

○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・PHS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2期:2016年6月6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2016年6月6日に第2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

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

目 次

◇しんきんJ P X日経400オープン	頁
設定以来の運用実績	1
当期中の基準価額と市況等の推移	1
第2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	5
株式売買比率	6
利害関係人との取引状況等	6
組入資産の明細	6
投資信託財産の構成	6
資産、負債、元本及び基準価額の状況	7
損益の状況	7
分配金のお知らせ	7
◇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	8

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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		J P X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	み騰落	期中騰落	期中騰落			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2014年6月6日	10,000	—	—	11,237.89	—	—	—	1,003
1期(2015年6月5日)	13,283	180	34.6	15,049.51	33.9	96.0	3.6	1,850
2期(2016年6月6日)	10,724	0	△19.3	12,005.62	△20.2	94.4	5.3	3,255

(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。

(注5) 当初設定時の基準価額は当初元本（1万円当たり10,000円）として記載しています。（以下同じ。）

(注6) 当初設定時のJ P X日経インデックス400の値は、前営業日終値を表示しています。（以下同じ。）

○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		J P X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	%	%		%	%	%
2015年6月5日	13,283	—	—	15,049.51	—	96.0	3.6
6月末	13,002	△2.1	△2.2	14,716.19	△2.2	91.4	7.7
7月末	13,218	△0.5	△0.6	14,961.66	△0.6	92.2	7.4
8月末	12,203	△8.1	△8.2	13,813.71	△8.2	90.2	9.4
9月末	11,242	△15.4	△16.1	12,628.54	△16.1	92.3	7.3
10月末	12,442	△6.3	△7.0	14,000.71	△7.0	93.4	5.7
11月末	12,640	△4.8	△5.4	14,232.27	△5.4	96.6	2.9
12月末	12,396	△6.7	△7.3	13,951.93	△7.3	90.0	9.9
2016年1月末	11,469	△13.7	△14.2	12,917.43	△14.2	90.4	9.4
2月末	10,421	△21.5	△21.9	11,755.65	△21.9	90.4	9.3
3月末	10,881	△18.1	△19.2	12,161.79	△19.2	91.1	8.8
4月末	10,834	△18.4	△19.4	12,124.68	△19.4	97.2	2.6
5月末	11,121	△16.3	△17.3	12,453.26	△17.3	95.3	3.3
(期末)							
2016年6月6日	10,724	△19.3	△20.2	12,005.62	△20.2	94.4	5.3

(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。

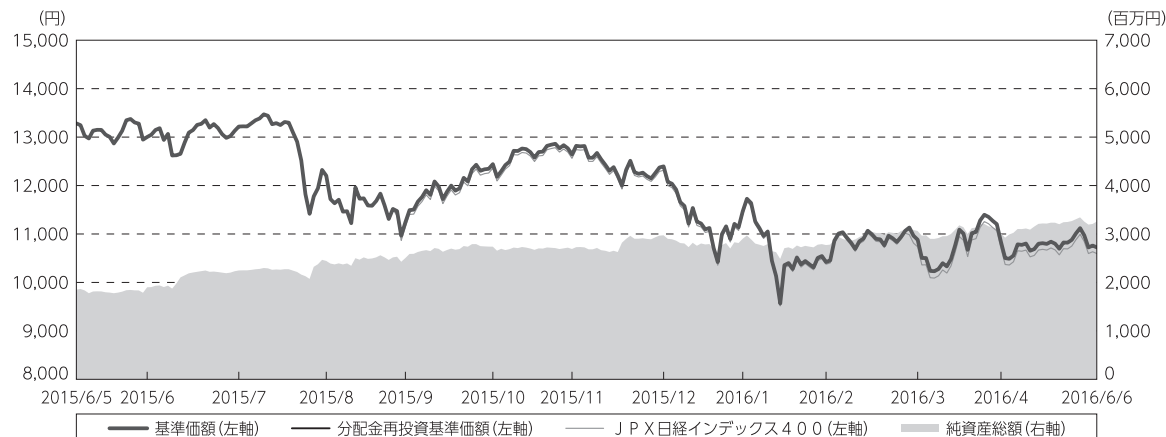
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(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、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下総称して「JPXグループ」という。）ならびに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グループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体および「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グループ」および「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、遅延または中断に関して、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グループ」および「日経」は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。

○第2期の運用経過等（2015年6月6日～2016年6月6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(2015年6月5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。

当期の基準価額は、13,283円(2015年6月5日現在)から始まりました。期首は、円高進行を背景に株式市場が軟調に推移したことで、基準価額は13,000円前後で推移しました。2015年7月下旬のギリシャ支援再開の合意以降、株式市場は堅調地合いとなり、2015年8月10日に基準価額は期中高値となる13,470円をつけました。その後、中国経済の先行き不透明感をはじめとした世界経済の減速への警戒感が強まったことで、株式市場は調整に転じ、基準価額は9月下旬に、一時11,000円を割り込みました。10月以降、中国経済への懸念が一旦後退したことや、欧州中央銀行(ECB)総裁が追加金融緩和を示唆したことで、株式市場は上昇基調となり、年末にかけて、基準価額は、12,000円台中心に推移しました。年明け以降、円高進行や原油安、中国経済に対する懸念から、株式市場は下落基調となり、基準価額は、2016年2月12日に期中安値となる9,565円まで下落しました。その後は、株式市場が戻りを試したことで、基準価額は一時11,000円台を回復しました。4月以降、株式相場が上値の重い展開となる中、基準価額はおおむね10,000円～11,000円で推移し、決算日である2016年6月6日は10,724円(分配金落ち後)をつけて、当期を終えました。

＜投資環境について＞

2015年6月の株式市場は、ギリシャ情勢への警戒感が強まったことに加え、為替市場で円高が急激に進んだことを嫌気し、軟調な動きになりました。6月末にかけては、ギリシャの支援協議に対する楽観的な見方が台頭し上昇する局面もありましたが、支援協議の決裂を受けて、J P X日経インデックス400（以下、「J P X日経400」という。）は14,000ポイント台後半まで下落しました。

2015年7～9月は、ギリシャ支援再開の合意を受けて、株式市場は堅調地合いで始まり、J P X日経400は15,000ポイント台前半まで上昇しました。しかし、8月中旬の中国の人民元切り下げを受け、中国経済の先行き不透明感をはじめとした世界経済の減速への警戒感が強まり、株式市場は急落しました。9月に米国の利上げ開始が見送られました。米国の金融政策の不透明感が払しょくされないことや、欧州自動車メーカーの排ガス規制をめぐる不正問題も重しとなり、9月末にかけては一段と下落し、J P X日経400は12,000ポイント台まで下落しました。

2015年10～12月は、中国経済への懸念が一旦後退したことから、株式市場は上昇して始まりました。10月下旬に、E C B総裁が追加金融緩和を示唆したことや、中国が追加の金融緩和を決めたことで株式市場は一段高となり、J P X日経400は14,000ポイント台を回復しました。ただし、12月に入り、E C Bの追加緩和が市場の期待を下回る内容であったことや、円高、原油安などから株式市場は上値の重い展開となり、年末にJ P X日経400は14,000ポイント台を割り込みました。

2016年1～3月は、年明けから円高進行や原油安、中国経済に対する懸念から、株式市場は下落して始まり、J P X日経400は一時12,000ポイント台を割り込みました。1月末に日銀がマイナス金利を導入したことを好感して、株式市場は一時的に大幅に上昇する局面もありましたが、2月に入っても下落基調に変化はなく、中旬に、J P X日経400は一時11,000ポイントを割り込みました。その後は、若干持ち直しの展開となり、3月中、J P X日経400は12,000ポイント台での推移となりました。

2016年4月～当期末は、景気減速や円高進行に伴う企業業績悪化懸念が台頭したことで、上値の重い展開となり、J P X日経400は12,000ポイントをはさんだ推移となりました。

当期中、J P X日経400は20.23%の下落率となりました。

＜運用概況＞

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＞

当ファンドは、J P X日経400に連動する投資成果を目指して運用を行いました。期中の売買につきましては、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れ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。

＜ベンチマークとの比較＞

決算日時点の基準価額の騰落率は△19.27%となり、同期間のJ P X日経400の騰落率である△20.23%を0.96ポイント上回りました。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、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。

<収益分配方針>

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、見送りとしました。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2期
	2015年6月6日～ 2016年6月6日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,537

(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J P X日経400マザーファンド>

引き続き、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。

○1万口当たりの費用明細

(2015年6月6日～2016年6月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 77	% 0.650	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(32)	(0.271)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(38)	(0.325)	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)	(6)	(0.054)	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	4	0.030	(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)	(3)	(0.029)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.000	(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)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	81	0.680	
期中の平均基準価額は、11,822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。

○売買及び取引の状況

(2015年6月6日～2016年6月6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	千口 2,177,266	千円 2,591,120	千口 585,370	千円 711,800

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年6月6日～2016年6月6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 4 0 0 マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	2,262,177千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,515,786千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.89	

(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

(2015年6月6日～2016年6月6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

(2016年6月6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 4 0 0 マザーファンド	千口 1,363,763	千口 2,955,660	千円 3,255,068

(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

(2016年6月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンド	千円 3,255,068	% 99.7
コール・ローン等、その他	10,270	0.3
投資信託財産総額	3,265,338	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 (2016年6月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,265,338,568
コール・ローン等	10,270,111
しんきんJPIX日経400マザーファンド(評価額)	3,255,068,457
(B) 負債	9,557,402
未払信託報酬	9,557,094
未払利息	28
その他未払費用	280
(C) 純資産総額(A-B)	3,255,781,166
元本	3,035,878,755
次期繰越損益金	219,902,411
(D) 受益権総口数	3,035,878,755口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,724円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,393,014,042円、期中追加設定元本額は2,474,031,785円、期中一部解約元本額は831,167,072円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.0724円です。

○損益の状況 (2015年6月6日～2016年6月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,208
受取利息	304
支払利息	△ 1,512
(B) 有価証券売買損益	△410,504,444
売買益	55,081,145
売買損	△465,585,589
(C) 信託報酬等	△ 17,228,230
(D) 当期損益金(A+B+C)	△427,733,882
(E) 前期繰越損益金	226,663,970
(F) 追加信託差損益金	420,972,323
(配当等相当額)	(502,958,546)
(売買損益相当額)	(△ 81,986,223)
(G) 計(D+E+F)	219,902,411
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	219,902,411
追加信託差損益金	420,972,323
(配当等相当額)	(507,961,078)
(売買損益相当額)	(△ 86,988,755)
分配準備積立金	262,407,138
繰越損益金	△463,477,050

(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(35,743,168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(507,961,078円)および分配準備積立金(226,663,970円)より分配対象収益は770,368,216円(10,000口当たり2,537円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

<約款変更のお知らせ>

2014年12月1日施行の制度改正に伴い、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2および投資信託協会の投資信託等の運用に関する規則の一部改正に基づき、投資信託約款に、信用リスク集中回避のための投資制限に係る条文を追加記載する変更を行いました。(2016年5月20日実施)

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 2 期

(決算日：2016年6月6日)

しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンドの第 2 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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		J P X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
	騰落	率	騰落	率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2014年6月6日	10,000	—	11,237.89	—	—	—	1,000
1期(2015年6月5日)	13,552	35.5	15,049.51	33.9	96.1	3.6	1,848
2期(2016年6月6日)	11,013	△18.7	12,005.62	△20.2	94.4	5.3	3,254

(注1) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

(注2) 当初設定時の基準価額は当初元本(1万口当たり10,000円)として記載しています。(以下同じ。)

(注3) 当初設定時のJ P X日経インデックス400の値は、前営業日終値を表示しています。(以下同じ。)

○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 (ベンチマーク)		株式 組入比率	株式 先物比率
	騰落	率	騰落	率		
(期首)	円	%		%	%	%
2015年6月5日	13,552	—	15,049.51	—	96.1	3.6
6月末	13,271	△2.1	14,716.19	△2.2	91.5	7.7
7月末	13,500	△0.4	14,961.66	△0.6	92.2	7.4
8月末	12,470	△8.0	13,813.71	△8.2	90.2	9.4
9月末	11,494	△15.2	12,628.54	△16.1	92.3	7.3
10月末	12,728	△6.1	14,000.71	△7.0	93.4	5.7
11月末	12,937	△4.5	14,232.27	△5.4	96.7	2.9
12月末	12,694	△6.3	13,951.93	△7.3	90.0	9.9
2016年1月末	11,751	△13.3	12,917.43	△14.2	90.4	9.4
2月末	10,683	△21.2	11,755.65	△21.9	90.4	9.3
3月末	11,161	△17.6	12,161.79	△19.2	91.1	8.8
4月末	11,118	△18.0	12,124.68	△19.4	97.2	2.6
5月末	11,419	△15.7	12,453.26	△17.3	95.3	3.3
(期末)						
2016年6月6日	11,013	△18.7	12,005.62	△20.2	94.4	5.3

(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。

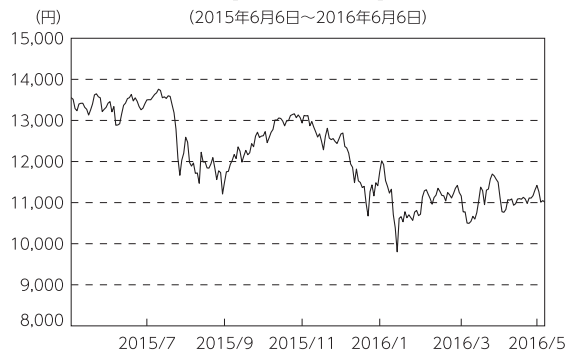
※「J P X日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下総称して「J P Xグループ」という。)ならびに株式会社日本経済新聞社(以下「日経」という。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「J P Xグループ」および「日経」は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「J P Xグループ」および「日経」は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、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グループ」および「日経」は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。

○第2期の運用経過等（2015年6月6日～2016年6月6日）

＜当期中の基準価額等の推移＞

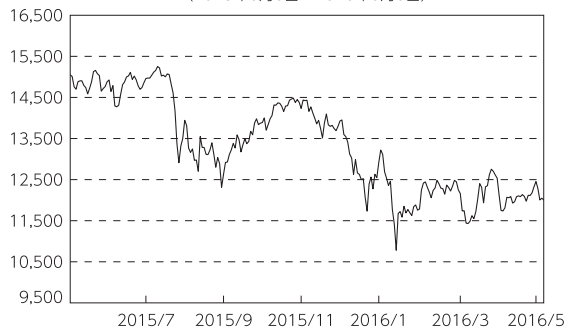
【基準価額の推移】

(2015年6月6日～2016年6月6日)



【ベンチマークの推移】

(2015年6月6日～2016年6月6日)



当期の基準価額は、13,552円（2015年6月5日現在）から始まりました。期首は、円高進行を背景に株式市場が軟調に推移したことで、基準価額は13,000円前後で推移しました。2015年7月下旬のギリシャ支援再開の合意以降、株式市場は堅調地合いとなり、2015年8月10日に基準価額は期中高値となる13,760円をつけました。その後、中国経済の先行き不透明感をはじめとした世界経済の減速への警戒感が強まったことで、株式市場は調整に転じ、基準価額は9月下旬に、一時11,000円台前半まで下落しました。10月以降、中国経済への懸念が一旦後退したことや、欧州中央銀行（ECB）総裁が追加金融緩和を示唆したことで、株式市場は上昇基調となり、年末にかけて、基準価額は12,000円台中心に推移しました。年明け以降、円高進行や原油安、中国経済に対する懸念から、株式市場は下落基調となり、基準価額は、2016年2月12日に期中安値となる9,802円まで下落しました。その後は、株式市場が戻りを試したことで、基準価額は11,000円台を回復しました。4月以降、株式相場が上値の重い展開となる中、基準価額は11,000円前後で推移し、決算日である2016年6月6日は11,013円をつけて、当期を終えました。

＜投資環境について＞

2015年6月の株式市場は、ギリシャ情勢への警戒感が強まったことに加え、為替市場で円高が急激に進んだことを嫌気し、軟調な動きになりました。6月末にかけては、ギリシャの支援協議に対する楽観的な見方が台頭し上昇する局面もありましたが、支援協議の決裂を受けて、J P X日経インデックス400（以下、「J P X日経400」という。）は14,000ポイント台後半まで下落しました。

2015年7～9月は、ギリシャ支援再開の合意を受けて、株式市場は堅調地合いで始まり、J P X日経400は15,000ポイント台前半まで上昇しました。しかし、8月中旬の中国の人民元切り下げを受け、中国経済の先行き不透明感をはじめとした世界経済の減速への警戒感が強まり、株式市場は急落しました。9月に米国の利上げ開始が見送られましたが、米国の金融政策の不透明感が払しょくされないことや、欧州自動車メーカーの排ガス規制をめぐる不正問題も重しとなり、9月末にかけては一段と下落し、J P X日経400は12,000ポイント台まで下落しました。

2015年10～12月は、中国経済への懸念が一旦後退したことから、株式市場は上昇して始まりました。10月下旬に、E C B総裁が追加金融緩和を示唆したことや、中国が追加の金融緩和を決めたことで株式市場は一段高となり、J P X日経400は14,000ポイント台を回復しました。ただし、12月に入り、E C Bの追加緩和が市場の期待を下回る内容であったことや、円高、原油安などから株式市場は上値の重い展開となり、年末にJ P X日経400は14,000ポイント台を割り込みました。

2016年1～3月は、年明けから円高進行や原油安、中国経済に対する懸念から、株式市場は下落して始まり、J P X日経400は一時12,000ポイント台を割り込みました。1月末に日銀がマイナス金利を導入したことを好感して、株式市場は一時的に大幅に上昇する局面もありましたが、2月に入っても下落基調に変化はなく、中旬に、J P X日経400は一時11,000ポイントを割り込みました。その後は、若干持ち直しの展開となり、3月中、J P X日経400は12,000ポイント台での推移となりました。

2016年4月～当期末は、景気減速や円高進行に伴う企業業績悪化懸念が台頭したことで、上値の重い展開となり、J P X日経400は12,000ポイントをはさんだ推移となりました。

当期中、J P X日経400は20.23%の下落率となりました。

＜運用概況＞

当ファンドは、J P X日経400に連動する投資成果を目指して運用を行いました。期中の売買につきましては、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れ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。

＜ベンチマークとの比較＞

決算日時点の基準価額の騰落率は $\Delta 18.74\%$ となり、同期間のJ P X日経の騰落率である $\Delta 20.23\%$ を1.49ポイント上回りました。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＞

当ファンドでは、引き続き、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。

○1万口当たりの費用明細

(2015年6月6日～2016年6月6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 4 (0) (3)	% 0.030 (0.001) (0.029)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	4	0.030	
期中の平均基準価額は、12,102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

(2015年6月6日～2016年6月6日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		1,423	2,021,278	219	240,899
		(△ 51)	()		

(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	百万円	百万円	百万円	百万円
内	3,072	2,925	—	—

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年6月6日～2016年6月6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	2,262,177千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,515,786千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.89

(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

(2015年6月6日～2016年6月6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

(2016年6月6日現在)

国内株式

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			
鉱業 (0.3%)						
国際石油開発帝石	6	12.4	10,489			
建設業 (3.3%)						
安藤・間	0.7	1.6	944			
コムシスホールディングス	0.5	1	1,760			
ミサワホーム	0.1	0.3	234			
大成建設	6	12	9,864			
大林組	—	7.1	7,817			
清水建設	—	7	6,755			
長谷工コーポレーション	1.4	2.8	3,228			
鹿島建設	5	11	7,634			
三井住友建設	—	8.9	845			
大東建託	0.4	0.9	14,265			
N I P P O	—	1	1,937			
住友林業	0.8	1.6	2,363			
大和ハウス工業	3.3	7	21,749			
積水ハウス	3.6	7.9	14,903			

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			
協和エクシオ	0.5	0.9	1,197			
日揮	1	2	3,188			
東芝プラントシステム	0.2	—	—			
千代田化工建設	1	2	1,474			
食料品 (5.4%)						
日清製粉グループ本社	1.2	—	—			
カルビー	0.4	0.9	3,645			
ヤクルト本社	0.6	1.3	6,760			
明治ホールディングス	0.3	1.4	14,308			
日本ハム	1	2	4,942			
アサヒグループホールディングス	2.3	4.4	15,721			
キリンホールディングス	4.6	9.6	17,505			
伊藤園	0.3	0.7	2,716			
キッコーマン	1	2	7,790			
味の素	3	5	12,745			
キュービー	0.6	1.2	3,636			
ニチレイ	1	3	2,808			

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2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
東洋水産	0.6	1.2	5,214
日清食品ホールディングス	0.5	1	5,670
日本たばこ産業	5.4	13.7	61,403
繊維製品 (0.5%)			
東レ	8	16	15,104
パルプ・紙 (0.2%)			
王子ホールディングス	4	9	3,915
大王製紙	—	1	1,160
化学 (6.8%)			
クラレ	1.8	3.5	4,963
旭化成	7	14	9,738
昭和電工	7	—	—
住友化学	—	16	7,712
日産化学工業	0.7	1.3	4,010
東ソー	3	6	3,216
東亜合成	1	—	—
デンカ	2	5	2,310
信越化学工業	1.9	4	24,632
エア・ウォーター	1	2	3,410
大陽日酸	1.4	1.7	1,637
日本パーカライジング	0.5	1.1	1,224
日本触媒	1	—	—
J S R	1	2.1	3,276
三菱ケミカルホールディングス	6.6	14.8	7,841
ダイセル	1.5	3.1	4,036
積水化学工業	2	5	7,125
日本ゼオン	1	2	1,624
アイカ工業	0.3	0.7	1,687
宇部興産	5	12	2,304
日立化成	0.5	1.1	2,249
日本化薬	1	1	1,109
日油	—	2	1,874
花王	2.9	5.9	34,762
日本ペイントホールディングス	0.9	1.7	5,168
関西ペイント	1	2.5	5,187
D I C	4	9	2,259
東洋インキS Cホールディングス	1	—	—
富士フィルムホールディングス	2.4	5.1	21,720
資生堂	1.9	4.2	11,823

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コーセー	—	0.4	3,724
シーズ・ホールディングス	0.1	0.3	703
小林製薬	0.2	0.3	2,709
日東電工	0.8	1.7	11,857
エフピコ	0.1	—	—
ニフコ	0.2	0.4	2,232
ユニ・チャーム	2.1	4.5	9,506
医薬品 (7.3%)			
協和発酵キリン	1	2.7	5,278
武田薬品工業	4	8.8	40,568
アステラス製薬	12.1	24.8	36,976
塩野義製薬	1.7	3.2	18,921
田辺三菱製薬	1.2	2.6	4,726
中外製薬	1.1	2.2	8,327
科研製薬	—	0.4	2,520
エーザイ	1.4	2.7	17,061
ロート製薬	0.5	1.1	1,928
小野薬品工業	0.5	5	24,000
久光製薬	0.3	0.7	4,242
持田製薬	0.1	0.2	1,718
参天製薬	1.9	4.1	6,785
ツムラ	0.3	0.7	1,910
沢井製薬	0.2	0.4	3,120
第一三共	3.6	7.4	18,448
キョーリン製薬ホールディングス	0.3	0.6	1,234
大塚ホールディングス	2.1	4.8	22,152
大正製薬ホールディングス	0.3	0.5	5,235
石油・石炭製品 (0.1%)			
昭和シェル石油	1	2.2	2,450
東燃ゼネラル石油	2	—	—
出光興産	0.5	—	—
J Xホールディングス	11.8	—	—
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	1	1.3	2,074
東洋ゴム工業	0.5	1	1,251
ブリヂストン	3.3	7.5	27,322
住友ゴム工業	0.8	2.1	3,282
ガラス・土石製品 (0.9%)			
旭硝子	5	12	7,536

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2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
日本電気硝子	2	—	—	
太平洋セメント	7	14	3,836	
TOTO	2	1.6	6,736	
日本碍子	—	3	7,038	
日本特殊陶業	0.9	1.9	3,782	
鉄鋼 (1.2%)				
新日鐵住金	45	10	21,215	
神戸製鋼所	—	41	4,018	
ジェイ エフ イー ホールディングス	2.7	6	8,796	
大同特殊鋼	2	—	—	
日立金属	1	2.5	3,017	
非鉄金属 (0.9%)				
三井金属鉱業	3	6	1,128	
三菱マテリアル	7	14	4,158	
住友金属鉱山	3	6	6,813	
DOWAホールディングス	1	3	1,914	
住友電気工業	4	8.9	13,781	
アサヒホールディングス	0.2	0.3	474	
金属製品 (0.3%)				
三和ホールディングス	—	2.2	2,008	
三協立山	—	0.3	442	
LIXILグループ	1.6	—	—	
リンナイ	0.2	0.4	3,776	
ジーテクト	0.1	—	—	
日本発條	0.9	2.1	1,896	
機械 (5.0%)				
日本製鋼所	2	—	—	
オーエスジー	0.5	1	1,932	
ディスコ	0.1	0.3	3,114	
ナブテスコ	0.6	1.2	3,253	
SMC	0.3	0.7	18,809	
小松製作所	5.2	10.8	20,277	
住友重機械工業	3	6	3,030	
日立建機	0.5	1	1,621	
クボタ	5	10.6	16,546	
荏原製作所	2	5	2,695	
ダイキン工業	1.5	3.1	27,562	
栗田工業	0.6	—	—	
椿本チエイン	1	1	754	

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
タダノ	—	1	952	
平和	0.2	0.6	1,315	
SANKYO	0.3	—	—	
ユニバーサルエンターテインメント	0.1	0.2	459	
セガサミーホールディングス	1.1	2.3	2,987	
T P R	0.1	0.3	799	
ホシザキ電機	0.3	0.6	6,276	
日本精工	2	4.3	3,951	
ジェイテクト	1.1	2.3	3,199	
不二越	1	2	722	
THK	0.7	1.4	2,788	
イーグル工業	—	0.3	426	
マキタ	0.7	1.4	9,660	
三菱重工業	17	38	16,153	
I H I	7	16	4,272	
電気機器 (12.3%)				
コニカミノルタ	2.4	5.3	4,674	
ブラザー工業	1.3	2.7	3,258	
ミネベア	2	3.4	2,808	
日立製作所	24	54	26,573	
東芝	21	—	—	
三菱電機	10	23	29,693	
富士電機	3	6	2,616	
安川電機	1.2	2.6	3,395	
日本電産	1.1	2.5	20,350	
オムロン	1.1	2.4	7,848	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2	—	—	
日本電気	—	29	7,250	
富士通	10	20	8,330	
沖電気工業	4	9	1,359	
セイコーエプソン	1.4	3.1	5,800	
ワコム	0.8	1.7	697	
パナソニック	12.4	24.1	22,774	
アンリツ	0.6	1.2	754	
富士通ゼネラル	—	1	2,063	
日立国際電気	—	0.5	725	
TDK	0.6	1.3	7,800	
アルプス電気	—	1.8	3,886	
ヒロセ電機	0.2	0.3	3,951	

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2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
日本航空電子工業	—	1	1,656
横河電機	1	2.1	2,436
日本光電工業	0.4	0.9	2,821
堀場製作所	0.2	0.4	1,932
キーエンス	0.2	0.5	34,250
シスメックス	0.8	1.6	12,688
スタンレー電気	0.7	1.5	3,517
カシオ計算機	1	2.1	3,429
ファナック	1.1	2.2	35,398
エンブレス	—	0.1	313
浜松ホトニクス	0.8	1.6	4,630
京セラ	1.7	3.5	18,235
村田製作所	1.1	2.2	27,654
小糸製作所	0.6	1.3	6,721
ミツバ	0.2	0.4	662
キャノン	5.9	11.4	35,590
リコー	3.1	6.8	6,269
東京エレクトロン	—	1.7	13,513
輸送用機器 (8.3%)			
トヨタ紡織	0.4	0.7	1,556
ユニプレス	0.2	0.4	785
豊田自動織機	0.9	1.9	8,616
デンソー	2.5	5.2	20,914
東海理化電機製作所	—	0.6	1,112
三井造船	4	8	1,240
川崎重工業	7	16	5,072
名村造船所	0.2	0.6	392
日産自動車	14.2	29.4	31,296
いすゞ自動車	3.2	6.1	7,869
トヨタ自動車	3.3	6.2	35,135
日野自動車	1.4	3	3,273
三菱自動車工業	3.7	8.4	4,762
NOK	0.5	1	1,875
KYB	1	—	—
大同メタル工業	0.1	—	—
カルソニックカンセイ	1	2	1,636
アイシン精機	0.9	2.1	9,492
マツダ	3	6.7	11,976
ダイハツ工業	1.2	2.5	3,682

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
本田技研工業	5.7	14.2	41,279
スズキ	2.1	4.1	11,303
富士重工業	3.4	6.7	26,418
ヤマハ発動機	1.5	3	5,307
エクセディ	0.1	0.3	741
豊田合成	0.3	0.8	1,630
日本精機	—	1	2,105
エフ・シー・シー	0.2	—	—
シマノ	0.4	0.8	13,328
テイ・エス テック	0.2	0.5	1,397
精密機器 (1.7%)			
テルモ	1.6	3.2	14,768
ニコン	1.9	3.9	5,951
トプコン	—	0.7	771
オリンパス	—	3.1	13,655
HOYA	2.4	4.8	17,870
セイコーホールディングス	—	1	375
その他製品 (0.7%)			
バンダイナムコホールディングス	1.1	2.2	6,050
パイロットコーポレーション	—	0.4	2,020
アシックス	1	2	4,840
ヤマハ	—	1.6	5,024
ビジョン	0.6	1.2	3,567
電気・ガス業 (0.8%)			
電源開発	0.7	1.8	4,917
東京瓦斯	12	24	10,377
大阪瓦斯	10	22	8,872
陸運業 (5.8%)			
東武鉄道	5	11	6,061
相鉄ホールディングス	2	5	3,190
東京急行電鉄	6	12	11,124
小田急電鉄	3	7	8,246
京王電鉄	3	6	5,670
京成電鉄	2	3	4,383
東日本旅客鉄道	1.9	3.9	38,633
西日本旅客鉄道	1	2	13,860
東海旅客鉄道	0.9	1.9	36,157
西日本鉄道	2	4	2,268
近鉄グループホールディングス	10	21	9,156

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2期ー

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
阪急阪神ホールディングス	7	14	10,668
南海電気鉄道	—	6	3,642
京阪ホールディングス	3	6	4,428
名古屋鉄道	5	10	5,630
日本通運	4	8	3,632
ヤマトホールディングス	1.8	3.8	8,548
山九	1	3	1,764
日立物流	0.2	—	—
海運業 (0.1%)			
日本郵船	—	19	3,857
空運業 (0.4%)			
ANAホールディングス	20	39	12,039
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
上組	1	—	—
近鉄エクスプレス	0.1	0.4	525
情報・通信業 (8.8%)			
グリー	0.6	1.3	822
ネクソン	—	2	3,528
ティーガイア	0.1	0.2	312
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2.6	4.9	1,509
インターネットイニシアティブ	0.2	—	—
野村総合研究所	0.6	1.5	6,067
フジ・メディア・ホールディングス	1	2.2	2,862
オービック	0.3	0.7	4,165
ヤフー	7.2	14.9	7,807
トレンドマイクロ	0.5	1	3,750
日本オラクル	0.2	0.3	1,821
伊藤忠テクノソリューションズ	0.2	0.5	1,240
大塚商会	0.3	0.6	3,024
USEN	0.5	0.9	320
エイベックス・グループ・ホールディングス	0.2	0.4	521
日本テレビホールディングス	0.9	1.9	3,608
日本電信電話	3.2	12.5	59,262
KDDI	10.2	19	59,945
光通信	0.1	0.3	2,676
NTTドコモ	7.7	15.6	43,360
GMOインターネット	0.3	0.8	1,016
東宝	0.7	1.5	4,437
エヌ・ティ・ティ・データ	0.6	1.3	7,111

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SCSK	0.2	0.5	1,992
コナミホールディングス	0.4	—	—
ソフトバンクグループ	2.9	8.3	50,571
卸売業 (4.3%)			
双日	6.7	13.1	3,301
アルフレッサホールディングス	1.2	2.6	6,008
シブヘルスケアホールディングス	0.2	0.4	1,248
三菱食品	0.1	—	—
第一興商	0.2	0.5	2,115
メディカルホールディングス	1	2.1	3,880
伊藤忠商事	8.4	16.4	21,582
丸紅	8.8	20.5	10,284
豊田通商	1.1	2.3	5,416
兼松	2	4	700
三井物産	8.5	18.8	24,026
日立ハイテクノロジーズ	0.3	0.7	2,177
山善	0.4	—	—
住友商事	5.9	13.1	13,807
三菱商事	7.7	15.6	29,897
岩谷産業	1	2	1,224
東邦ホールディングス	0.3	0.7	1,908
サンリオ	0.3	0.6	1,227
日鉄住金物産	1	2	746
ミスミグループ本社	0.4	2.3	3,992
小売業 (4.8%)			
ローソン	0.4	0.8	7,128
エービーシー・マート	0.1	0.3	2,016
ゲオホールディングス	0.2	0.3	459
日本マクドナルドホールディングス	0.4	—	—
パル	0.1	—	—
セリア	0.1	0.2	1,484
Monotaro	0.2	0.7	2,698
J・フロントリテイリング	1.3	2.6	3,198
マツモトキヨシホールディングス	0.2	0.4	2,348
スタートトゥデイ	0.3	0.6	3,126
三越伊勢丹ホールディングス	2	4.1	4,227
ウエルシアホールディングス	0.1	0.2	1,264
コスモス薬品	0.1	0.1	2,052
セブン&アイ・ホールディングス	4.2	8.7	40,759

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2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
ツルハホールディングス	0.2	0.5	5,745
良品計画	0.1	0.2	5,228
ドンキホーテホールディングス	0.3	1.3	4,842
V Tホールディングス	0.4	0.9	453
ユナイテッドアローズ	0.1	0.3	933
スギホールディングス	0.2	0.4	2,352
ファミリーマート	0.3	0.6	3,588
日本瓦斯	—	0.3	708
AOK I ホールディングス	0.2	0.5	589
コメリ	0.2	—	—
しまむら	0.1	0.2	2,786
高島屋	1	3	2,259
イオン	4	8.6	14,267
ユニグループ・ホールディングス	1	—	—
イズミ	0.2	0.4	1,666
ヤオコー	—	0.2	958
ケーズホールディングス	0.2	0.8	1,445
アインホールディングス	0.1	0.3	2,235
ヤマダ電機	3.9	—	—
ニトリホールディングス	0.4	0.9	10,098
王将フードサービス	0.1	—	—
アークス	0.2	—	—
パローホールディングス	0.2	0.4	1,167
ファーストリテイリング	0.2	0.4	12,036
サンドラッグ	0.2	0.4	3,732
銀行業 (6.2%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	14	6,587
新生銀行	9	18	2,898
あおぞら銀行	7	13	4,693
三菱UFJフィナンシャル・グループ	34.3	63.8	33,380
りそなホールディングス	11.7	24.3	9,683
三井住友トラスト・ホールディングス	22	43	15,574
三井住友フィナンシャルグループ	4.7	10.9	36,547
西日本シティ銀行	4	7	1,456
千葉銀行	4	8	4,304
横浜銀行	7	—	—
常陽銀行	4	8	3,256
群馬銀行	2	5	2,190
ふくおかフィナンシャルグループ	4	9	3,348

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡銀行	3	6	4,698
十六銀行	2	3	882
スルガ銀行	1.1	2	4,902
八十二銀行	2	5	2,415
ほくほくフィナンシャルグループ	7	14	1,848
広島銀行	3	6	2,322
中国銀行	0.9	2	2,438
伊予銀行	1.4	3	2,070
セブン銀行	3.4	7.8	2,956
みずほフィナンシャルグループ	103.8	215.4	35,885
山口フィナンシャルグループ	1	3	3,153
北洋銀行	1.5	3.2	944
京葉銀行	1	2	806
証券、商品先物取引業 (1.2%)			
SBIホールディングス	—	2.5	2,740
ジャフコ	—	0.3	912
大和証券グループ本社	9	19	11,489
野村ホールディングス	20.5	40.1	17,796
岡三証券グループ	1	2	1,020
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1.2	2.4	1,188
松井証券	0.5	1	925
カブドットコム証券	—	1.8	646
保険業 (2.9%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	—	4.6	13,381
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	—	6.2	18,668
ソニーフィナンシャルホールディングス	1	2	2,670
第一生命保険	6.4	13.3	17,775
東京海上ホールディングス	4.1	8.4	30,172
T&Dホールディングス	3.6	7.6	7,736
その他金融業 (1.5%)			
クレディセゾン	0.8	1.6	3,240
芙蓉総合リース	0.1	0.2	898
興銀リース	0.2	0.4	777
東京センチュリーリース	0.2	0.5	1,797
Jトラスト	0.3	—	—
アイフル	1.7	—	—
リコーリース	0.1	—	—
イオンフィナンシャルサービス	0.7	1.4	3,318
アコム	2	4.2	2,373

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第2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
日立キャピタル	0.2	0.5	1,232
オリックス	7.1	14.7	21,564
三菱UFJリース	2.6	5.3	2,374
日本取引所グループ	1.5	6.1	8,131
不動産業 (3.4%)			
ヒューリック	1.9	4.3	4,652
野村不動産ホールディングス	0.6	1.4	2,706
プレサンスコーポレーション	—	0.1	387
東急不動産ホールディングス	2.6	5	3,585
飯田グループホールディングス	0.7	1.9	4,269
パーク24	0.5	1	3,445
三井不動産	5	11	28,759
三菱地所	7	15	30,412
東京建物	—	2.3	3,102
住友不動産	2	5	14,720
大京	2	4	664
レオパレス21	1.1	2.5	1,770
スターツコーポレーション	—	0.3	679
住友不動産販売	0.1	0.2	424
タカラレーベン	0.4	0.9	672
イオンモール	0.6	1.3	1,909
エヌ・ティ・ティ都市開発	0.6	1.3	1,411
サービス業 (3.5%)			
ミクシィ	—	0.4	1,764
日本M&Aセンター	—	0.3	2,094
アコーディア・ゴルフ	0.4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
テンブホールディングス	0.2	1.5	2,613	
クックパッド	—	0.5	713	
総合警備保障	—	0.7	3,668	
カカコム	0.7	1.6	3,347	
エムスリー	0.9	1.9	6,431	
ディー・エヌ・エー	0.5	1	2,271	
博報堂DYホールディングス	1.5	3	4,152	
電通	1.2	2.5	13,550	
みらかホールディングス	0.3	0.6	2,766	
オリエンタルランド	1.1	2.4	17,198	
リゾートトラスト	0.4	0.9	2,028	
りらいあコミュニケーションズ	0.2	—	—	
ユー・エス・エス	1.3	2.7	4,792	
サイバーエージェント	0.3	0.6	3,186	
楽天	4.6	10.3	11,948	
リロ・ホールディング	—	0.1	1,549	
エイチ・アイ・エス	0.2	0.4	1,222	
カナモト	—	0.3	725	
セコム	1	2.3	19,163	
ベネッセホールディングス	0.4	0.7	1,761	
イオンデイライト	0.1	0.2	629	
合 計	株 数・金 額	1,088	2,240	3,072,194
	銘柄数<比率>	390	398	<94.4%>

(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。

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	百万円
		173	—

(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

(2016年6月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,072,194	94.4
コール・ローン等、その他	183,935	5.6
投資信託財産総額	3,256,129	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 (2016年6月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,255,115,752
コール・ローン等	157,608,883
株式(評価額)	3,072,194,130
未収配当金	20,037,739
差入委託証拠金	5,275,000
(B) 負債	153,577
未払金	149,320
未払利息	436
その他未払費用	3,821
(C) 純資産総額(A-B)	3,254,962,175
元本	2,955,660,090
次期繰越損益金	299,302,085
(D) 受益権総口数	2,955,660,090口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,013円

(注1) 当親投資信託の期首元本額は1,363,763,563円、期中追加設定元本額は2,177,266,980円、期中一部解約元本額は585,370,453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、しんきんJ P X日経400オープン2,955,660,090円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1.1013円です。

○損益の状況 (2015年6月6日～2016年6月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	52,972,606
受取配当金	52,940,067
受取利息	11,997
その他収益金	36,022
支払利息	△ 15,480
(B) 有価証券売買損益	△484,955,095
売買益	88,342,625
売買損	△573,297,720
(C) 先物取引等取引損益	△ 40,480,284
取引益	43,488,287
取引損	△ 83,968,571
(D) 保管費用等	△ 3,821
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△472,466,594
(F) 前期繰越損益金	484,345,206
(G) 追加信託差損益金	413,853,020
(H) 解約差損益金	△126,429,547
(I) 計(E+F+G+H)	299,302,085
次期繰越損益金(I)	299,302,085

(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。

<約款変更のお知らせ>

2014年12月1日施行の制度改正に伴い、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2および投資信託協会の投資信託等の運用に関する規則の一部改正に基づき、投資信託約款に、信用リスク集中回避のための投資制限に係る条文を追加記載する変更を行いました。(2016年5月20日実施)