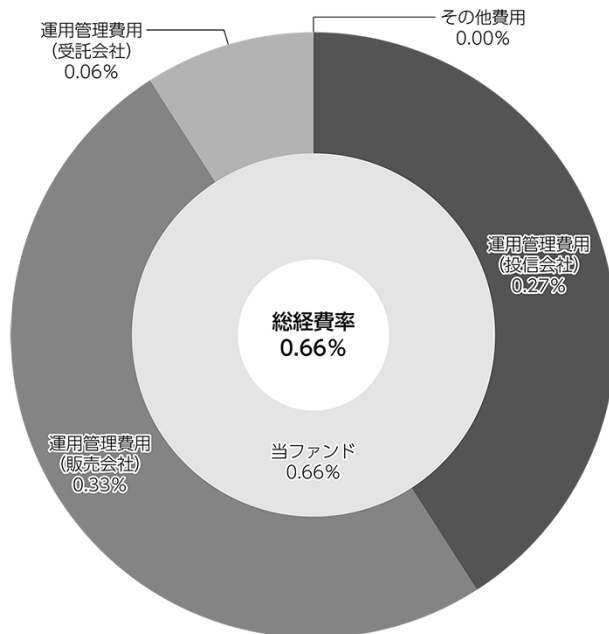
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.66%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6月7日～2023年6月5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J P X日経400マザーファンド	1,279,819	2,342,100	2,008,655	3,968,300

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年6月7日～2023年6月5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J P X日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	6,228,704千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,197,264千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00

(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6月7日～2023年6月5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6月7日～2023年6月5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6月7日～2023年6月5日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年6月5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J P X日経400マザーファンド	3,301,527	2,572,690	5,592,772

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2023年6月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
しんきんJ P X日経400マザーファンド	5,592,772	96.1
コール・ローン等、その他	224,796	3.9
投資信託財産総額	5,817,568	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6月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,817,568,884
コール・ローン等	49,996,594
しんきんJ P X日経400マザーファンド(評価額)	5,592,772,290
未収入金	174,800,000
(B) 負債	222,213,397
未払収益分配金	128,087,233
未払解約金	72,258,359
未払信託報酬	21,865,193
未払利息	105
その他未払費用	2,507
(C) 純資産総額(A-B)	5,595,355,487
元本	3,049,696,035
次期繰越損益金	2,545,659,452
(D) 受益権総口数	3,049,696,035口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,347円

(注1) 当ファンドの期首元本額は3,789,038,593円、期中追加設定元本額は2,109,050,289円、期中一部解約元本額は2,848,392,847円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.8347円です。

○損益の状況 (2022年6月7日～2023年6月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 7,314
支払利息	△ 7,314
(B) 有価証券売買損益	882,597,844
売買益	1,132,258,213
売買損	△ 249,660,369
(C) 信託報酬等	△ 43,240,141
(D) 当期損益金(A+B+C)	839,350,389
(E) 前期繰越損益金	182,643,635
(F) 追加信託差損益金	1,651,752,661
(配当等相当額)	(1,673,965,621)
(売買損益相当額)	(△ 22,212,960)
(G) 計(D+E+F)	2,673,746,685
(H) 収益分配金	△ 128,087,233
次期繰越損益金(G+H)	2,545,659,452
追加信託差損益金	1,651,752,661
(配当等相当額)	(1,684,130,193)
(売買損益相当額)	(△ 32,377,532)
分配準備積立金	893,906,791

(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(128,778,118円)、費用控除後の有価証券等損益額(684,296,869円)、信託約款に規定する収益調整金(1,684,130,193円)および分配準備積立金(208,919,037円)より分配対象収益は2,706,124,217円(10,000口当たり8,873円)であり、うち128,087,233円(10,000口当たり420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)	420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「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(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。

運用報告書

親投資信託

しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンド

第 9 期

(決算日：2023年6月5日)

しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンドの第 9 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に上場している株式（上場予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
運用方針	①主として我が国の金融商品取引所に上場している株式に投資し、J P X 日経インデックス 4 0 0 の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ②株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③運用の効率化および J P X 日経インデックス 4 0 0 への連動を図るため、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、通貨ならびに金利に係る先物取引およびオプション取引、および外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。 ④株式以外の資産への投資割合は、原則として、投資信託財産の総額の50%以下とします。 ⑤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。
投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ③外貨建資産への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。 ⑤上場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10%以下とします。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400※		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落	中率	(ベンチマーク)	騰落			
	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
5期(2019年6月5日)	13,318	△11.2	13,608.16	△13.3	90.9	8.9	6,188
6期(2020年6月5日)	14,602	9.6	14,534.54	6.8	97.8	1.9	4,356
7期(2021年6月7日)	18,145	24.3	17,706.94	21.8	97.6	2.5	3,859
8期(2022年6月6日)	18,315	0.9	17,467.93	△1.3	91.8	8.0	6,046
9期(2023年6月5日)	21,739	18.7	20,182.31	15.5	94.8	4.8	5,592

(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		J P X日経インデックス400※		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2022年6月6日	円	%	ポイント	%	%	%
	18,315	—	17,467.93	—	91.8	8.0
6月末	17,669	△3.5	16,811.46	△3.8	92.8	7.1
7月末	18,348	0.2	17,462.60	△0.0	95.1	4.8
8月末	18,584	1.5	17,679.30	1.2	94.7	5.2
9月末	17,514	△4.4	16,468.29	△5.7	93.0	6.9
10月末	18,417	0.6	17,322.84	△0.8	94.7	5.0
11月末	19,030	3.9	17,899.26	2.5	96.0	4.0
12月末	18,152	△0.9	17,039.51	△2.5	93.3	6.6
2023年1月末	18,962	3.5	17,804.63	1.9	97.5	1.9
2月末	19,143	4.5	17,972.44	2.9	96.3	3.6
3月末	19,464	6.3	18,057.76	3.4	93.4	5.6
4月末	19,961	9.0	18,520.14	6.0	94.2	5.0
5月末	20,824	13.7	19,331.68	10.7	95.3	4.6
(期末) 2023年6月5日	21,739	18.7	20,182.31	15.5	94.8	4.8

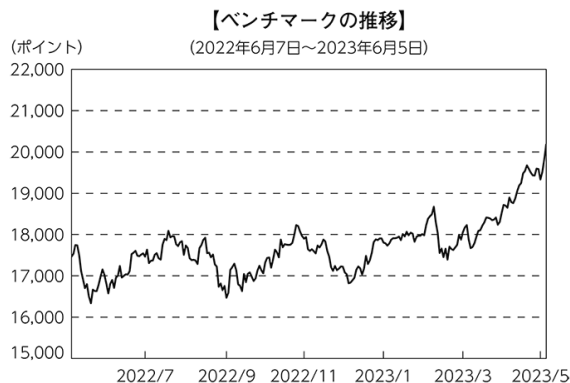
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

※「J P X日経インデックス400」は、株式会社J P X総研（以下「J P X総研」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」という。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」自体及び「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。J P X総研及び日経は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、J P X総研及び日経は、その運用及び本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。

○第9期の運用経過等（2022年6月7日～2023年6月5日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、J P X日経インデックス400（以下「J P X日経400」という。）の動きに連動する投資成果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＞

- ・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（F R B）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。

＜投資環境＞

(2022年6月～9月)

当期のJ P X日経400は、17,467.93ポイント（2022年6月6日終値）で始まりました。

6月の株式市場は、上海のロックダウン（都市封鎖）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堅調にスタートしたものの、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J P X日経400は期中安値となる16,338.39ポイントまで下落しました。7月の株式市場は、米連邦公開市場委員会（F O M C）の議事要旨が一段の金融引締めに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ました。9月は、8月の米消費者物価指数（C P I）の伸びが市場予想を上回ったことや、F R B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C P I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、F R B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、F O M Cでは利上げ幅が縮小されたものの、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、大きく下落しました。

(2023年1月～3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、F R B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～期末)

4月の株式市場は、F R B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月から期末にかけては、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、期末のJ P X日経400は期中高値である20,182.31ポイント（2023年6月5日終値）で終了しました。当期中のJ P X日経400は15.5%の上昇となりました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

J P X日経400に連動する投資成果を目指し、設定・解約に応じた株式売買のほか、指数構成銘柄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、株式組入比率はT O P I X先物等を利用しながら、高位の水準を保つように努めました。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

決算日時点の基準価額の騰落率は+18.7%となり、同期間のJ P X日経400の騰落率である+15.5%を、3.2%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因としては、保有している組入銘柄の配当金計上などのプラス要因が、株式売買手数料などのマイナス要因を上回ったことが挙げられます。

＜今後の運用方針＞

引き続き、J P X日経400に連動する投資成果を目指し、T O P I X先物等も利用しながら株式組入比率を高位に保つように努めます。

○1万口当たりの費用明細

(2022年6月7日～2023年6月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 2 (0) (2)	% 0.011 (0.001) (0.010)	(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)	0.002 (0.002)	(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	2	0.013	
期中の平均基準価額は、18,839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6月7日～2023年6月5日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内		千株 930 (91)	千円 2,516,995 ()	千株 1,284	千円 3,711,709

(注1) 金額は受渡し代金。

(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。

先物取引の種類別取引状況

種 類	買 建		売 建	
	新 買 付 規 額	決 済 額	新 売 付 規 額	決 済 額
国 内 株式先物取引	百万円 7,167	百万円 7,438	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年6月7日～2023年6月5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	6,228,704千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,197,264千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.00

(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6月7日～2023年6月5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6月5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 (0.0%)			
ニッスイ	3.9	3.2	2,017
鉱業 (0.3%)			
I N P E X	14.7	11.8	18,378
建設業 (2.1%)			
ウエストホールディングス	—	0.3	855
ショーボンドホールディングス	—	0.4	2,325
ミライト・ワン	1.3	1.1	1,948
安藤・間	1.9	1.9	1,972
東急建設	1.1	—	—
コムシスホールディングス	1.3	1.1	3,067
東建コーポレーション	0.1	—	—
大成建設	2.6	2.1	9,592
大林組	9	8	9,440
清水建設	8.4	6.7	5,818
長谷工コーポレーション	2.6	2.3	3,830
鹿島建設	6.6	5	10,275

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
西松建設	0.6	0.4	1,379
三井住友建設	2.1	—	—
戸田建設	3.7	2.8	2,227
熊谷組	0.5	0.4	1,234
大東建託	1	—	—
五洋建設	3.6	3.2	2,314
住友林業	2.2	1.7	5,436
大和ハウス工業	7.9	6.3	23,253
積水ハウス	9.4	6.8	19,002
関電工	1.5	1.2	1,286
エクシオグループ	1.3	1	2,759
九電工	0.6	0.5	1,906
インフロニア・ホールディングス	3.6	2.3	2,979
食料品 (4.0%)			
森永製菓	0.6	0.4	1,784
カルビー	1.4	1	2,780
森永乳業	0.5	0.4	2,029

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤクルト本社	2	1.6	14,944
明治ホールディングス	1.8	2.8	8,887
ブリマハム	0.4	0.3	651
日本ハム	1.1	0.9	3,466
アサヒグループホールディングス	6.5	5.2	28,646
キリンホールディングス	11.1	10.2	21,603
宝ホールディングス	—	1.5	1,588
サントリー食品インターナショナル	2	1.6	8,496
伊藤園	0.9	—	—
キッコーマン	1.9	1.5	12,711
味の素	6.2	5.4	30,580
キューピー	1.4	1.2	2,713
カゴメ	1.1	1	3,330
アリアケジャパン	0.3	—	—
ニチレイ	1.2	1	3,068
東洋水産	1.4	1.1	6,963
日清食品ホールディングス	1	0.8	9,700
日本たばこ産業	16.2	14.8	46,131
繊維製品 (0.4%)			
帝人	2.7	2.2	2,949
東レ	19.4	15.3	11,807
ゴールドウイン	0.5	0.4	5,066
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	11.7	9.5	5,205
大王製紙	1.3	1	1,132
レンゴー	2.5	2.1	1,787
化学 (7.0%)			
クラレ	4.1	3.6	4,798
旭化成	18.7	14.3	13,819
レゾナック・ホールディングス	2.6	—	—
住友化学	20.7	17	7,277
日産化学	1.4	1.1	6,911
東ソー	3.9	3.1	5,125
トクヤマ	0.9	0.7	1,563
デンカ	1	0.8	2,093
信越化学工業	4.1	19	86,013
エア・ウォーター	2.5	2.2	4,054
日本酸素ホールディングス	2.6	2.2	6,672
三菱瓦斯化学	2.5	1.7	3,514

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井化学	2.4	1.9	7,052
三菱ケミカルグループ	18.8	15.4	12,478
KHネオケム	—	0.4	928
ダイセル	4.1	3.4	4,125
積水化学工業	5.9	4.7	9,418
日本ゼオン	2.4	1.4	2,108
アイカ工業	0.7	0.6	1,841
UBE	1.4	1.2	2,763
日油	0.9	0.7	4,285
花王	6.4	5.6	28,134
日本ペイントホールディングス	11.1	10.1	11,685
関西ペイント	2.7	2.1	4,529
D I C	1.1	—	—
富士フイルムホールディングス	5.3	4.4	38,750
資生堂	5.6	4.8	31,228
ライオン	3.2	2.7	3,721
ファンケル	1.2	1	2,404
コーセー	0.6	0.5	7,212
ポーラ・オルビスホールディングス	1.3	—	—
小林製薬	0.8	0.7	5,630
タカラバイオ	—	0.6	999
デクセリアルズ	—	0.7	2,164
日東電工	1.8	1.7	17,620
エフピコ	0.6	0.4	1,182
ニフコ	1	0.8	3,088
ユニ・チャーム	5.8	4.8	26,553
医薬品 (7.0%)			
協和キリン	3.2	2.8	7,716
武田薬品工業	22.2	17.6	79,147
アステラス製薬	25.8	21.6	49,410
住友ファーマ	1.9	1.7	1,101
塩野義製薬	3.6	2.9	18,510
日本新薬	0.7	0.5	3,278
中外製薬	9.4	7.2	28,245
科研製薬	0.4	0.4	1,451
エーザイ	3.4	2.8	27,440
ロート製薬	1.5	2.2	6,780
小野薬品工業	6.1	4.4	12,130
参天製薬	5.4	4.2	5,439

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
JCRファーマ	0.9	0.8	1,134
東和薬品	0.4	0.4	708
第一三共	22.5	20	96,180
大塚ホールディングス	5.9	5.2	27,726
ベプチドリーム	1.6	1.1	2,681
サワイグループホールディングス	0.6	—	—
石油・石炭製品 (0.6%)			
出光興産	3.2	2.5	7,073
ENEOSホールディングス	45.4	38.9	18,617
コスモエネルギーホールディングス	1.1	0.9	3,675
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	1.5	1.3	3,971
TOYO TIRE	1.5	1.3	2,292
ブリヂストン	8.2	7.3	42,281
住友ゴム工業	2.5	2.2	2,777
ガラス・土石製品 (0.7%)			
AGC	2.6	2.3	11,879
太平洋セメント	1.7	1.5	3,780
東海カーボン	2.4	1.9	2,331
TOTO	1.9	1.5	6,838
日本碍子	3.1	2.7	4,700
日本特殊陶業	2.2	1.7	4,499
MARUWA	—	0.1	1,962
ニチアス	0.7	0.6	1,680
鉄鋼 (0.8%)			
日本製鉄	—	10.6	30,284
JFEホールディングス	—	6.3	11,494
東京製鐵	—	0.7	965
非鉄金属 (0.6%)			
三井金属鉱業	0.8	0.7	2,228
住友金属鉱山	3.5	2.7	12,204
DOWAホールディングス	—	0.5	2,159
住友電気工業	10.7	8.1	13,749
アサヒホールディングス	1.2	1	1,958
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	4.8	4.5	9,180
三和ホールディングス	2.8	2.2	3,803
リンナイ	0.5	1.3	3,962

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (6.0%)			
日本製鋼所	0.8	—	—
三浦工業	1.2	1	3,904
アマダ	4.7	3.7	5,117
F U J I	1.3	1	2,374
オーエスジー	1.3	—	—
DMG森精機	1.7	1.4	3,448
ディスコ	0.4	1.1	23,105
オプトラン	0.4	0.3	708
ナブテスコ	1.6	1.4	4,593
SMC	0.9	0.7	56,756
小松製作所	13.7	10.8	38,005
住友重機械工業	1.7	1.4	4,524
日立建機	1.2	0.9	3,374
ローツェ	—	0.1	1,144
クボタ	14.6	12.2	24,814
荏原製作所	1.2	0.9	5,886
ダイキン工業	3.5	2.8	80,962
ダイフク	1.5	3.6	10,710
竹内製作所	0.5	0.4	1,594
ホシザキ	0.9	1.5	7,798
日本精工	5.3	—	—
マキタ	3.5	2.9	11,373
三菱重工業	4.5	4	24,996
I H I	1.9	1.5	5,167
電気機器 (18.5%)			
イビデン	—	1.3	9,812
ブラザー工業	3.5	3.1	6,709
ミネベアミツミ	4.9	4	11,014
日立製作所	13.7	9.5	81,253
三菱電機	28.8	23.9	46,688
富士電機	1.7	1.4	8,566
安川電機	3.1	2.7	17,277
ニデック	6.6	5.6	41,440
オムロン	2.5	2.1	18,847
MC J	1	1	982
日本電気	3.7	3.3	22,601
富士通	2.7	2.3	44,355
ルネサスエレクトロニクス	16.4	15.1	37,523

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイコーエプソン	3.5	3	6,649
ワコム	2.3	1.8	1,303
アルバック	0.6	0.5	2,894
エレコム	0.7	0.6	932
パナソニック ホールディングス	32.2	27.3	43,789
シャープ	—	2.8	2,245
アンリツ	1.9	1.6	1,944
ソニーグループ	8.1	6.1	84,546
TDK	4.4	3.7	20,457
横河電機	2.9	2.5	6,930
アズビル	1.8	1.6	7,444
日本光電工業	1.2	1.1	4,152
堀場製作所	0.5	0.5	3,925
アドバンテスト	2.2	1.8	32,994
キーエンス	1.4	1.4	100,646
シスメックス	2.3	2	19,860
フェローテックホールディングス	—	0.7	2,219
レーザーテック	1.3	1	21,480
スタンレー電気	2	—	—
カシオ計算機	1.9	1.7	2,042
ファナック	2.6	11.2	56,302
浜松ホトニクス	2.1	1.8	13,001
新光電気工業	—	0.8	4,497
京セラ	4.2	3.5	28,000
太陽誘電	1.4	1.1	4,969
村田製作所	8.4	6.9	58,870
小糸製作所	1.6	2.7	7,403
SCREENホールディングス	0.5	0.4	6,020
東京エレクトロン	1.9	4.5	87,390
輸送用機器 (5.7%)			
トヨタ紡織	1.1	1	2,394
豊田自動織機	2.2	1.7	15,565
デンソー	6.2	4.7	42,835
いすゞ自動車	9	6.6	11,236
トヨタ自動車	42	34.2	69,374
日野自動車	3.8	—	—
アイシン	2.2	1.8	7,497
本田技研工業	22.6	18.6	77,841
スズキ	6.3	4.2	20,273

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
S U B A R U	8.2	7.2	18,219
ヤマハ発動機	3.9	3.6	13,323
豊田合成	0.9	0.7	1,642
シマノ	1.1	0.9	20,889
テイ・エス テック	1.3	1	1,830
精密機器 (3.3%)			
テルモ	8.5	7	31,108
島津製作所	3.7	2.8	12,614
ブイ・テクノロジー	0.1	—	—
東京精密	0.5	0.5	3,145
オリンパス	15	14.1	31,196
HOYA	5.8	4.9	89,768
朝日インテック	3.3	2.6	7,467
その他製品 (2.0%)			
パンダイナムコホールディングス	2.6	6.3	21,546
パイロットコーポレーション	0.5	0.4	1,826
ヤマハ	1.8	1.4	7,966
ビジョン	1.8	1.5	3,106
任天堂	1.3	11.4	69,346
電気・ガス業 (1.2%)			
中部電力	8.8	8.4	14,099
関西電力	10.8	8.8	14,212
中国電力	4.5	—	—
東北電力	6.8	—	—
九州電力	5.9	5.3	4,621
北海道電力	2.6	2.2	1,265
電源開発	2.3	1.7	3,527
イーレックス	0.4	0.4	491
レノバ	0.6	0.6	989
東京瓦斯	5.5	4.8	14,712
大阪瓦斯	5.2	4.6	10,267
陸運業 (1.2%)			
S B Sホールディングス	—	0.2	628
東海旅客鉄道	2.3	1.8	30,960
阪急阪神ホールディングス	3.4	—	—
ヤマトホールディングス	4	2.9	7,532
山九	0.7	0.6	2,941
センコーグループホールディングス	1.4	1.2	1,123
日立物流	0.6	—	—

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
AZ-COM丸和ホールディングス	0.5	0.6	1,256
九州旅客鉄道	2	—	—
SGホールディングス	5	4.4	9,376
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.9	0.9	7,328
海運業 (0.7%)			
日本郵船	2.4	6.1	18,842
商船三井	4.5	4	13,020
川崎汽船	—	1.7	5,538
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
三井倉庫ホールディングス	—	0.2	687
近鉄エクスプレス	0.5	—	—
情報・通信業 (8.6%)			
NECネットエスアイ	1	0.8	1,571
システナ	4.2	3.9	1,201
日鉄ソリューションズ	0.5	0.4	1,676
T I S	2.7	2.5	9,637
コーエーテックモホールディングス	0.9	1.4	3,357
ネクソン	6.7	5.9	17,466
ティアーガイア	0.3	0.2	340
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.8	0.7	1,970
GMOペイメントゲートウェイ	0.6	0.5	5,545
インターネットイニシアティブ	—	1.3	3,669
ラクス	1.4	1.1	2,553
アカツキ	0.1	—	—
チェンジホールディングス	—	0.6	1,258
野村総合研究所	5.3	4.6	16,822
インフォコム	0.3	0.3	684
オービック	0.9	0.8	19,140
ジャストシステム	0.4	0.3	1,290
Zホールディングス	42.7	32.6	11,706
トレンドマイクロ	1.5	1.3	9,145
日本オラクル	0.5	0.4	4,424
伊藤忠テクノソリューションズ	1.3	1.2	4,490
大塚商会	1.6	1.3	7,135
電通国際情報サービス	0.4	0.3	1,578
東映アニメーション	0.1	0.1	1,356
デジタルガレージ	0.5	0.4	1,598
ネットワンシステムズ	—	0.9	3,024
B I P R O G Y	0.9	0.8	2,763

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
USEN-NEXT HOLDINGS	0.2	0.3	1,011
日本電信電話	28.3	17.9	72,745
KDDI	21.6	15.1	66,319
ソフトバンク	—	36.8	55,512
光通信	0.3	0.3	6,361
GMOインターネットグループ	—	0.8	2,114
東宝	1.7	1.4	7,893
エス・ティ・ティ・データ	7.9	7.2	14,706
DTS	—	0.5	1,797
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.4	1.2	7,605
カプコン	2.8	2.3	13,330
S C S K	2	1.9	4,310
NSD	—	0.8	2,224
コナミグループ	1.1	1	7,697
ソフトバンクグループ	8.5	9.6	57,811
卸売業 (7.4%)			
双日	3.1	2.4	6,861
アルフレッサ ホールディングス	3.2	2.4	5,252
神戸物産	2.1	1.9	7,506
ダイワボウホールディングス	1.3	1	2,657
TOKAIホールディングス	1.4	1.2	1,045
シップヘルスケアホールディングス	0.9	0.9	2,182
コマダホールディングス	0.6	—	—
メディアバルホールディングス	2.9	2.3	5,206
日本ライフライン	0.9	—	—
伊藤忠商事	18.8	14.9	75,334
丸紅	27.1	18.9	39,595
豊田通商	2.8	2.1	13,769
兼松	1.1	0.9	1,667
三井物産	22.1	17.2	81,029
住友商事	18	15	41,302
三菱商事	20.4	15	89,805
阪和興業	—	0.4	1,722
岩谷産業	0.7	0.6	4,230
P A L T A C	0.4	0.4	2,040
日鉄物産	0.2	0.1	928
ミスミグループ本社	3.7	3.6	11,476
小売業 (4.0%)			
ローソン	0.7	0.6	3,712

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エービーシー・マート	0.5	0.4	3,162
日本マクドナルドホールディングス	1.4	1.4	8,036
セリア	0.7	0.6	1,347
ビックカメラ	1.8	—	—
MonotaRO	3.8	3.4	6,912
マツキョココカラ&カンパニー	1.3	1.5	11,790
ZOZO	2	1.6	4,685
ウエルシアホールディングス	1.6	1.3	3,910
クリエイトSDホールディングス	0.4	0.4	1,380
ネクステージ	—	0.6	1,530
コスモス薬品	0.3	0.2	2,754
セブン&アイ・ホールディングス	10.5	8.3	49,907
ツルハホールディングス	0.6	0.5	4,951
クスリのアオキホールディングス	0.3	0.2	1,437
FOOD & LIFE COMPANIES	1.6	1.3	4,368
ノジマ	0.5	0.8	1,108
良品計画	3.4	2.6	3,624
コーナン商事	0.4	0.3	1,060
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	5.9	4.9	12,421
ゼンショーホールディングス	1.5	1.3	7,800
ワークマン	0.3	0.3	1,548
スギホールディングス	0.6	0.5	2,975
日本瓦斯	—	1.3	2,534
ライフコーポレーション	0.2	0.2	583
丸井グループ	2.2	1.8	4,454
イズミ	0.5	0.4	1,302
ヤオコー	0.3	0.3	2,130
ケーズホールディングス	2.6	1.7	2,105
アインホールディングス	0.4	—	—
ニトリホールディングス	1.2	1	17,185
ファーストリテイリング	0.4	1.1	37,576
サンドラッグ	1.1	0.9	3,692
銀行業 (6.0%)			
めぶきフィナンシャルグループ	12.9	11.2	3,847
コンソルディア・フィナンシャルグループ	15.5	12.1	6,726
SBI新生銀行	1.9	0.5	1,407
あおぞら銀行	1.7	1.4	3,634
三菱UFJフィナンシャル・グループ	127.6	87.3	85,134
りそなホールディングス	32.2	28.4	18,763

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	5.2	4.1	20,844
三井住友フィナンシャルグループ	19.7	16.4	94,759
千葉銀行	8.9	6.3	5,627
ふくおかフィナンシャルグループ	2.3	1.8	4,792
セブン銀行	8.8	8.1	2,284
みずほフィナンシャルグループ	36.5	32.5	69,208
証券、商品先物取引業 (0.7%)			
FPG	1	—	—
GMOフィナンシャルホールディングス	0.6	0.5	329
SBIホールディングス	3.7	—	—
ジャフコ グループ	1.1	0.8	1,398
大和証券グループ本社	21.2	16.1	10,658
野村ホールディングス	45.4	41.4	21,180
マネックスグループ	—	2.4	1,224
保険業 (3.0%)			
SOMPOホールディングス	4.5	3.9	23,489
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.3	4.6	22,636
第一生命ホールディングス	14.2	11	27,907
東京海上ホールディングス	8.7	22.2	71,328
T&Dホールディングス	7	6	11,949
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	0.7	0.6	3,063
芙蓉総合リース	0.3	0.2	2,074
みずほリース	0.4	0.3	1,290
東京センチュリー	0.5	0.4	2,085
イオンフィナンシャルサービス	1.6	1.3	1,613
アコム	5.9	4	1,323
オリエントコーポレーション	8.1	0.6	643
オリックス	17.7	14.8	36,615
三菱HCキャピタル	10.1	8.8	6,792
日本取引所グループ	7.1	6.3	14,883
不動産業 (2.1%)			
大東建託	—	0.8	10,872
いちご	3.3	—	—
ヒューリック	6.7	5.2	6,294
野村不動産ホールディングス	1.5	1.4	4,898
サムティ	0.5	—	—
プレサンスコーポレーション	0.3	0.4	758
オープンハウスグループ	0.9	0.8	4,458

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第9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
東急不動産ホールディングス	8.3	6.8	6.8	5,348
飯田グループホールディングス	2.5	2	2	4,789
ケイアイスター不動産	—	0.1	0.1	484
三井不動産	12.3	9.7	9.7	27,329
三菱地所	17.8	13.6	13.6	22,861
東京建物	2.7	2.1	2.1	3,838
住友不動産	5.7	4.1	4.1	14,919
スタートコーポレーション	0.4	0.3	0.3	833
日本エスコン	0.6	0.5	0.5	403
イオンモール	1.5	1.2	1.2	2,161
カチタス	0.7	0.6	0.6	1,503
サービス業 (3.4%)				
M I X I	0.7	—	—	—
日本M&Aセンターホールディングス	4.7	—	—	—
UTグループ	0.4	0.3	0.3	881
エス・エム・エス	1	0.9	0.9	2,690
パーソルホールディングス	2.9	2.6	2.6	7,150
総合警備保障	1.1	0.9	0.9	3,533
カカコム	2.1	1.7	1.7	3,529
ディップ	0.5	0.4	0.4	1,412
ベネフィット・ワン	1	1.1	1.1	1,814
エムスリー	5.1	4.6	4.6	15,005
アウトソーシング	1.7	—	—	—
博報堂DYホールディングス	3.8	3	3	4,525
バリューコマース	—	0.2	0.2	285

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
H. U. グループホールディングス	—	0.7	0.7	1,915
オリエンタルランド	3.2	—	—	—
ビー・エム・エル	—	0.3	0.3	936
ユー・エス・エス	3.2	2.4	2.4	5,563
サイバーエージェント	—	5.2	5.2	5,428
フルキャストホールディングス	0.2	0.2	0.2	477
エン・ジャパン	0.5	0.4	0.4	998
テクノプロ・ホールディングス	1.7	1.4	1.4	4,580
アイ・アールジャパンホールディングス	0.1	—	—	—
ジャパンマテリアル	0.9	0.7	0.7	1,580
リクルートホールディングス	16.4	16.6	16.6	74,467
ベルシステム24ホールディングス	0.4	0.3	0.3	420
ペイカレント・コンサルティング	0.2	1.9	1.9	10,584
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.9	0.8	0.8	1,554
リログループ	1.6	1.3	1.3	2,692
カナモト	0.5	—	—	—
トランス・コスモス	—	0.3	0.3	1,018
セコム	2.8	2.4	2.4	22,351
メイテック	0.3	0.9	0.9	2,148
イオンディライト	0.3	0.3	0.3	904
合 計	株 数 ・ 金 額	1,939	1,677	5,300,457
	銘柄数<比率>	399	399	<94.8%>

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 266	百万円 —

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) ー印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2023年6月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	5,300,457	91.9
コール・ローン等、その他	467,206	8.1
投資信託財産総額	5,767,663	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6月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,767,663,783
コール・ローン等	192,248,293
株式(評価額)	5,300,457,420
未収入金	205,282,043
未収配当金	61,966,027
差入委託証拠金	7,710,000
(B) 負債	174,820,577
未払解約金	174,800,000
未払利息	407
その他未払費用	20,170
(C) 純資産総額(A-B)	5,592,843,206
元本	2,572,690,690
次期繰越損益金	3,020,152,516
(D) 受益権総口数	2,572,690,690口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,739円

(注1) 当親投資信託の期首元本額は3,301,527,380円、期中追加設定元本額は1,279,819,200円、期中一部解約元本額は2,008,655,890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J P X日経400オープン 2,572,690,690円

(注3) 1口当たり純資産額は2.1739円です。

○損益の状況 (2022年6月7日~2023年6月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	175,206,709
受取配当金	175,410,290
その他収益金	684
支払利息	△ 204,265
(B) 有価証券売買損益	944,085,358
売買益	1,109,013,333
売買損	△ 164,927,975
(C) 先物取引等取引損益	53,134,800
取引益	101,301,300
取引損	△ 48,166,500
(D) 保管費用等	△ 118,208
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,172,308,659
(F) 前期繰越損益金	2,745,207,167
(G) 追加信託差損益金	1,062,280,800
(H) 解約差損益金	△1,959,644,110
(I) 計(E+F+G+H)	3,020,152,516
次期繰越損益金(I)	3,020,152,516

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引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(G)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(H)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。