

○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／債券／インデックス型
信託期間	無期限
主要投資対象	「しんきん国内債券インデックスマザーファンド」(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、直接公社債等に投資する場合があります。
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、わが国の公社債に投資し、ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数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、わ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	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利子・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、分配を行わない場合があります。

運用報告書(全体版)

しんきん国内債券インデックス (投資一任用)

決算日

(第1期:2022年11月21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「しんきん国内債券インデックス(投資一任用)」は2022年11月21日に第1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>

■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。

目 次

◇しんきん国内債券インデックス（投資一任用）	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1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
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	8
◇親投資信託の運用報告書	
しんきん国内債券インデックスマザーファンド	9

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			ダイワ・ボンド・インデックス総合 [※]		債券組入比率	純資産額
	(分配落)	税 込 配 分	期 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率		
(設定日)	円	円	%	ポイント	%	%	百万円
2022年2月18日	10,000	—	—	522.60	—	—	0.1
1期(2022年11月21日)	9,779	0	△2.2	512.30	△2.0	98.5	5

(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、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) 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。）

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス総合 [※]		債券組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
(設定日)	円	%	ポイント	%	%
2022年2月18日	10,000	—	522.60	—	—
2月末	10,036	0.4	524.78	0.4	98.7
3月末	10,004	0.0	523.36	0.1	98.9
4月末	9,972	△0.3	522.06	△0.1	98.9
5月末	9,956	△0.4	521.10	△0.3	98.8
6月末	9,860	△1.4	516.25	△1.2	99.0
7月末	9,923	△0.8	519.64	△0.6	99.0
8月末	9,902	△1.0	518.54	△0.8	98.8
9月末	9,797	△2.0	513.01	△1.8	98.8
10月末	9,783	△2.2	512.42	△1.9	98.5
(期 末)					
2022年11月21日	9,779	△2.2	512.30	△2.0	98.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

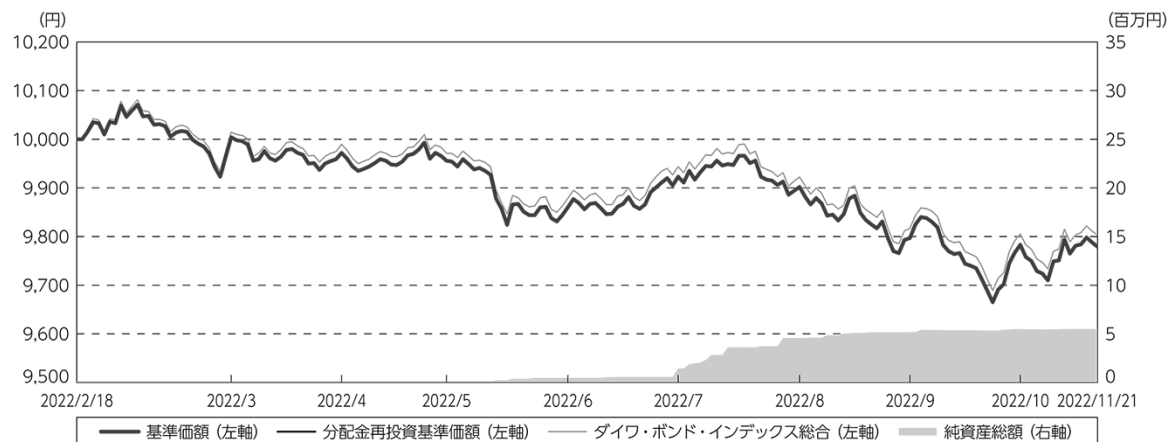
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

※「ダイワ・ボンド・インデックス総合」とは、日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定するように設計された指数で、株式会社大和総研が計算、公表しています。算出対象範囲が広く、日本の債券市場全体の動きを代表しています。債券価格の変動に加えて、日々のクーポン収入も加味されて算出されます。

※ダイワ・ボンド・インデックスに関する著作権等知的財産権は大和証券株式会社および株式会社大和総研に帰属いたします。なお、大和証券株式会社および株式会社大和総研は当ファンドの運用と何ら関係はありません。

○第1期の運用経過等（2022年2月18日～2022年11月21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) ダイワ・ボンド・インデックス総合は、設定時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、ダイワ・ボンド・インデックス総合です。

<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「しんきん国内債券インデックスマザーファンド」の受益証券への投資を通じて、ダイワ・ボンド・インデックス総合指数（DBI総合指数）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>

- ・ウクライナ情勢への警戒が強まる中、リスク回避姿勢による国債の需要が増加したこと。
- ・日銀が長期金利の上限を0.25%とする金融緩和政策を堅持したこと。
- ・欧米中央銀行の金融引締めで世界景気が減速するとの懸念から、安全資産とされる国債の買いが優勢になったこと。
- ・日銀が金額無制限で長期国債を買い入れる指値オペレーション（公開市場操作）を連日実施したこと。

<下落要因>

- ・米国消費者物価指数（CPI）の伸びが加速したこと。
- ・欧州中央銀行（ECB）が量的金融緩和の縮小を加速する方針を示したこと。
- ・日銀が金融政策を修正すると観測されたこと。
- ・米金融引締めが長期化するとの警戒感が強まり米国金利が上昇したこと。

<投資環境>

(2022年2月～3月)

当期間の長期金利(新発10年国債利回り)は、一旦0.2%を割り込む水準まで低下したものの、その後0.25%まで上昇しました。ウクライナ情勢への警戒が強まる中、リスク回避姿勢による国債需要増を受け長期金利は3月上旬には0.13%まで低下しましたが、その後2月の米CPIの伸びが加速したことや、ECBが量的金融緩和の縮小を加速する方針を示したことなどから、長期金利は上昇に転じました。

(2022年4月～7月中旬)

当期間の長期金利は日銀が長期金利の上限としている0.25%近辺での推移が続きました。日銀が金融政策を修正するとの観測から、国内の長期金利は一時的に上限を上回る0.265%まで上昇しましたが、結果的に日銀が長期金利の上限を0.25%とする金融緩和と政策を堅持したことを受け長期金利は0.25%近辺でもみ合う展開となりました。

(2022年7月下旬～8月)

当期間の長期金利は欧米中央銀行の金融引締めで世界景気が減速するとの懸念から、安全資産とされる国債は買いが優勢になり、長期金利は3月以来となる0.2%を下回る水準まで低下しました。その後はジャクソンホール会議でのパウエル米連邦準備制度理事会(FRB)議長の講演で米金融引締めが長期化するとの警戒が強まり米国金利が上昇したことから、国内の長期金利も押し上げられる動きとなり、再度0.2%台前半まで上昇しました。

(2022年9月～11月)

当期間の長期金利は日銀が長期金利の上限としている0.25%近辺での推移が続きました。

欧州中央銀行が通常の3倍となる0.75%の利上げを決めたことや、8月の米CPIの伸びが市場予想を上回り、米金融引締めへの警戒が広がったことから、国内の長期金利は日銀が許容する上限の0.25%まで上昇し、その後は日銀が金額無制限で長期国債を買い入れる指値オペレーション(公開市場操作)を連日実施したことから0.25%に張り付く動きが続きました。

<当ファンドのポートフォリオ>

親投資信託である「しんきん国内債券インデックスマザーファンド」の受益証券への投資を通じ、DBI総合指数に連動する投資成果を目指して運用を行いました。

●しんきん国内債券インデックスマザーファンド

当期のベンチマークに対する修正デュレーション(金利感応度)および債券種別構成の調整は、以下のように行いました。

①修正デュレーション(金利感応度)

当期を通じてベンチマーク対比中立で調整しました。調整範囲はおおむねベンチマーク対比で $\Delta 0.3 \sim +0.3$ 年程度としました。

②債券種別構成

当期における国債以外の債券については、期を通じて、ほぼベンチマーク対比中立の範囲内で調整しました。

なお、2022年11月21日時点におけるポートフォリオの修正デュレーションは9.05年、最終利回りは0.42%となっています。

＜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は、△2.2%となりました。ベンチマークであるDBI総合指数の騰落率の△2.0%を下回りました。この差は、主に信託報酬、追加設定・解約等の要因によるものです。

＜分配金＞

当期の収益分配金については、基準価額水準等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1期
	2022年2月18日～ 2022年11月21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	19

(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「しんきん国内債券インデックスマザーファンド」の受益証券への投資を通じ、DBI総合指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。

●しんきん国内債券インデックスマザーファンド

わが国の公社債に投資し、DBI総合指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年2月18日～2022年11月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.138	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(11)	(0.113)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(1)	(0.008)	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 ）	(2)	(0.017)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.010	(b) 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 ）	(1)	(0.010)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	15	0.148	
期中の平均基準価額は、9,914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。

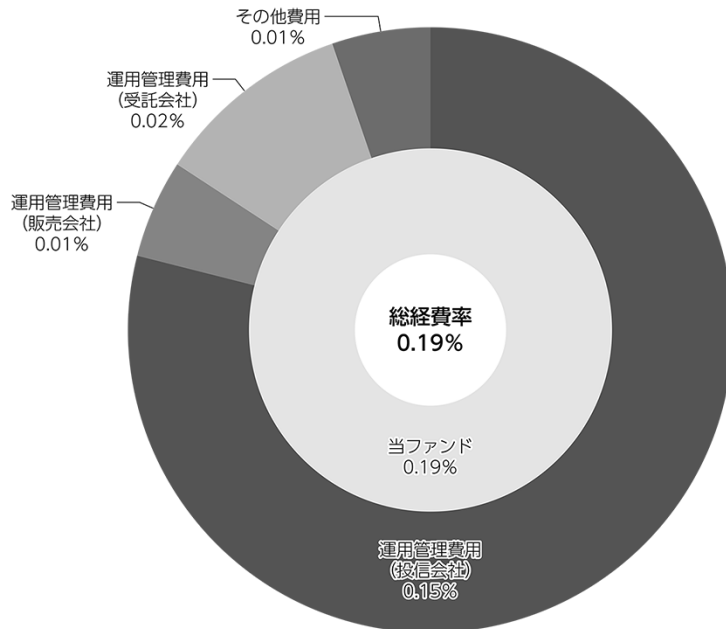
(注3) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.19%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2月18日～2022年11月21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
しんきん国内債券インデックスマザーファンド	千口 5,563	千円 5,516	千口 4	千円 4

(注) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年2月18日～2022年11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。

○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2月18日～2022年11月21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2月18日～2022年11月21日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年11月21日現在)

親投資信託残高

銘柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
しんきん国内債券インデックスマザーファンド	千口 5,558	千円 5,444

(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

(2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
しんきん国内債券インデックスマザーファンド	千円 5,444	% 99.1
コール・ローン等、その他	51	0.9
投資信託財産総額	5,495	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,495,706
コール・ローン等	51,461
しんきん国内債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,444,245
(B) 負債	2,462
未払信託報酬	2,382
その他未払費用	80
(C) 純資産総額(A-B)	5,493,244
元本	5,617,604
次期繰越損益金	△ 124,360
(D) 受益権総口数	5,617,604口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,779円

(注1) 当ファンドの設定時元本額は100,000円、期中追加設定元本額は5,606,867円、期中一部解約元本額は89,263円です。

(注2) 1口当たり純資産額は0.9779円です。

○損益の状況 (2022年2月18日～2022年11月21日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 66,489
売買益	717
売買損	△ 67,206
(B) 信託報酬等	△ 2,926
(C) 当期損益金(A+B)	△ 69,415
(D) 追加信託差損益金	△ 54,945
(売買損益相当額)	(△ 54,945)
(E) 計(C+D)	△124,360
(F) 収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	△124,360
追加信託差損益金	△ 54,945
(配当等相当額)	(2,904)
(売買損益相当額)	(△ 57,849)
分配準備積立金	8,124
繰越損益金	△ 77,539

(注1) 損益の状況の中で(A)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(B)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(D)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(8,124円)、費用控除後の有価証券等損益額(0.0円)、および信託約款に規定する収益調整金(2,904円)より分配対象収益は11,028円(10,000口当たり19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
----------------	----

運用報告書

親投資信託

しんきん国内債券インデックスマザーファンド

第1期

(決算日：2022年11月21日)

しんきん国内債券インデックスマザーファンドの第1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	わが国の公社債を主要投資対象とします。
運用方針	①主としてわが国の公社債に投資し、ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数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公社債の組入比率は、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、わ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株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑦外貨建資産への投資は行いません。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス総合*		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	(ベンチマーク) 期 騰 落	中 率			
(設定日) 2022年2月18日	円 10,000	% —	ポイント 522.60	% —		% —	百万円 1,997
1期(2022年11月21日)	9,795	△2.1	512.30	△2.0	99.4		1,958

(注) 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。）

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス総合*		債 組 入 比	券 率
	騰 落	率	(ベンチマーク) 騰 落	率		
(設定日) 2022年2月18日	円 10,000	% —	ポイント 522.60	% —		% —
2月末	10,037	0.4	524.78	0.4	99.2	
3月末	10,007	0.1	523.36	0.1	99.4	
4月末	9,978	△0.2	522.06	△0.1	99.3	
5月末	9,964	△0.4	521.10	△0.3	99.3	
6月末	9,870	△1.3	516.25	△1.2	99.2	
7月末	9,934	△0.7	519.64	△0.6	99.1	
8月末	9,915	△0.9	518.54	△0.8	98.9	
9月末	9,811	△1.9	513.01	△1.8	99.3	
10月末	9,798	△2.0	512.42	△1.9	99.2	
(期 末) 2022年11月21日	9,795	△2.1	512.30	△2.0	99.4	

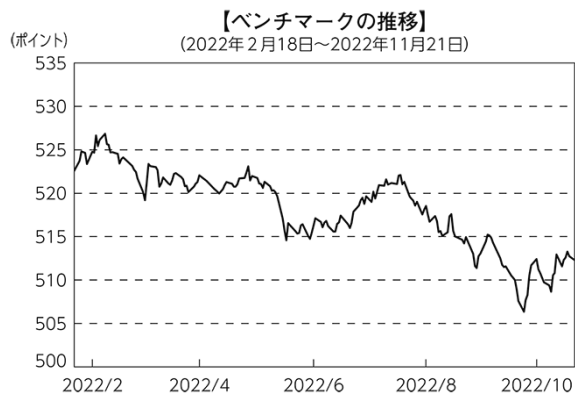
(注) 騰落率は設定日比です。

※「ダイワ・ボンド・インデックス総合」とは、日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定するように設計された指数で、株式会社大和総研が計算、公表しています。算出対象範囲が広く、日本の債券市場全体の動きを代表しています。債券価格の変動に加えて、日々のクーポン収入も加味されて算出されます。

※ダイワ・ボンド・インデックスに関する著作権等知的財産権は大和証券株式会社および株式会社大和総研に帰属いたします。なお、大和証券株式会社および株式会社大和総研は当ファンドの運用と何ら関係はありません。

○第1期の運用経過等（2022年2月18日～2022年11月21日）

<当期中の基準価額等の推移>



当ファンドは、わが国の公社債に投資し、ダイワ・ボンド・インデックス総合指数（DBI総合指数）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

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>

- ・ウクライナ情勢への警戒が強まる中、リスク回避姿勢による国債の需要が増加したこと。
- ・日銀が長期金利の上限を0.25%とする金融緩和政策を堅持したこと。
- ・欧米中央銀行の金融引締めで世界景気が減速するとの懸念から、安全資産とされる国債の買いが優勢になったこと。
- ・日銀が金額無制限で長期国債を買い入れる指値オペレーション（公開市場操作）を連日実施したこと。

<下落要因>

- ・米国消費者物価指数（CPI）の伸びが加速したこと。
- ・欧州中央銀行（ECB）が量的金融緩和の縮小を加速する方針を示したこと。
- ・日銀が金融政策を修正すると観測されたこと。
- ・米金融引締めが長期化するとの警戒感が強まり米国金利が上昇したこと。

＜投資環境＞

(2022年2月～3月)

当期間の長期金利（新発10年国債利回り）は、一旦0.2%を割り込む水準まで低下したものの、その後0.25%まで上昇しました。ウクライナ情勢への警戒が強まる中、リスク回避姿勢による国債需要増を受け長期金利は3月上旬には0.13%まで低下しましたが、その後2月の米CPIの伸びが加速したことや、ECBが量的金融緩和の縮小を加速する方針を示したことなどから、長期金利は上昇に転じました。

(2022年4月～7月中旬)

当期間の長期金利は日銀が長期金利の上限としている0.25%近辺での推移が続きました。日銀が金融政策を修正するとの観測から、国内の長期金利は一時的に上限を上回る0.265%まで上昇しましたが、結果的に日銀が長期金利の上限を0.25%とする金融緩和政策を堅持したことを受け長期金利は0.25%近辺でもみ合う展開となりました。

(2022年7月下旬～8月)

当期間の長期金利は欧米中央銀行の金融引締めで世界景気が減速するとの懸念から、安全資産とされる国債は買いが優勢になり、長期金利は3月以来となる0.2%を下回る水準まで低下しました。その後はジャクソンホール会議でのパウエル米連邦準備制度理事会（FRB）議長の講演で米金融引締めが長期化するとの警戒が強まり米国金利が上昇したことから、国内の長期金利も押し上げられる動きとなり、再度0.2%台前半まで上昇しました。

(2022年9月～11月)

当期間の長期金利は日銀が長期金利の上限としている0.25%近辺での推移が続きました。

欧州中央銀行が通常の3倍となる0.75%の利上げを決めたことや、8月の米CPIの伸びが市場予想を上回り、米金融引締めへの警戒が広がったことから、国内の長期金利は日銀が許容する上限の0.25%まで上昇し、その後は日銀が金額無制限で長期国債を買い入れる指値オペレーション（公開市場操作）を連日実施したことから0.25%に張り付く動きが続きました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

当期のベンチマークに対する修正デュレーション（金利感応度）および債券種別構成の調整は、以下のように行いました。

①修正デュレーション（金利感応度）

当期を通じてベンチマーク対比中立で調整しました。調整範囲はおおむねベンチマーク対比で $\Delta 0.3 \sim +0.3$ 年程度としました。

②債券種別構成

当期における国債以外の債券については、期を通じて、ほぼベンチマーク対比中立の範囲内で調整しました。

なお、2022年11月21日時点におけるポートフォリオの修正デュレーションは9.05年、最終利回りは0.42%となっています。

＜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は $\Delta 2.1\%$ となりました。ベンチマークであるDBI総合指数の同期間の騰落率は $\Delta 2.0\%$ でした。この差は、修正デュレーション（金利感応度）については当期を通じてベンチマーク対比中立に調整しましたが、市場平均に比べて相対的に収益率の低かった債券種別の債券をベンチマーク対比で多めに保有していたことが主な要因です。

＜今後の運用方針＞

運用の基本方針に従い、わが国の公社債に投資しDBI総合指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年2月18日～2022年11月21日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)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	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,923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2月18日～2022年11月21日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	1,600,967	105,246
内	地方債証券	300,509	—
	特殊債券	100,640	—
	社債券(投資法人債券を含む)	99,639	—

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれていません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○ 利害関係人との取引状況等

(2022年2月18日～2022年11月21日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2022年11月21日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		期 末		残存期間別組入比率		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 組 入 比 率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	1,400,000	1,447,650	73.9	—	58.1	—	15.9
地方債証券	300,000	299,554	15.3	—	—	15.3	—
	(300,000)	(299,554)	(15.3)	(—)	(—)	(15.3)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	100,000	100,219	5.1	—	—	5.1	—
	(100,000)	(100,219)	(5.1)	(—)	(—)	(5.1)	(—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	100,000	99,206	5.1	—	—	5.1	—
	(100,000)	(99,206)	(5.1)	(—)	(—)	(5.1)	(—)
合 計	1,900,000	1,946,629	99.4	—	58.1	25.5	15.9
	(500,000)	(498,979)	(25.5)	(—)	(—)	(25.5)	(—)

(注1) () 内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘	柄	当 期		期 末	
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第150回利付国債 (20年)		1.4	62,000	68,421	2034/9/20
第138回利付国債 (5年)		0.1	90,000	90,183	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)		0.1	110,000	110,239	2024/3/20
第141回利付国債 (5年)		0.1	110,000	110,260	2024/9/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	83,000	87,847	2054/3/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	71,000	70,831	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	64,000	63,775	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	66,000	65,665	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	61,000	60,589	2030/6/20
第367回利付国債 (10年)		0.2	10,000	9,971	2032/6/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	75,000	87,437	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	56,000	65,332	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	58,000	66,581	2042/9/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	92,000	74,724	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	73,000	62,036	2046/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	69,000	77,782	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	97,000	108,264	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	70,000	78,086	2034/6/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	83,000	89,616	2034/12/20
小	計		1,400,000	1,447,650	

しんきん国内債券インデックスマザーファンド ー 第 1 期 ー

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成28年度第5回愛知県公募公債 (10年)	0.07	100,000	99,805	2026/6/29
平成28年度第3回福岡県公募公債	0.055	100,000	99,701	2026/8/26
平成28年度第4回横浜市公募公債	0.175	100,000	100,048	2027/1/22
小 計		300,000	299,554	
特殊債券(除く金融債)				
第93回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.174	100,000	100,219	2027/2/15
小 計		100,000	100,219	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第19回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.09	100,000	99,206	2026/6/3
小 計		100,000	99,206	
合 計		1,900,000	1,946,629	

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 1,946,629	% 99.4
コール・ローン等、その他	11,794	0.6
投資信託財産総額	1,958,423	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

しんきん国内債券インデックスマザーファンド ー 第 1 期 ー

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年11月21日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	1,958,423,285	
コール・ローン等	8,696,268	
公社債(評価額)	1,946,629,080	
未収利息	3,092,009	
前払費用	5,928	
(B) 負債	97	
未払利息	24	
その他未払費用	73	
(C) 純資産総額(A-B)	1,958,423,188	
元本	1,999,496,963	
次期繰越損益金	△ 41,073,775	
(D) 受益権総口数	1,999,496,963口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,795円	

(注1) 当親投資信託の設定時元本額は1,997,099,500円、期中追加設定元本額は5,463,625円、期中一部解約元本額は3,066,162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、しんきん国内債券インデックススペシャル(適格機関投資家限定)1,993,938,775円、しんきん国内債券インデックス(投資一任用)5,558,188円です。

(注3) 1口当たり純資産額は0.9795円です。

○損益の状況 (2022年2月18日~2022年11月21日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	8,795,961	
受取利息	8,833,455	
支払利息	△ 37,494	
(B) 有価証券売買損益	△49,879,390	
売買益	50,580	
売買損	△49,929,970	
(C) 保管費用等	△ 4,863	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△41,088,292	
(E) 追加信託差損益金	△ 46,745	
(F) 解約差損益金	61,262	
(G) 計(D+E+F)	△41,073,775	
次期繰越損益金(G)	△41,073,775	

(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(E)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(F)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。