

○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	無期限
主要投資対象	「しんきん日経平均マザーファンド」(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、日経平均株価(日経225)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運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、我が国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引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。
主な投資制限	①株式への実質投資割合には、制限を設けません。 ②新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。 ③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。 ④同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。 ⑤外貨建資産への投資は行いません。
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(全体版)

しんきん日経平均オープン

決算日

(第9期:2024年9月10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「しんきん日経平均オープン」は2024年9月10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。

■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

◇しんきん日経平均オープン	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	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
◇親投資信託の運用報告書	
しんきん日経平均マザーファンド	11

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)	標準価額			日経平均株価 (日経225) (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
		税 分	込 配	み 金	期 騰	落 率			
	円				円	%	%	%	百万円
5期(2020年9月10日)	13,218		250	10.6	23,235.47	8.6	77.4	22.5	3,378
6期(2021年9月10日)	17,262		170	31.9	30,381.84	30.8	98.3	1.0	3,796
7期(2022年9月12日)	16,424		0	△ 4.9	28,542.11	△ 6.1	90.9	8.6	7,208
8期(2023年9月11日)	18,686		330	15.8	32,467.76	13.8	97.3	2.4	7,357
9期(2024年9月10日)	20,849		240	12.9	36,159.16	11.4	87.7	12.1	12,280

(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	標準価額		日経平均株価 (日経225) (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	
		騰	落	騰	落			
(期首) 2023年9月11日	円 18,686		% -	円 32,467.76	% -	% 97.3	% 2.4	
9月末	18,456	△	1.2	31,857.62	△	1.9	91.4	9.7
10月末	17,872	△	4.4	30,858.85	△	5.0	95.1	4.9
11月末	19,383		3.7	33,486.89		3.1	93.0	7.0
12月末	19,392		3.8	33,464.17		3.1	93.9	6.0
2024年1月末	21,022		12.5	36,286.71		11.8	93.6	6.2
2月末	22,689		21.4	39,166.19		20.6	93.1	6.8
3月末	23,524		25.9	40,369.44		24.3	94.9	5.1
4月末	22,377		19.8	38,405.66		18.3	92.5	7.3
5月末	22,418		20.0	38,487.90		18.5	90.4	9.6
6月末	23,071		23.5	39,583.08		21.9	90.6	8.9
7月末	22,791		22.0	39,101.82		20.4	90.3	9.6
8月末	22,544		20.6	38,647.75		19.0	89.9	10.0
(期末) 2024年9月10日	円 21,089		12.9	円 36,159.16		11.4	% 87.7	% 12.1

(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。

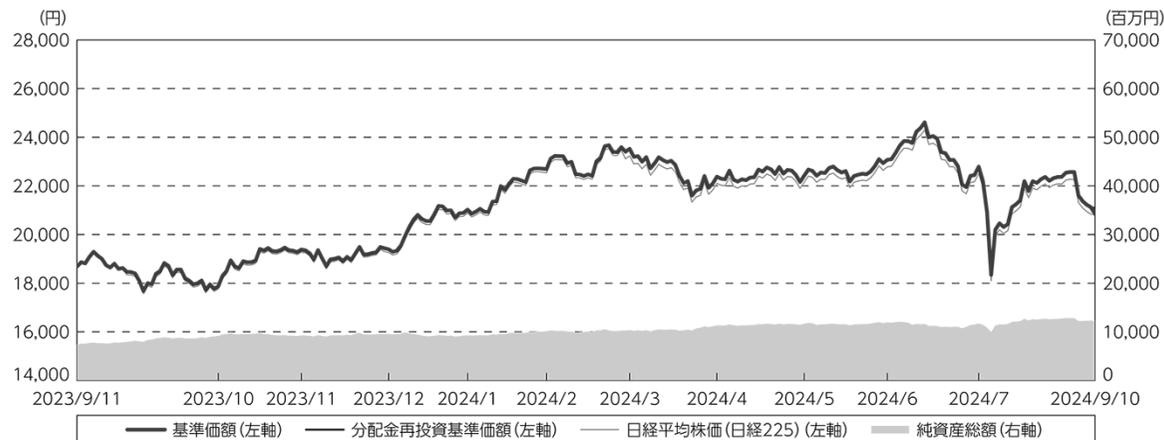
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※「日経平均株価 (日経平均)」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体および日経平均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。「日経」および「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。「しんきん日経平均オープン」は、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引等に関して一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、日経平均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、遅延または中断に関して、責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

○第9期の運用経過等（2023年9月12日～2024年9月10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日経平均株価(日経225)は、期首(2023年9月11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、日経平均株価(日経225)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「しんきん日経平均マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、日経平均株価(日経225)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。

当期は、日経平均株価が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。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>

- ・国内企業の業績に改善が見られたこと。
- ・円安米ドル高が長期的に継続したこと。
- ・日銀が金融政策の修正を行ったものの、緩和的な金融政策の継続が示唆され、安心感が広がったこと。

<下落要因>

- ・米国の経済指標が市場予想を下回り、米国経済の先行きが懸念されたこと。
- ・イスラエルとハマスの紛争により、中東情勢が緊迫化したこと。

＜投資環境＞

(2023年9月～12月)

当期の日経平均株価は、32,467.76円(2023年9月11日終値)の水準から始まりました。9月の株式市場は、中旬にかけて底堅く推移したものの、下旬に開催された米連邦公開市場委員会(FOMC)で金融引締めを長期にわたって継続する方針が示され、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、米求人件数が市場予想を大きく上回ったことなどから米長期金利が上昇したことが嫌気され、日経平均株価は10月4日に期中安値となる30,526.88円まで下落しました。また、イスラエルとハマスの紛争が勃発したことによる中東情勢の緊迫化や日銀の金融政策修正などによる国内金利上昇により上値の重い展開となりました。11月は、米消費者物価指数(CPI)の伸びが鈍化し、米小売売上高が市場予想を上回ったことで、米国経済のソフトランディング(経済の軟着陸)期待が高まり、上昇しました。12月は、米インフレ鈍化を受けた米金利低下が支えとなりましたが、大規模緩和からの脱却を示唆する日銀の正副総裁の発言をきっかけに早期の金融政策修正観測が高まったことなどから、一進一退の動きとなりました。

(2024年1月～3月)

1月の株式市場は、新しい少額投資非課税制度(NISA)の開始や、日銀の金融政策修正観測が後退し、円安が進行したことなどが支えとなり、買いが優勢となりました。2月は、国内主要企業の2023年10-12月期決算が堅調な内容であったことや、米半導体大手の決算が市場予想を上回ったことなどをきっかけに、国内企業の業績も拡大するとの期待から、上昇しました。3月は、日銀が金融政策決定会合で大規模緩和の修正を決めるとの観測が高まったことを背景に、下落する場面もありました。ただ、金融政策決定会合でマイナス金利解除などの大規模緩和の修正は行われましたが、緩和的な金融政策を継続する姿勢が示されると、株価は反発しました。

(2024年4月～6月)

4月の株式市場は、米連邦準備制度理事会(FRB)高官から利下げに慎重な発言があったことや、中東情勢の緊迫化懸念が嫌気され、売りが優勢となりました。5月は、中旬にかけて、米国の利下げ観測が高まり、買いが優勢となりましたが、下旬において、日銀が早期に利上げや国債買入れ減額を決めるとの観測が高まり、売りが優勢となりました。6月は、中旬にかけて、米雇用統計で米労働市場の底堅さが示唆されたことで円安が進行した一方、フランスの政治情勢の混迷などを受けて海外投資家による日本株売りが増加したことにより一進一退の動きとなりました。しかし、下旬は、米ドル円が160円台まで上昇したことが支えとなり、買いが優勢となりました。

(2024年7月～当期末)

7月の株式市場は、米雇用統計で失業率が上昇するなど米国経済の減速を示唆する経済指標の発表が相次いだことで、市場の利下げ期待が高まったことが好感されたことから続伸し、7月11日に日経平均株価が期中高値かつ史上最高値となる42,224.02円まで上昇しました。8月から当期末にかけては、金融政策決定会合で日銀が利上げを決めたことに加えて、さらなる利上げの可能性を示唆したことや、米雇用統計で失業率が上昇したことで米景気後退懸念が高まったことが嫌気され、軟調な動きとなりました。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、その後も、一時的に持ち直す場面はありましたが、米ドル円が急落したことなどにより下落し、期末の日経平均株価は36,159.16円(2024年9月10日終値)で終了となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

親投資信託である「しんきん日経平均マザーファンド」の受益証券への投資を通じ、日経平均株価に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

●しんきん日経平均マザーファンド

現物株式は、日経平均株価採用銘柄の中から財務内容や信用リスクを考慮して、一部の銘柄を除く場合があります。当期末現在、財務内容や信用リスクに著しい問題が生じている企業はないと判断し、225銘柄全てに投資を行っています。

<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（分配金込み）は、+12.9%となり、ベンチマークである日経平均株価の騰落率+11.4%を1.5%上回ることとなりました。

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、信託報酬や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。

<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等を勘案して、1万口当たり240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
	2023年9月12日～ 2024年9月10日
当期分配金	240
（対基準価額比率）	1.138%
当期の収益	239
当期の収益以外	0
翌期繰越分配対象額	10,848

（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「しんきん日経平均マザーファンド」の受益証券への投資を通じ、日経平均株価に連動する投資成果を目標として運用を行います。

●しんきん日経平均マザーファンド

運用の基本方針に従い、日経平均株価採用銘柄のうち、200銘柄以上に投資を行うとともに、日経平均先物等も利用しながら株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価に連動する投資成果を目標として運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年9月12日～2024年9月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 105	% 0.494	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(58)	(0.274)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(35)	(0.165)	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 ）	(12)	(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	0.009	(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 ）	(1)	(0.004)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.005)	
(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	107	0.505	
期中の平均基準価額は、21,294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。

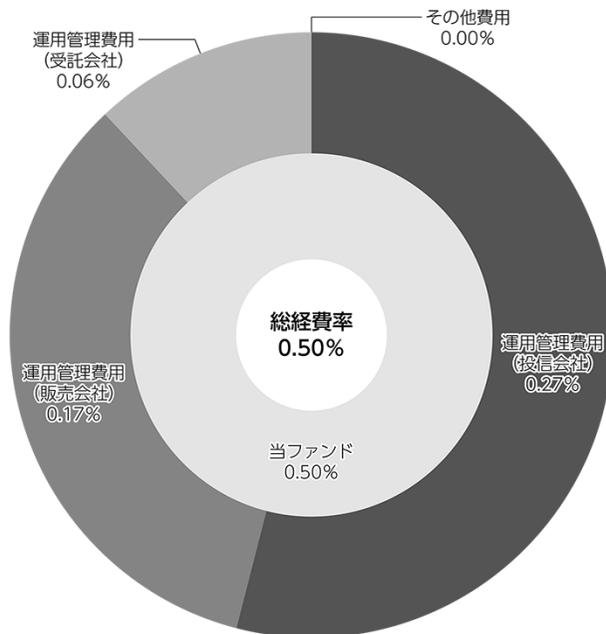
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.50%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

(2023年9月12日～2024年9月10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
しんきん日経平均マザーファンド	3,928,762 千口	8,966,500 千円	2,262,900 千口	5,395,800 千円

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2023年9月12日～2024年9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
	しんきん日経平均マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	9,079,060千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,140,074千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月12日～2024年9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。

○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

(2023年9月12日～2024年9月10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

(2023年9月12日～2024年9月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年9月10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
しんきん日経平均マザーファンド	千口 3,553,523	千口 5,219,385	千円 12,258,771

(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

(2024年9月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
しんきん日経平均マザーファンド	千円 12,258,771	% 98.4
コール・ローン等、その他	201,540	1.6
投資信託財産総額	12,460,311	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9月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	12,460,311,943	
コール・ローン等	171,539,028	
しんきん日経平均マザーファンド(評価額)	12,258,771,830	
未収入金	30,000,000	
未収利息	1,085	
(B) 負債	179,570,593	
未払収益分配金	141,370,920	
未払解約金	10,150,179	
未払信託報酬	28,049,494	
(C) 純資産総額(A-B)	12,280,741,350	
元本	5,890,455,027	
次期繰越損益金	6,390,286,323	
(D) 受益権総口数	5,890,455,027口	
1万口当たり基準価額(C/D)	20,849円	

(注1) 当ファンドの期首元本額は3,937,722,314円、期中追加設定元本額は6,231,515,366円、期中一部解約元本額は4,278,782,653円です。

(注2) 1口当たり純資産額は2,0849円です。

○損益の状況 (2023年9月12日～2024年9月10日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	302	
受取利息	11,629	
支払利息	△ 11,327	
(B) 有価証券売買損益	395,877,504	
売買益	1,200,718,305	
売買損	△ 804,840,801	
(C) 信託報酬等	△ 50,630,786	
(D) 当期損益金(A+B+C)	345,247,020	
(E) 前期繰越損益金	293,731,050	
(F) 追加信託差損益金	5,892,679,173	
(配当等相当額)	(3,454,778,691)	
(売買損益相当額)	(2,437,900,482)	
(G) 計(D+E+F)	6,531,657,243	
(H) 収益分配金	△ 141,370,920	
次期繰越損益金(G+H)	6,390,286,323	
追加信託差損益金	5,892,679,173	
(配当等相当額)	(3,467,816,673)	
(売買損益相当額)	(2,424,862,500)	
分配準備積立金	497,607,150	

(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(141,191,160円)、費用控除後の有価証券売買等損益額(204,055,860円)、信託約款に規定する収益調整金(5,892,679,173円)および分配準備積立金(293,731,050円)より分配対象収益は6,531,657,243円(10,000口当たり11,088円)であり、うち141,370,920円(10,000口当たり1413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）	240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、投資信託約款に信託期間を無期限とする変更を行いました。(2023年12月9日実施)

運用報告書

親投資信託

しんきん日経平均マザーファンド

第9期

(決算日：2024年9月10日)

しんきん日経平均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上場株式のうち、日経平均株価（日経225）に採用された225銘柄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、日経225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（株価指数先物取引等を含む。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、我が国の金融商品取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引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新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ③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。 ④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。 ⑤外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価（日経225）		株式先物比率	株式組入比率	純資産額
	騰落率	中率	（ベンチマーク）騰落率	中率			
	円	%	円	%	%	%	百万円
5期(2020年9月10日)	14,032	11.2	23,235.47	8.6	77.4	22.5	5,852
6期(2021年9月10日)	18,603	32.6	30,381.84	30.8	98.3	1.0	6,004
7期(2022年9月12日)	17,788	△ 4.4	28,542.11	△ 6.1	90.9	8.6	9,827
8期(2023年9月11日)	20,697	16.4	32,467.76	13.8	97.3	2.4	10,826
9期(2024年9月10日)	23,487	13.5	36,159.16	11.4	87.9	12.1	16,365

(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		日経平均株価（日経225）		株式先物比率	株式組入比率
	騰落率	中率	（ベンチマーク）騰落率	中率		
(期首) 2023年9月11日	円	%	円	%	%	%
	20,697	—	32,467.76	—	97.3	2.4
9月末	20,450	△ 1.2	31,857.62	△ 1.9	91.4	9.7
10月末	19,812	△ 4.3	30,858.85	△ 5.0	95.1	4.9
11月末	21,496	3.9	33,486.89	3.1	93.0	7.0
12月末	21,515	4.0	33,464.17	3.1	94.0	6.0
2024年1月末	23,335	12.7	36,286.71	11.8	93.6	6.2
2月末	25,196	21.7	39,166.19	20.6	93.1	6.8
3月末	26,134	26.3	40,369.44	24.3	94.9	5.1
4月末	24,870	20.2	38,405.66	18.3	92.5	7.3
5月末	24,926	20.4	38,487.90	18.5	90.4	9.6
6月末	25,662	24.0	39,583.08	21.9	90.7	8.9
7月末	25,361	22.5	39,101.82	20.4	90.3	9.6
8月末	25,106	21.3	38,647.75	19.0	89.9	10.0
(期末) 2024年9月10日	23,487	13.5	36,159.16	11.4	87.9	12.1

(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。

※「日経平均株価（日経平均）」は、株式会社日本経済新聞社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、株式会社日本経済新聞社は、日経平均自体および日経平均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。「日経」および「日経平均」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属しています。「しんきん日経平均マザーファンド」は、委託会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および受益権の取引等に関して一切の責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、日経平均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、遅延または中断に関して、責任を負いません。株式会社日本経済新聞社は、日経平均の構成銘柄、計算方法、その他日経平均の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

○第9期の運用経過等（2023年9月12日～2024年9月10日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、日経平均株価（日経225）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。

当期は、日経平均株価が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。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＞

- ・国内企業の業績に改善が見られたこと。
- ・円安米ドル高が長期的に継続したこと。
- ・日銀が金融政策の修正を行ったものの、緩和的な金融政策の継続が示唆され、安心感が広がったこと。

＜下落要因＞

- ・米国の経済指標が市場予想を下回り、米国経済の先行きが懸念されたこと。
- ・イスラエルとハマスの紛争により、中東情勢が緊迫化したこと。

＜投資環境＞

(2023年9月～12月)

当期の日経平均株価は、32,467.76円（2023年9月11日終値）の水準から始まりました。9月の株式市場は、中旬にかけて底堅く推移したものの、下旬に開催された米連邦公開市場委員会（FOMC）で金融引締めを長期にわたって継続する方針が示され、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、米求人件数が市場予想を大きく上回ったことなどから米長期金利が上昇したことが嫌気され、日経平均株価は10月4日に期中安値となる30,526.88円まで下落しました。また、イスラエルとハマスの紛争が勃発したことによる中東情勢の緊迫化や日銀の金融政策修正などによる国内金利上昇により上値の重い展開となりました。11月は、米消費者物価指数（CPI）の伸びが鈍化し、米小売売上高が市場予想を上回ったことで、米国経済のソフトランディング（経済の軟着陸）期待が高まり、上昇しました。12月は、米インフレ鈍化を受けた米金利低下が支えとなりましたが、大規模緩和からの脱却を示唆する日銀の正副総裁の発言をきっかけに早期の金融政策修正観測が高まったことなどから、一進一退の動きとなりました。

(2024年1月～3月)

1月の株式市場は、新しい少額投資非課税制度（NISA）の開始や、日銀の金融政策修正観測が後退し、円安が進行したことなどが支えとなり、買いが優勢となりました。2月は、国内主要企業の2023年10-12月期決算が堅調な内容であったことや、米半導体大手の決算が市場予想を上回ったことなどをきっかけに、国内企業の業績も拡大するとの期待から、上昇しました。3月は、日銀が金融政策決定会合で大規模緩和の修正を決めるとの観測が高まったことを背景に、下落する場面もありました。ただ、金融政策決定会合でマイナス金利解除などの大規模緩和の修正は行われましたが、緩和的な金融政策を継続する姿勢が示されると、株価は反発しました。

(2024年4月～6月)

4月の株式市場は、米連邦準備制度理事会（FRB）高官から利下げに慎重な発言があったことや、中東情勢の緊迫化懸念が嫌気され、売りが優勢となりました。5月は、中旬にかけて、米国の利下げ観測が高まり、買いが優勢となりましたが、下旬において、日銀が早期に利上げや国債買入れ減額を決めるとの観測が高まり、売りが優勢となりました。6月は、中旬にかけて、米雇用統計で米労働市場の底堅さが示唆されたことで円安が進行した一方、フランスの政治情勢の混迷などを受けて海外投資家による日本株売りが増加したことにより一進一退の動きとなりました。しかし、下旬は、米ドル円が160円台まで上昇したことが支えとなり、買いが優勢となりました。

(2024年7月～当期末)

7月の株式市場は、米雇用統計で失業率が上昇するなど米国経済の減速を示唆する経済指標の発表が相次いだことで、市場の利下げ期待が高まったことが好感されたことから続伸し、7月11日に日経平均株価が期中高値かつ史上最高値となる42,224.02円まで上昇しました。8月から当期末にかけては、金融政策決定会合で日銀が利上げを決めたことに加えて、さらなる利上げの可能性を示唆したことや、米雇用統計で失業率が上昇したことで米景気後退懸念が高まったことが嫌気され、軟調な動きとなりました。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、その後も、一時的に持ち直す場面はありましたが、米ドル円が急落したことなどにより下落し、期末の日経平均株価は36,159.16円（2024年9月10日終値）で終了となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

当ファンドは、日経平均株価に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

現物株式は、日経平均株価採用銘柄の中から財務内容や信用リスクを考慮して、一部の銘柄を除く場合があります。当期末現在、財務内容や信用リスクに著しい問題が生じている企業はないものと判断し、225銘柄全てに投資を行っています。

<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、+13.5%となり、ベンチマークである日経平均株価の騰落率+11.4%を2.1%上回ることとなりました。

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、運用の基本方針に従い、日経平均株価採用銘柄のうち、200銘柄以上に投資を行うとともに、日経平均先物等も利用しながら株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価に連動する投資成果を目標として運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2023年9月12日～2024年9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) (先物・オプション)	円 2 (1) (1)	% 0.009 (0.004) (0.005)	(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)	0.001 (0.001)	(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	0.010	
期中の平均基準価額は、23,655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9月12日～2024年9月10日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,323 (597)	千円 5,702,740 ()	千株 777	千円 3,376,319

(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 別		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 18,941	百万円 17,269	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2023年9月12日～2024年9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	9,079,060千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,140,074千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.69

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月12日～2024年9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9月10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 (0.1%)			
ニッスイ	11	13	12,225
鉱業 (0.1%)			
INPEX	4.4	5.2	9,999
建設業 (1.7%)			
コムシスホールディングス	11	13	41,756
大成建設	2.2	2.6	16,772
大林組	11	13	24,134
清水建設	11	13	13,058
長谷工コーポレーション	2.2	2.6	4,867
鹿島建設	5.5	6.5	16,965
大和ハウス工業	11	13	59,293
積水ハウス	11	13	49,738
日揮ホールディングス	11	13	15,554
食料品 (3.2%)			
日清製粉グループ本社	11	13	25,194
明治ホールディングス	4.4	5.2	19,328
日本ハム	5.5	6.5	36,172

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サッポロホールディングス	2.2	2.6	20,061
アサヒグループホールディングス	11	13	72,553
キリンホールディングス	11	13	29,107
宝ホールディングス	11	—	—
キッコーマン	11	65	106,177
味の素	11	13	70,928
ニチレイ	5.5	6.5	29,185
日本たばこ産業	11	13	54,691
繊維製品 (0.1%)			
帝人	2.2	2.6	3,516
東レ	11	13	9,701
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	11	13	7,473
日本製紙	1.1	1.3	1,177
化学 (6.6%)			
クラレ	11	13	23,887
旭化成	11	13	13,377
レゾナック・ホールディングス	1.1	1.3	4,004

しんきん日経平均マザーファンド 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
住友化学	11	13	13	5,077
日産化学	11	13	13	64,155
東ソー	5.5	6.5	6.5	12,034
トクヤマ	2.2	2.6	2.6	6,727
デンカ	2.2	2.6	2.6	5,675
信越化学工業	55	65	65	362,245
三井化学	2.2	2.6	2.6	9,859
三菱ケミカルグループ	5.5	6.5	6.5	5,850
UBE	1.1	1.3	1.3	3,303
花王	11	13	13	91,221
D I C	1.1	1.3	1.3	4,066
富士フイルムホールディングス	11	39	39	148,590
資生堂	11	13	13	41,587
日東電工	11	13	13	145,015
医薬品 (6.6%)				
協和キリン	11	13	13	41,574
武田薬品工業	11	13	13	55,471
アステラス製薬	55	65	65	116,415
住友ファーマ	11	13	13	7,449
塩野義製薬	11	13	13	84,175
中外製薬	33	39	39	256,776
エーザイ	11	13	13	74,334
第一三共	33	39	39	205,725
大塚ホールディングス	11	13	13	106,028
石油・石炭製品 (0.2%)				
出光興産	4.4	26	26	26,143
ENEOSホールディングス	11	13	13	9,714
ゴム製品 (0.6%)				
横浜ゴム	5.5	6.5	6.5	20,260
ブリヂストン	11	13	13	69,875
ガラス・土石製品 (0.7%)				
A G C	2.2	2.6	2.6	11,447
日本板硝子	1.1	—	—	—
日本電気硝子	3.3	3.9	3.9	12,585
住友大阪セメント	1.1	—	—	—
太平洋セメント	1.1	1.3	1.3	3,933
東海カーボン	11	13	13	10,921
T O T O	5.5	6.5	6.5	31,200
日本碍子	11	13	13	24,043
鉄鋼 (0.1%)				
日本製鉄	1.1	1.3	1.3	3,927
神戸製鋼所	1.1	1.3	1.3	2,165

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
J F Eホールディングス	1.1	1.3	1.3	2,451
大平洋金属	1.1	—	—	—
非鉄金属 (0.9%)				
三井金属鉱業	1.1	1.3	1.3	5,694
三菱マテリアル	1.1	1.3	1.3	3,089
住友金属鉱山	5.5	6.5	6.5	22,964
DOWAホールディングス	2.2	2.6	2.6	12,412
古河電気工業	1.1	1.3	1.3	4,106
住友電気工業	11	13	13	29,757
フジクラ	11	13	13	50,271
金属製品 (0.0%)				
S U M C O	1.1	1.3	1.3	1,911
機械 (4.4%)				
日本製鋼所	2.2	2.6	2.6	10,816
オークマ	2.2	2.6	2.6	14,541
アマダ	11	13	13	18,791
ディスコ	—	2.6	2.6	87,438
S M C	1.1	1.3	1.3	76,388
小松製作所	11	13	13	47,554
住友重機械工業	2.2	2.6	2.6	8,418
日立建機	11	13	13	43,979
クボタ	11	13	13	26,104
荏原製作所	2.2	13	13	22,763
ダイキン工業	11	13	13	220,025
日本精工	11	13	13	9,278
NTN	11	13	13	3,315
ジェイテクト	11	13	13	13,988
三井E&S	1.1	—	—	—
日立造船	2.2	2.6	2.6	2,457
三菱重工業	1.1	13	13	22,054
I H I	1.1	1.3	1.3	8,125
電気機器 (24.5%)				
コニカミノルタ	11	13	13	5,401
ミネベアミツミ	11	13	13	34,268
日立製作所	2.2	13	13	42,900
三菱電機	11	13	13	29,016
富士電機	2.2	2.6	2.6	19,463
安川電機	11	13	13	56,576
ソシオネクスト	—	13	13	35,815
ニデック	8.8	10.4	10.4	59,217
オムロン	11	13	13	74,841
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2.2	2.6	2.6	7,504

しんきん日経平均マザーファンド ー第9期ー

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
日本電気	1.1	1.3	16,315			
富士通	1.1	13	36,244			
ルネサスエレクトロニクス	11	13	27,501			
セイコーエプソン	22	26	67,314			
パナソニック ホールディングス	11	13	15,775			
シャープ	11	13	11,689			
ソニーグループ	11	13	171,535			
TDK	33	39	348,582			
アルプスアルパイン	11	13	19,168			
横河電機	11	13	45,825			
アドバンテスト	22	104	613,496			
キーエンス	1.1	1.3	82,511			
レーザーテック	—	5.2	114,452			
カシオ計算機	11	13	15,080			
ファナック	55	65	247,000			
京セラ	22	104	175,916			
太陽誘電	11	13	38,798			
村田製作所	8.8	31.2	84,255			
SCREENホールディングス	2.2	5.2	51,407			
キヤノン	16.5	19.5	94,087			
リコー	11	13	19,435			
東京エレクトロン	33	39	868,140			
輸送用機器 (4.0%)						
デンソー	11	52	105,456			
川崎重工業	1.1	1.3	5,859			
日産自動車	11	13	5,232			
いすゞ自動車	5.5	6.5	13,279			
トヨタ自動車	55	65	162,467			
日野自動車	11	13	5,388			
三菱自動車工業	1.1	1.3	516			
マツダ	2.2	2.6	2,836			
本田技研工業	22	78	115,947			
スズキ	11	52	79,534			
SUBARU	11	13	32,643			
ヤマハ発動機	11	39	47,307			
精密機器 (3.9%)						
テルモ	44	104	270,140			
ニコン	11	13	18,544			
オリンパス	44	52	131,534			
HOYA	5.5	6.5	123,597			
シチズン時計	11	13	11,856			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
その他製品 (2.3%)						
バンダイナムコホールディングス	33	39	126,906			
TOPPANホールディングス	5.5	6.5	27,826			
大日本印刷	5.5	6.5	33,670			
ヤマハ	11	13	46,020			
任天堂	11	13	100,035			
電気・ガス業 (0.2%)						
東京電力ホールディングス	1.1	1.3	838			
中部電力	1.1	1.3	2,278			
関西電力	1.1	1.3	3,167			
東京瓦斯	2.2	2.6	9,198			
大阪瓦斯	2.2	2.6	9,154			
陸運業 (1.0%)						
東武鉄道	2.2	2.6	6,748			
東急	5.5	6.5	12,252			
小田急電鉄	5.5	6.5	11,420			
京王電鉄	2.2	2.6	9,526			
京成電鉄	5.5	6.5	29,718			
東日本旅客鉄道	1.1	3.9	11,208			
西日本旅客鉄道	1.1	2.6	7,131			
東海旅客鉄道	1.1	6.5	21,950			
ヤマトホールディングス	11	13	20,702			
NIPPON EXPRESSホールディングス	1.1	1.3	9,341			
海運業 (0.4%)						
日本郵船	3.3	3.9	18,057			
商船三井	3.3	3.9	18,283			
川崎汽船	3.3	11.7	22,458			
空運業 (0.2%)						
日本航空	11	13	31,596			
ANAホールディングス	1.1	1.3	3,898			
倉庫・運輸関連業 (0.2%)						
三菱倉庫	5.5	6.5	34,157			
情報・通信業 (11.0%)						
ネクソン	22	26	70,629			
メルカリ	—	13	32,045			
LINEヤフー	4.4	5.2	2,071			
トレンドマイクロ	11	13	111,072			
日本電信電話	110	130	19,526			
KDDI	66	78	376,272			
ソフトバンク	11	13	25,935			
東宝	1.1	1.3	7,745			
NTTデータグループ	55	65	152,295			

しんきん日経平均マザーファンド 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
コナミグループ	11	13	178,100
ソフトバンクグループ	66	78	611,754
卸売業 (3.2%)			
双日	1.1	1.3	4,223
伊藤忠商事	11	13	98,436
丸紅	11	13	29,419
豊田通商	11	39	98,436
三井物産	11	26	73,476
住友商事	11	13	41,509
三菱商事	11	39	111,598
小売業 (14.8%)			
J. フロント リテイリング	5.5	6.5	9,503
Z O Z O	—	13	61,711
三越伊勢丹ホールディングス	11	13	28,288
セブン&アイ・ホールディングス	11	39	85,098
高島屋	5.5	13	14,339
丸井グループ	11	13	33,163
イオン	11	13	51,025
ニトリホールディングス	—	6.5	145,210
ファーストリテイリング	33	39	1,701,960
銀行業 (0.7%)			
しずおかフィナンシャルグループ	11	13	16,575
コンコルディア・フィナンシャルグループ	11	13	10,328
あおぞら銀行	1.1	1.3	3,298
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11	13	18,791
りそなホールディングス	1.1	1.3	1,385
三井住友トラスト・ホールディングス	1.1	2.6	9,050
三井住友フィナンシャルグループ	1.1	1.3	11,746
千葉銀行	11	13	15,008
ふくおかフィナンシャルグループ	2.2	2.6	9,742
みずほフィナンシャルグループ	1.1	1.3	3,681
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	11	13	13,162

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
野村ホールディングス	11	13	10,119	
松井証券	11	—	—	
保険業 (1.2%)				
SOMPOホールディングス	2.2	7.8	25,357	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	3.3	11.7	37,440	
第一生命ホールディングス	1.1	1.3	4,877	
東京海上ホールディングス	16.5	19.5	99,645	
T&Dホールディングス	2.2	2.6	5,946	
その他金融業 (0.9%)				
クレディセゾン	11	13	44,642	
オリックス	11	13	44,590	
日本取引所グループ	11	13	43,381	
不動産業 (1.2%)				
東急不動産ホールディングス	11	13	12,970	
三井不動産	11	39	55,438	
三菱地所	11	13	30,225	
東京建物	5.5	6.5	15,073	
住友不動産	11	13	61,880	
サービス業 (4.7%)				
エムスリー	26.4	31.2	42,010	
ディー・エヌ・エー	3.3	3.9	6,407	
電通グループ	11	13	55,393	
オリエンタルランド	11	13	51,155	
サイバーエージェント	8.8	10.4	10,836	
楽天グループ	11	13	12,320	
リクルートホールディングス	33	39	332,358	
日本郵政	11	13	18,219	
セコム	11	13	142,870	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,396	3,539	14,379,154
	銘柄数 < 比率 >	225	225	< 87.9% >

(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	百万円	百万円
	日経225	1,976	—

(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

(2024年9月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	14,379,154	87.5
コール・ローン等、その他	2,054,725	12.5
投資信託財産総額	16,433,879	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9月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	16,433,638,053
コール・ローン等	1,839,995,285
株式(評価額)	14,379,154,530
未収入金	73,803,300
未収配当金	13,235,500
未収利息	11,644
差入委託証拠金	127,437,794
(B) 負債	68,559,200
未払金	38,559,200
未払解約金	30,000,000
(C) 純資産総額(A-B)	16,365,078,853
元本	6,967,705,093
次期繰越損益金	9,397,373,760
(D) 受益権総口数	6,967,705,093口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,487円

(注1) 当親投資信託の期首元本額は5,231,021,834円、期中追加設定元本額は4,656,115,809円、期中一部解約元本額は2,919,432,550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

しんきん日経平均オープン	5,219,385,971円
しんきんノーロード日経225	716,721,440円
しんきんDC日経225株式ファンド	571,937,037円
しんきん日米バランスファンド(分配抑制)(適格機関投資家限定)	129,793,111円
しんきん日米5資産分散ファンド21-11(適格機関投資家限定)	111,340,958円
しんきん日米5資産分散ファンド20-07(適格機関投資家限定)	101,815,489円
しんきん日米7資産バランスファンド21-04(適格機関投資家限定)	83,255,428円
しんきん国内株式インデックス(投資一任用)	33,455,659円

(注3) 1口当たり純資産額は2,3487円です。

○損益の状況 (2023年9月12日~2024年9月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	224,656,805
受取配当金	224,542,914
受取利息	359,375
その他収益金	30,476
支払利息	△ 275,960
(B) 有価証券売買損益	1,513,851,675
売買益	2,206,066,022
売買損	△ 692,214,347
(C) 先物取引等取引損益	46,751,810
取引益	445,682,660
取引損	△ 398,930,850
(D) 保管費用等	△ 208,320
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,785,051,970
(F) 前期繰越損益金	5,595,705,049
(G) 追加信託差損益金	6,014,284,191
(H) 解約差損益金	△3,997,667,450
(I) 計(E+F+G+H)	9,397,373,760
次期繰越損益金(I)	9,397,373,760

(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。