

○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／海外／債券 |
| 信託期間 | 無期限 |
| 主投資対象 | 親投資信託である「しんきんアジア債券マザーファンド」(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。 |
| 運用方針 | <p>①投資にあたっては、主としてマザーファンドの受益証券への投資を通じ、原則として以下の方針に基づき運用を行います。</p> <p>1) 新興国を含むアジア地域(日本を除く。)の外貨建ソブリン債券および準ソブリン債券への投資を通じ、アジア各国の債券に分散投資を行います。</p> <p>2) FTSEアジア国債インデックス(ヘッジなし・円ベース)を参考として、投資環境、金利水準ならびに流動性等を勘案して、ポートフォリオの構築を図ります。</p> <p>3) 主にアジアの自国通貨建ソブリン債券、準ソブリン債券に投資するほか、米ドルなどの外国通貨建ソブリン債券・準ソブリン債券に投資する場合もあります。(米ドルなどの外国通貨建債券に投資した場合は、原則として、実質的に自国通貨建となるように外国為替予約取引等を行います。)</p> <p>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。</p> <p>③外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジを行いません。</p> <p>④市場動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p> |
| 主な投資制限 | <p>①株式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。</p> <p>②同一銘柄の株式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。</p> <p>③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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④投資信託証券(マザーファンドの受益証券は除きます。)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。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債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。</p> <p>⑥外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> |
| 収益分配方針 | <p>毎決算時に原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>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。</p> <p>②収益分配金額は、利子・配当等収益を中心に安定した収益分配を行うことを目指し、委託者が基準価額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には分配を行わないことがあります。</p> |

運用報告書(全体版)

しんきんアジア債券ファンド (毎月決算型) 愛称：アジアの恵み

第110期(決算日：2021年8月20日)
第111期(決算日：2021年9月21日)
第112期(決算日：2021年10月20日)
第113期(決算日：2021年11月22日)
第114期(決算日：2021年12月20日)
第115期(決算日：2022年1月20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「しんきんアジア債券ファンド(毎月決算型)」(愛称：アジアの恵み)は2022年1月20日に第115期の決算を行いました。

ここに、第110期から第115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

| | |
|------------------------------|----|
| ◇しんきんアジア債券ファンド（毎月決算型） | 頁 |
| 最近30期の運用実績 | 1 |
| 当作成期中の基準価額と市況等の推移 | 2 |
| 当作成期中（第110期～第115期）の運用経過等 | 3 |
| 1万口当たりの費用明細 | 6 |
| 売買及び取引の状況 | 8 |
| 利害関係人との取引状況等 | 8 |
| 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 | 8 |
| 自社による当ファンドの設定・解約状況 | 8 |
| 組入資産の明細 | 8 |
| 投資信託財産の構成 | 9 |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | 9 |
| 損益の状況 | 10 |
| 分配金のお知らせ | 11 |
| ◇参考情報 | |
| 親投資信託の組入資産の明細 | 12 |
| ◇親投資信託の運用報告書 | |
| しんきんアジア債券マザーファンド | 14 |

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30期の運用実績

| 決 算 期 | 基 準 (分配落) | 価 額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 純 資 産 額 |
|-------------------|--------------|-----|-----|-----------------|---------|------|---------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 期 金 騰 落 | | | |
| | 円 | | 円 | | % | % | 百万円 |
| 86期(2019年8月20日) | 7,660 | | 60 | △ | 1.8 | 96.8 | 2,726 |
| 87期(2019年9月20日) | 7,752 | | 60 | | 2.0 | 97.4 | 2,774 |
| 88期(2019年10月21日) | 7,775 | | 60 | | 1.1 | 97.4 | 2,804 |
| 89期(2019年11月20日) | 7,799 | | 40 | | 0.8 | 96.7 | 2,823 |
| 90期(2019年12月20日) | 7,863 | | 40 | | 1.3 | 97.2 | 2,840 |
| 91期(2020年1月20日) | 8,046 | | 40 | | 2.8 | 97.7 | 2,898 |
| 92期(2020年2月20日) | 8,127 | | 40 | | 1.5 | 97.7 | 2,917 |
| 93期(2020年3月23日) | 7,156 | | 40 | △ | 11.5 | 97.6 | 2,561 |
| 94期(2020年4月20日) | 7,227 | | 40 | | 1.6 | 97.5 | 2,571 |
| 95期(2020年5月20日) | 7,481 | | 40 | | 4.1 | 98.0 | 2,676 |
| 96期(2020年6月22日) | 7,622 | | 40 | | 2.4 | 97.5 | 2,713 |
| 97期(2020年7月20日) | 7,663 | | 40 | | 1.1 | 98.0 | 2,695 |
| 98期(2020年8月20日) | 7,667 | | 40 | | 0.6 | 98.1 | 2,688 |
| 99期(2020年9月23日) | 7,563 | | 40 | △ | 0.8 | 97.3 | 2,645 |
| 100期(2020年10月20日) | 7,580 | | 40 | | 0.8 | 97.6 | 2,650 |
| 101期(2020年11月20日) | 7,640 | | 40 | | 1.3 | 97.1 | 2,671 |
| 102期(2020年12月21日) | 7,661 | | 40 | | 0.8 | 97.2 | 2,657 |
| 103期(2021年1月20日) | 7,631 | | 40 | | 0.1 | 97.5 | 2,646 |
| 104期(2021年2月22日) | 7,644 | | 40 | | 0.7 | 98.1 | 2,632 |
| 105期(2021年3月22日) | 7,485 | | 40 | △ | 1.6 | 97.4 | 2,581 |
| 106期(2021年4月20日) | 7,491 | | 40 | | 0.6 | 97.5 | 2,590 |
| 107期(2021年5月20日) | 7,593 | | 40 | | 1.9 | 98.4 | 2,603 |
| 108期(2021年6月21日) | 7,614 | | 40 | | 0.8 | 97.0 | 2,589 |
| 109期(2021年7月20日) | 7,419 | | 40 | △ | 2.0 | 97.2 | 2,508 |
| 110期(2021年8月20日) | 7,431 | | 25 | | 0.5 | 97.3 | 2,519 |
| 111期(2021年9月21日) | 7,448 | | 25 | | 0.6 | 97.2 | 2,455 |
| 112期(2021年10月20日) | 7,707 | | 25 | | 3.8 | 97.3 | 2,526 |
| 113期(2021年11月22日) | 7,583 | | 25 | △ | 1.3 | 97.0 | 2,430 |
| 114期(2021年12月20日) | 7,483 | | 25 | △ | 1.0 | 97.1 | 2,389 |
| 115期(2022年1月20日) | 7,506 | | 25 | | 0.6 | 97.1 | 2,391 |

(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) 当ファンドは、新興国を含むアジア地域（日本を除く。）の外貨建ソブリン債券および準ソブリン債券へ投資することにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指していますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指標はありません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

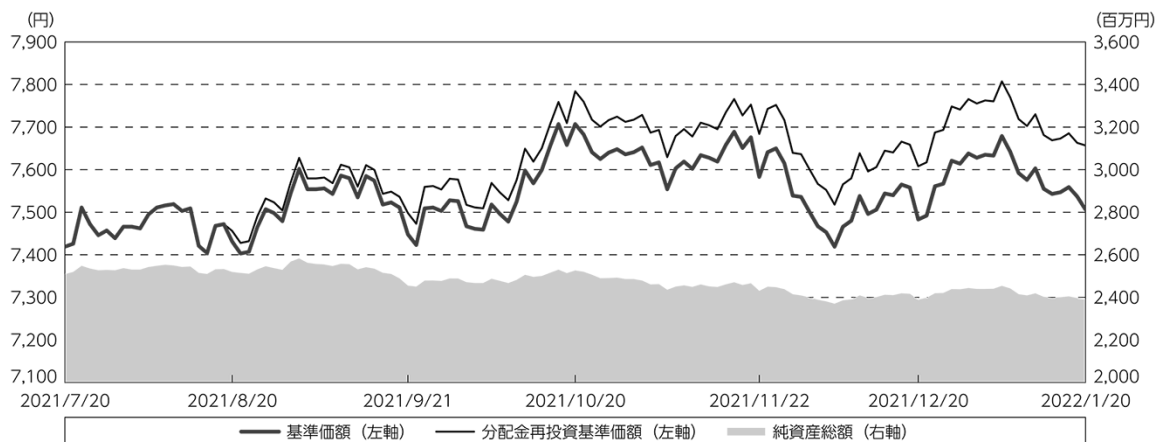
| 決 算 期 | 年 月 日 | 基 準 | 価 額 | | 債 組 入 比 率 |
|-------|----------------------|------------|-----|--------|-----------|
| | | | 騰 落 | 率 | |
| 第110期 | (期 首) 2021年 7月20日 | 円 7,419 | | % — | % 97.2 |
| | 7月末 | 7,439 | | 0.3 | 96.7 |
| | (期 末) 2021年 8月20日 | 7,456 | | 0.5 | 97.3 |
| 第111期 | (期 首) 2021年 8月20日 | 7,431 | | — | 97.3 |
| | 8月末 | 7,545 | | 1.5 | 96.9 |
| | (期 末) 2021年 9月21日 | 7,473 | | 0.6 | 97.2 |
| 第112期 | (期 首) 2021年 9月21日 | 7,448 | | — | 97.2 |
| | 9月末 | 7,526 | | 1.0 | 96.8 |
| | (期 末) 2021年10月20日 | 7,732 | | 3.8 | 97.3 |
| 第113期 | (期 首) 2021年10月20日 | 7,707 | | — | 97.3 |
| | 10月末 | 7,641 | | △0.9 | 97.2 |
| | (期 末) 2021年11月22日 | 7,608 | | △1.3 | 97.0 |
| 第114期 | (期 首) 2021年11月22日 | 7,583 | | — | 97.0 |
| | 11月末 | 7,536 | | △0.6 | 95.4 |
| | (期 末) 2021年12月20日 | 7,508 | | △1.0 | 97.1 |
| 第115期 | (期 首) 2021年12月20日 | 7,483 | | — | 97.1 |
| | 12月末 | 7,635 | | 2.0 | 97.0 |
| | (期 末) 2022年 1月20日 | 7,531 | | 0.6 | 97.1 |

(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、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

○当作成期中（第110期～第115期）の運用経過等（2021年7月21日～2022年1月20日）

<当作成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は、作成期首(2021年7月20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。

<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「しんきんアジア債券マザーファンド」を通じて、新興国を含むアジア地域(日本を除く。)の国債を中心とした外貨建債券へ分散投資を行っています。

当作成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>

- ・投資しているアジア各国債券の金利収入を得たこと。
- ・米国の利上げ観測の高まりで円が対ドルで売られたことや、新型コロナウイルスのワクチン接種が進展したことや新規感染者数の落ち着きを受け、アジア各国の経済再開観測が高まり、アジア各国通貨が対円で上昇したこと。

<下落要因>

- ・米連邦準備制度理事会(FRB)が量的緩和の段階的縮小(テーパリング)を決定したことや、インフレ懸念の高まりにより米国では利上げが実施されるとの見方が高まったことから、米国の金利が上昇、アジア各国金利も影響を受けて上昇(債券価格は下落)したこと。

＜投資環境＞

（債券市況：アジア圏）

- ・ 当作成期初は、F R Bがインフレは一時的との姿勢を示して、緩和的な金融政策を維持していたことから、アジア各国金利は横ばいもしくは小幅な低下となっていました。インフレが一時的ではないとの見方が高まり、F R Bがテーパリングを実施、さらにテーパリングの加速を決定したこと、利上げに対して前向きな姿勢を示したことから、米国の金利が上昇、アジア各国金利も影響を受けて、おおむね上昇となりました。

（為替市況：アジア圏）

- ・ 当作成期初は、横ばい推移となっていました。F R Bがテーパリング開始・加速を決定したことや早期の利上げ観測が高まったことから円安ドル高となり、またアジア各国では新型コロナウイルスのワクチン接種が進化したことや新規感染者数が落ち着きを見せたことから、経済活動が再開するとの観測から、アジア各国通貨は対円で上昇となりました。
- ・ 2022年に入り、米国の利上げが加速するとの見方から、株価が軟調になり、リスク回避の動きが強まったことから、円高となる局面はありましたが、当作成期初比ではアジア各国通貨はおおむね対円で上昇となりました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

当ファンドは、親投資信託である「しんきんアジア債券マザーファンド」の受益証券への投資を通じ、外貨建資産の組入比率が高位となるように調整しています。

●しんきんアジア債券マザーファンド

FTSEアジア国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）を参考として、投資環境、金利水準および流動性等を勘案し、インドネシア、韓国、マレーシア、フィリピン、シンガポールおよびタイの6か国のソブリン債、準ソブリン債を投資対象とし、各国の現地通貨建国債を組み入れています。当作成期を通じて、当該債券の組入比率が高位となるように運用を行いました。

6か国の組入比率については、おおむねインドネシア29%程度、マレーシア24%程度、フィリピン19%程度、シンガポール・タイ14%程度および韓国0%としました。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当ファンドは、「しんきんアジア債券マザーファンド」を通じ、FTSEアジア国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）を参考として、新興国を含むアジア地域（日本を除く。）の外貨建ソブリン債および準ソブリン債を投資対象としていますが、組入国および国別比率については、当社独自の判断で運用を行っているため、比較対象となるベンチマークおよび参考指標はありません。

<分配金>

収益分配金については、毎月安定した分配金を支払うことを目指し、当作成期中は、経費控除後の利子・配当等収益や基準価額水準等を勘案して、各期25円（1万口当たり、税込み）とし、合計で150円としました。

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110期 | 第111期 | 第112期 | 第113期 | 第114期 | 第115期 |
|-----------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| | 2021年7月21日～ 2021年8月20日 | 2021年8月21日～ 2021年9月21日 | 2021年9月22日～ 2021年10月20日 | 2021年10月21日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月20日 | 2021年12月21日～ 2022年1月20日 |
| 当期分配金 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 | 25 |
| (対基準価額比率) | 0.335% | 0.335% | 0.323% | 0.329% | 0.333% | 0.332% |
| 当期の収益 | 23 | 22 | 25 | 20 | 16 | 22 |
| 当期の収益以外 | 1 | 2 | — | 4 | 8 | 2 |
| 翌期繰越分配対象額 | 283 | 281 | 281 | 277 | 268 | 266 |

(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>

当ファンドは、「しんきんアジア債券マザーファンド」の受益証券への投資を通じ、外貨建資産の組入比率が高位となるように調整していきます。

●しんきんアジア債券マザーファンド

ポートフォリオ組入国は、金利水準および流動性を考慮し、インドネシア、マレーシア、フィリピン、シンガポールおよびタイの5か国構成とします。組入銘柄は、引き続き現地通貨建国債の組入れを維持します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年7月21日～2022年1月20日)

| 項 目 | 第110期～第115期 | | 項 目 の 概 要 |
|------------------------|-------------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 52 | % 0.693 | (a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率 |
| (投 信 会 社) | (19) | (0.250) | 委託した資金の運用の対価 |
| (販 売 会 社) | (31) | (0.416) | 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) | (0.028) | 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 | 17 | 0.225 | (b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数 |
| (保 管 費 用) | (5) | (0.069) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の 送金・資産の移転等に要する費用 |
| (そ の 他) | (12) | (0.156) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 69 | 0.918 | |
| 作成期間の平均基準価額は、7,553円です。 | | | |

(注1) 作成期間の費用（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。

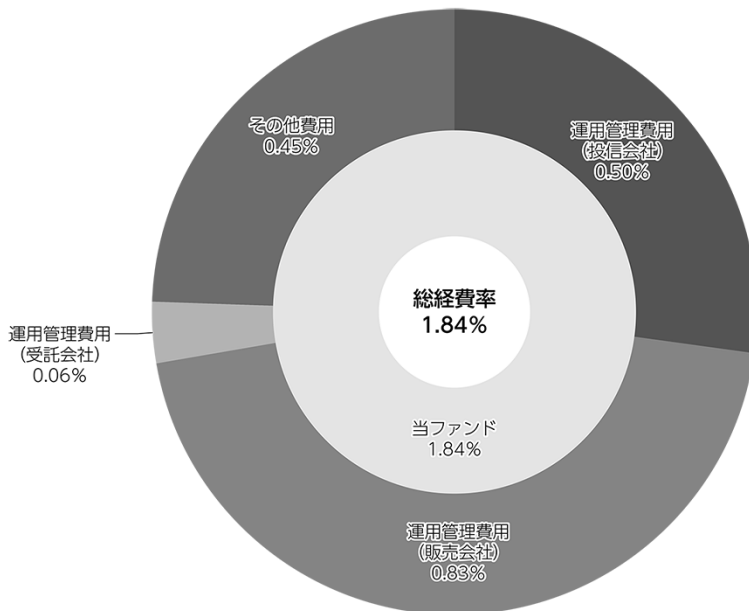
(注3) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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）を作成期間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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.84%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

(2021年7月21日～2022年1月20日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第110期～第115期 | | | |
|------------------|-------------|---------|---------------|---------------|
| | 設定 | | 解約 | |
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| しんきんアジア債券マザーファンド | 千口 - | 千円 - | 千口 122,288 | 千円 219,000 |

(注) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月21日～2022年1月20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

(2021年7月21日～2022年1月20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

(2021年7月21日～2022年1月20日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年1月20日現在)

親投資信託残高

| 銘柄 | 第109期末 | 第115期末 | |
|------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| しんきんアジア債券マザーファンド | 千口 1,434,452 | 千口 1,312,164 | 千円 2,375,279 |

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年1月20日現在)

| 項 目 | 第115期末 | |
|------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| しんきんアジア債券マザーファンド | 千円 2,375,279 | % 98.8 |
| コール・ローン等、その他 | 28,433 | 1.2 |
| 投資信託財産総額 | 2,403,712 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) しんきんアジア債券マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(2,372,825千円)の投資信託財産総額(2,375,226千円)に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、当作成期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2022年1月20日現在、1ドル=114.31円、1シンガポールドル=84.88円、1マレーシアリングギット=27.296円、1タイバーツ=3.47円、1フィリピンペソ=2.2189円、100インドネシアルピア=0.80円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目 | 第110期末 | 第111期末 | 第112期末 | 第113期末 | 第114期末 | 第115期末 |
|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| | 2021年8月20日現在 | 2021年9月21日現在 | 2021年10月20日現在 | 2021年11月22日現在 | 2021年12月20日現在 | 2022年1月20日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 資産 | 2,534,562,268 | 2,505,061,405 | 2,543,388,183 | 2,450,564,931 | 2,403,086,574 | 2,403,712,365 |
| コール・ローン等 | 31,624,149 | 30,237,041 | 20,499,546 | 25,312,751 | 21,254,060 | 28,432,794 |
| しんきんアジア債券マザーファンド(評価額) | 2,502,938,119 | 2,448,824,364 | 2,511,888,637 | 2,413,252,180 | 2,381,832,514 | 2,375,279,571 |
| 未収入金 | — | 26,000,000 | 11,000,000 | 12,000,000 | — | — |
| (B) 負債 | 15,407,055 | 49,969,497 | 17,108,729 | 19,885,693 | 13,724,225 | 12,096,909 |
| 未払収益分配金 | 8,475,457 | 8,240,531 | 8,194,423 | 8,014,106 | 7,982,849 | 7,965,469 |
| 未払解約金 | 3,972,974 | 38,675,520 | 6,201,288 | 8,798,887 | 3,199,721 | 1,302,776 |
| 未払信託報酬 | 2,958,273 | 3,053,258 | 2,712,806 | 3,072,367 | 2,541,581 | 2,828,521 |
| 未払利息 | 85 | 46 | 38 | 42 | 54 | 71 |
| その他未払費用 | 266 | 142 | 174 | 291 | 20 | 72 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,519,155,213 | 2,455,091,908 | 2,526,279,454 | 2,430,679,238 | 2,389,362,349 | 2,391,615,456 |
| 元本 | 3,390,183,121 | 3,296,212,452 | 3,277,769,251 | 3,205,642,579 | 3,193,139,886 | 3,186,187,740 |
| 次期繰越損益金 | △ 871,027,908 | △ 841,120,544 | △ 751,489,797 | △ 774,963,341 | △ 803,777,537 | △ 794,572,284 |
| (D) 受益権総口数 | 3,390,183,121口 | 3,296,212,452口 | 3,277,769,251口 | 3,205,642,579口 | 3,193,139,886口 | 3,186,187,740口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 7,431円 | 7,448円 | 7,707円 | 7,583円 | 7,483円 | 7,506円 |

(注1) 当ファンドの第110期首元本額は3,381,672,783円、当作成期中(第110期～第115期)における追加設定元本額は194,652,639円、同一部解約元本額は390,137,682円です。

(注2) 1口当たり純資産額は、第110期0.7431円、第111期0.7448円、第112期0.7707円、第113期0.7583円、第114期0.7483円、第115期0.7506円です。

○損益の状況

| 項 目 | 第110期 | 第111期 | 第112期 | 第113期 | 第114期 | 第115期 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| | 2021年7月21日～ 2021年8月20日 | 2021年8月21日～ 2021年9月21日 | 2021年9月22日～ 2021年10月20日 | 2021年10月21日～ 2021年11月22日 | 2021年11月23日～ 2021年12月20日 | 2021年12月21日～ 2022年1月20日 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 1,831 | △ 1,790 | △ 1,236 | △ 1,584 | △ 1,056 | △ 1,034 |
| 支払利息 | △ 1,831 | △ 1,790 | △ 1,236 | △ 1,584 | △ 1,056 | △ 1,034 |
| (B) 有価証券売買損益 | 15,234,432 | 16,879,838 | 95,722,700 | △ 28,933,159 | △ 21,259,363 | 18,075,983 |
| 売買益 | 15,429,950 | 17,913,310 | 96,064,367 | 562,180 | 121,458 | 18,448,733 |
| 売買損 | △ 195,518 | △ 1,033,472 | △ 341,667 | △ 29,495,339 | △ 21,380,821 | △ 372,750 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,958,539 | △ 3,053,502 | △ 2,713,135 | △ 3,072,711 | △ 2,541,785 | △ 2,828,593 |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 12,274,062 | 13,824,546 | 93,008,329 | △ 32,007,454 | △ 23,802,204 | 15,246,356 |
| (E) 前期繰越損益金 | △176,111,301 | △164,796,593 | △156,387,791 | △ 69,457,742 | △106,969,240 | △134,501,608 |
| (F) 追加信託差損益金 | △698,715,212 | △681,907,966 | △679,915,912 | △665,484,039 | △665,023,244 | △667,351,563 |
| (配当等相当額) | (96,561,618) | (93,408,737) | (92,241,621) | (90,240,388) | (88,533,506) | (85,577,526) |
| (売買損益相当額) | (△795,276,830) | (△775,316,703) | (△772,157,533) | (△755,724,427) | (△753,556,750) | (△752,929,089) |
| (G) 計 (D + E + F) | △862,552,451 | △832,880,013 | △743,295,374 | △766,949,235 | △795,794,688 | △786,606,815 |
| (H) 収益分配金 | △ 8,475,457 | △ 8,240,531 | △ 8,194,423 | △ 8,014,106 | △ 7,982,849 | △ 7,965,469 |
| 次期繰越損益金 (G + H) | △871,027,908 | △841,120,544 | △751,489,797 | △774,963,341 | △803,777,537 | △794,572,284 |
| 追加信託差損益金 | △699,288,173 | △682,602,786 | △679,915,912 | △666,873,716 | △667,817,959 | △668,077,490 |
| (配当等相当額) | (96,071,701) | (92,760,623) | (92,269,871) | (88,880,155) | (85,764,244) | (84,890,121) |
| (売買損益相当額) | (△795,359,874) | (△775,363,409) | (△772,185,783) | (△755,753,871) | (△753,582,203) | (△752,967,611) |
| 分配準備積立金 | — | — | 101,140 | — | — | — |
| 繰越損益金 | △171,739,735 | △158,517,758 | △ 71,675,025 | △108,089,625 | △135,959,578 | △126,494,794 |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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。

<分配金の計算過程>

第110期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,902,496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(96,644,662円)より分配対象収益は104,547,158円(10,000口当たり308円)であり、うち8,475,457円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

第111期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,545,711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(93,455,443円)より分配対象収益は101,001,154円(10,000口当たり306円)であり、うち8,240,531円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

第112期計算期間末における費用控除後の配当等収益(8,295,563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(92,269,871円)より分配対象収益は100,565,434円(10,000口当たり306円)であり、うち8,194,423円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

第113期計算期間末における費用控除後の配当等収益(6,422,353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(90,269,832円)および分配準備積立金(202,076円)より分配対象収益は96,894,261円(10,000口当たり302円)であり、うち8,014,106円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

第114期計算期間末における費用控除後の配当等収益(5,188,134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(88,558,959円)より分配対象収益は93,747,093円(10,000口当たり293円)であり、うち7,982,849円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

第115期計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,239,542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(85,616,048円)より分配対象収益は92,855,590円(10,000口当たり291円)であり、うち7,965,469円(10,000口当たり25円)を分配金額としています。

○分配金のお知らせ

| | 第110期 | 第111期 | 第112期 | 第113期 | 第114期 | 第115期 |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 1万円当たり分配金（税込み） | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25円 | 25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、各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、各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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2022年1月20日現在）

<しんきんアジア債券マザーファンド>

下記は、しんきんアジア債券マザーファンド全体(1,312,164千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 第115期末 | | | | | | | |
|--------|--------------------------|--------------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|--------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 3,100 | 千シンガポールドル 3,346 | 千円 284,030 | % 12.0 | % — | % 12.0 | % — | % — |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 21,000 | 千マレーシアリンギット 22,277 | 608,096 | 25.6 | — | 25.6 | — | — |
| タイ | 千タイバーツ 85,000 | 千タイバーツ 83,308 | 289,081 | 12.2 | — | 10.9 | 1.3 | — |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 150,000 | 千フィリピンペソ 165,359 | 366,917 | 15.4 | — | 8.5 | 7.0 | — |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 90,700,000 | 千インドネシアルピア 96,784,511 | 774,276 | 32.6 | — | 32.6 | — | — |
| 合 計 | — | — | 2,322,401 | 97.8 | — | 89.5 | 8.2 | — |

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月20日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(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)外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 利 率 | 額面金額 | 第115期末 | | 償還年月日 | |
|--------|------------------------|-------------|-------------|------------|-----------|------------|
| | | | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| シンガポール | % | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | 千円 | | |
| 国債証券 | SIGB 2.875 09/01/30 | 2.875 | 2,940 | 3,172 | 269,261 | 2030/9/1 |
| | SIGB 3.500 03/01/27 | 3.5 | 160 | 174 | 14,769 | 2027/3/1 |
| 小 計 | | | | | 284,030 | |
| マレーシア | | 千マレーシアリンギット | 千マレーシアリンギット | | | |
| 国債証券 | MGS 3.885 08/15/29 | 3.885 | 2,500 | 2,555 | 69,744 | 2029/8/15 |
| | MGS 4.498 04/15/30 | 4.498 | 18,500 | 19,722 | 538,351 | 2030/4/15 |
| 小 計 | | | | | 608,096 | |
| タイ | | 千タイバーツ | 千タイバーツ | | | |
| 国債証券 | THAIGB 1.600 12/17/29 | 1.6 | 77,000 | 74,515 | 258,570 | 2029/12/17 |
| | THAIGB 3.850 12/12/25 | 3.85 | 8,000 | 8,792 | 30,511 | 2025/12/12 |
| 小 計 | | | | | 289,081 | |
| フィリピン | | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | | | |
| 国債証券 | RPGB 3.625 09/09/25 | 3.625 | 40,000 | 40,239 | 89,287 | 2025/9/9 |
| | RPGB 4.125 08/20/24 | 4.125 | 33,000 | 34,173 | 75,827 | 2024/8/20 |
| | RPGB 5.375 03/01/27 | 5.375 | 24,000 | 25,325 | 56,195 | 2027/3/1 |
| | RPGB 8.000 07/19/31 | 8.0 | 53,000 | 65,621 | 145,607 | 2031/7/19 |
| 小 計 | | | | | 366,917 | |
| インドネシア | | 千インドネシアルピア | 千インドネシアルピア | | | |
| 国債証券 | INDOGB 10.250 07/15/27 | 10.25 | 24,700,000 | 29,840,811 | 238,726 | 2027/7/15 |
| | INDOGB 6.125 05/15/28 | 6.125 | 32,000,000 | 32,288,000 | 258,304 | 2028/5/15 |
| | INDOGB 6.500 02/15/31 | 6.5 | 21,800,000 | 21,723,700 | 173,789 | 2031/2/15 |
| | INDOGB 7.000 05/15/27 | 7.0 | 12,200,000 | 12,932,000 | 103,456 | 2027/5/15 |
| 小 計 | | | | | 774,276 | |
| 合 計 | | | | | 2,322,401 | |

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月20日現在の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

運用報告書

親投資信託

しんきんアジア債券マザーファンド

第10期

(決算日：2021年7月20日)

しんきんアジア債券マザーファンドの第10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 | アジア各国のソブリン債券および準ソブリン債券を主要投資対象とします。 |
| 運用方針 | <p>①新興国を含むアジア地域（日本を除く。）の外貨建てソブリン債券および準ソブリン債券への投資を通じ、アジア各国の債券に分散投資を行います。</p> <p>②FTSEアジア国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）を参考として、投資環境、金利水準ならびに流動性等を勘案して、ポートフォリオの構築を図ります。</p> <p>③主にアジアの自国通貨建てソブリン債券、準ソブリン債券に投資するほか、米ドルなどの外国通貨建てソブリン債券・準ソブリン債券に投資する場合があります。（米ドルなどの外国通貨建て債券に投資した場合は、原則として、実質的に自国通貨建てとなるように外国為替予約取引等を行います。）</p> <p>④外貨建資産の組入比率については、原則として高位を保ちます。</p> <p>⑤外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。</p> <p>⑥市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。</p> |
| 投資制限 | <p>①株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>②同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>③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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④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5%以下とします。</p> <p>⑤同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>⑥外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準 | 価額 | | 債組入比率 | 券率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|----|------|-------|------|-------|
| | | 騰落 | 中率 | | | |
| | 円 | | % | | % | 百万円 |
| 6期(2017年7月20日) | 14,917 | | 3.7 | | 97.4 | 2,021 |
| 7期(2018年7月20日) | 14,636 | | △1.9 | | 96.4 | 2,587 |
| 8期(2019年7月22日) | 15,711 | | 7.3 | | 97.6 | 2,731 |
| 9期(2020年7月20日) | 16,655 | | 6.0 | | 98.0 | 2,693 |
| 10期(2021年7月20日) | 17,411 | | 4.5 | | 97.6 | 2,497 |

(注) 当ファンドは、新興国を含むアジア地域(日本を除く。)の外貨建ソブリン債券および準ソブリン債券へ投資することにより、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指していますが、特定の指数を上回るまたは連動を目指した運用を行っていないため、ベンチマークおよび参考指標はありません。

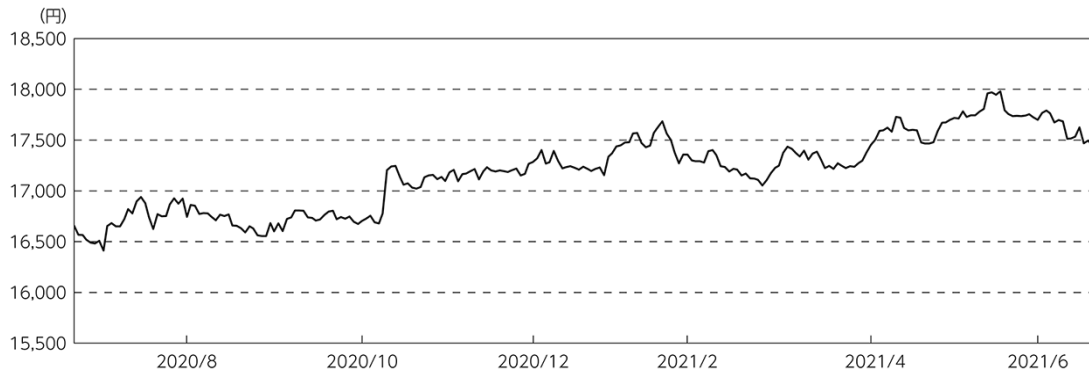
○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準 | 価額 | | 債組入比率 | 券率 |
|--------------------|--------|--------|------|-------|------|
| | | 騰落 | 率 | | |
| (期首) 2020年7月20日 | 円 | | % | | % |
| | 16,655 | | — | | 98.0 |
| 7月末 | 16,412 | | △1.5 | | 98.2 |
| 8月末 | 16,744 | | 0.5 | | 98.1 |
| 9月末 | 16,681 | | 0.2 | | 98.0 |
| 10月末 | 16,704 | | 0.3 | | 98.1 |
| 11月末 | 17,137 | | 2.9 | | 97.8 |
| 12月末 | 17,285 | | 3.8 | | 97.3 |
| 2021年1月末 | 17,371 | | 4.3 | | 97.8 |
| 2月末 | 17,358 | | 4.2 | | 98.3 |
| 3月末 | 17,374 | | 4.3 | | 97.9 |
| 4月末 | 17,453 | | 4.8 | | 97.9 |
| 5月末 | 17,673 | | 6.1 | | 97.8 |
| 6月末 | 17,700 | | 6.3 | | 97.8 |
| (期末) 2021年7月20日 | | 17,411 | | 4.5 | 97.6 |

(注) 騰落率は期首比です。

○第10期の運用経過等（2020年7月21日～2021年7月20日）

<当期中の基準価額等の推移>



当ファンドは、新興国を含むアジア地域（日本を除く。）の国債を中心とした外貨建債券へ分散投資を行っています。

当期の基準価額は上昇しました。基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

<上昇要因>

- ・投資しているアジア各国の債券の金利収入を得たこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン実用化の進展によるリスク選好の強まりや、世界各国の中央銀行が緩和的な金融政策を継続、欧米のワクチン接種の進展により経済持ち直し観測から、アジア各国へ資金流入傾向となったことにより、フィリピンペソ、タイバーツを除くアジア各国の通貨が対円で上昇したこと。
- ・世界的な金融緩和環境や、中央銀行による国債の直接購入などにより、インドネシアの国債金利が低下（価格は上昇）したこと。

<下落要因>

- ・米国の大統領選挙および議会選挙でバイデン候補、民主党が勝利したことにより、財政支出拡大観測が高まったことや、インフレ懸念の高まり、米連邦準備制度理事会（FRB）が量的緩和の縮小（テーパリング）を行うとの観測が高まったことから一時的に米国金利が上昇、その影響を受けて、インドネシアを除くアジア各国の金利が上昇（債券価格は下落）したこと。

＜投資環境＞

（債券市況：アジア圏）

- ・当期初は、世界的に新型コロナウイルスの感染拡大が続き、金融緩和政策が継続されたことから、金利は低下基調で推移しました。その後、ワクチン開発進展の報道により、株価が堅調に推移するなど、リスク選好の動きが強まったことや、2020年11月の米国の大統領選挙および議会選挙ではバイデン候補と民主党が勝利し、財政拡大期待の高まりを受けて、米国金利が上昇、影響を受けてアジア各国の金利も上昇しましたが、中央銀行により国債の直接購入を開始したインドネシアは低下しました。
- ・2021年4月以降は、米国でテーパリング観測や市場予想よりも早い利上げ観測が高まる局面があったものの、インフレ懸念は一時的との見方から米国金利が低下に転じたことや、欧米でワクチン接種が進み、経済持ち直し観測から株価が堅調となったことから、アジア各国の金利も横ばいもしくは低下に転じましたが、当期初比ではインドネシアを除きおおむね上昇となりました。

（為替市況：アジア圏）

- ・当期初から、世界的な金融緩和環境により、アジア各国へ資金流入傾向となったことやワクチンの開発進展への期待の高まりからリスク選好が強まり、安全通貨であるドルや円が売られたことから、アジア各国の通貨はおおむね上昇となりました。さらに米国の大統領選挙や議会選挙でバイデン候補と民主党が勝利し、財政拡大観測によるリスク選好の高まりからアジア各国の通貨は上昇となりました。2021年4月以降は米国で市場予想に対して早期の利上げが実施されるとの見方が高まり、資金流出観測からアジア各国の通貨は下落する局面もありましたが、欧米でワクチン接種が進み、経済持ち直し観測の強まりにより株価が堅調に推移したことから、アジア各国の通貨が対円で堅調に推移しました。
- ・当期末にかけて、アジア各国で感染が拡大したため、軟調推移となり、当期初比でタイバーツは対円で下落、フィリピンペソは横ばいとなりましたが、インドネシアルピア、マレーシアリングギット、シンガポールドル、韓国ウォンは上昇となりました。

＜当ファンドのポートフォリオ＞

F T S Eアジア国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）を参考として、投資環境、金利水準および流動性等を勘案し、インドネシア、韓国、マレーシア、フィリピン、シンガポールおよびタイの6か国のソブリン債、準ソブリン債を投資対象とし、各国の現地通貨建国債を組み入れています。当期を通じて、当該債券の組入比率が高位となるように運用を行いました。

6か国の組入比率については、おおむねインドネシア29%程度、マレーシア24%程度、フィリピン19%程度、シンガポール・タイ14%程度および韓国0%としました。

＜当ファンドのベンチマークとの差異＞

当ファンドは、F T S Eアジア国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）を参考として、新興国を含むアジア地域（日本を除く。）の外貨建ソブリン債および準ソブリン債を投資対象としていますが、組入国および国別比率については、当社独自の判断で運用を行っているため、比較対象となるベンチマークおよび参考指標はありません。

＜今後の運用方針＞

ポートフォリオ組入国は、金利水準、流動性を考慮し、インドネシア、マレーシア、フィリピン、シンガポールおよびタイの5か国構成とします。組入銘柄は、引き続き現地通貨建国債の組入れを維持します。

○1万口当たりの費用明細

(2020年7月21日～2021年7月20日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|---------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 27 | % 0.157 | (a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (21) | (0.123) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ そ の 他 ） | (6) | (0.034) | 信託事務の処理等に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 27 | 0.157 | |
| 期中の平均基準価額は、17,157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

(2020年7月21日～2021年7月20日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|--------|------|-------------------------|--------------------------|
| 外 | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 237 | 千シンガポールドル 675 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千マレーシアリングgit 4,475 | 千マレーシアリングgit 6,080 |
| | タイ | 国債証券 | 千タイバーツ 25,703 | 千タイバーツ 33,241 |
| 国 | フィリピン | 国債証券 | 千フィリピンペソ - | 千フィリピンペソ 36,920 |
| | インドネシア | 国債証券 | 千インドネシアルピア 7,335,770 | 千インドネシアルピア 12,038,680 |

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月21日～2021年7月20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

(2021年7月20日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|--------|---------------------------|---------------------------|---------------|-----------|-----------------|-----------|--------|--------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 3,380 | 千シンガポールドル 3,816 | 千円 306,648 | % 12.3 | % — | % 12.3 | % — | % — |
| マレーシア | 千マレーシアリンギット 22,300 | 千マレーシアリンギット 24,228 | 628,138 | 25.2 | — | 23.3 | 1.9 | — |
| タイ | 千タイバーツ 89,000 | 千タイバーツ 91,394 | 305,258 | 12.2 | — | 10.4 | 1.8 | — |
| フィリピン | 千フィリピンペソ 148,000 | 千フィリピンペソ 170,789 | 370,954 | 14.9 | — | 8.5 | 3.0 | 3.4 |
| インドネシア | 千インドネシアルピア 101,900,000 | 千インドネシアルピア 108,809,080 | 826,949 | 33.1 | — | 33.1 | — | — |
| 合 計 | — | — | 2,437,948 | 97.6 | — | 87.6 | 6.7 | 3.4 |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(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) 一印は組み入れなし。

(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入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘 柄 | | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|--------|------|-----------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 債 還 年 月 日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| シンガポール | 国債証券 | SIGB 2.875 09/01/30 | 2.875 | 2,450 | 2,759 | 221,759 | 2030/9/1 |
| | | SIGB 3.500 03/01/27 | 3.5 | 930 | 1,056 | 84,888 | 2027/3/1 |
| | 小 計 | | | | | 306,648 | |
| マレーシア | 国債証券 | MGS 3.885 08/15/29 | 3.885 | 2,500 | 2,633 | 68,277 | 2029/8/15 |
| | | MGS 4.181 07/15/24 | 4.181 | 1,700 | 1,790 | 46,422 | 2024/7/15 |
| | | MGS 4.498 04/15/30 | 4.498 | 18,100 | 19,804 | 513,438 | 2030/4/15 |
| | 小 計 | | | | | 628,138 | |
| タイ | 国債証券 | THAIGB 1.600 12/17/29 | 1.6 | 77,000 | 77,806 | 259,873 | 2029/12/17 |
| | | THAIGB 3.850 12/12/25 | 3.85 | 12,000 | 13,588 | 45,384 | 2025/12/12 |
| | 小 計 | | | | | 305,258 | |
| フィリピン | 国債証券 | RPGB 4.125 08/20/24 | 4.125 | 33,000 | 34,694 | 75,356 | 2024/8/20 |
| | | RPGB 5.375 03/01/27 | 5.375 | 24,000 | 26,674 | 57,936 | 2027/3/1 |
| | 小 計 | | | | | | |

しんきんアジア債券マザーファンド ー第10期ー

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | | | |
|--------|------|------------------------|------------|------------|------------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| フィリピン | | % | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | 千円 | | |
| | 国債証券 | RPG 5.750 11/24/21 | 5.75 | 38,000 | 38,576 | 83,788 | 2021/11/24 |
| | | RPG 8.000 07/19/31 | 8.0 | 53,000 | 70,843 | 153,872 | 2031/7/19 |
| 小 | 計 | | | | | 370,954 | |
| インドネシア | | | 千インドネシアルピア | 千インドネシアルピア | | | |
| | 国債証券 | INDOGB 10.250 07/15/27 | 10.25 | 24,700,000 | 30,173,520 | 229,318 | 2027/7/15 |
| | | INDOGB 6.125 05/15/28 | 6.125 | 57,700,000 | 58,219,300 | 442,466 | 2028/5/15 |
| | | INDOGB 6.500 02/15/31 | 6.5 | 7,300,000 | 7,374,460 | 56,045 | 2031/2/15 |
| | | INDOGB 7.000 05/15/27 | 7.0 | 12,200,000 | 13,041,800 | 99,117 | 2027/5/15 |
| 小 | 計 | | | | | 826,949 | |
| 合 | 計 | | | | | 2,437,948 | |

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年7月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 2,437,948 | % 97.6 |
| コール・ローン等、その他 | 59,506 | 2.4 |
| 投資信託財産総額 | 2,497,454 | 100.0 |

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産 (2,495,449千円) の投資信託財産総額 (2,497,454千円) に対する比率は99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価を我が国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。2021年7月20日現在、1ドル=109.57円、1シンガポールドル=80.35円、1マレーシアリングギット=25.9253円、1タイバーツ=3.34円、1フィリピンペソ=2.172円、100インドネシアルピア=0.76円です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年7月20日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | 円 |
|-----------------|----------------|---|
| (A) 資産 | 2,497,454,353 | |
| コール・ローン等 | 40,837,359 | |
| 公社債(評価額) | 2,437,948,290 | |
| 未収利息 | 17,665,983 | |
| 前払費用 | 1,002,721 | |
| (B) 負債 | 15 | |
| 未払利息 | 5 | |
| その他未払費用 | 10 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 2,497,454,338 | |
| 元本 | 1,434,452,604 | |
| 次期繰越損益金 | 1,063,001,734 | |
| (D) 受益権総口数 | 1,434,452,604口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,411円 | |

(注1) 当親投資信託の期首元本額は1,617,138,307円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は182,685,703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、しんきんアジア債券ファンド(毎月決算型)1,434,452,604円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1.7411円です。

○損益の状況 (2020年7月21日～2021年7月20日)

| 項 目 | 当 期 | 円 |
|------------------|---------------|---|
| (A) 配当等収益 | 106,128,292 | |
| 受取利息 | 106,130,942 | |
| 支払利息 | △ 2,650 | |
| (B) 有価証券売買損益 | 16,057,604 | |
| 売買益 | 103,148,037 | |
| 売買損 | △ 87,090,433 | |
| (C) 保管費用等 | △ 4,123,054 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 118,062,842 | |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,076,253,189 | |
| (F) 解約差損益金 | △ 131,314,297 | |
| (G) 計(D+E+F) | 1,063,001,734 | |
| 次期繰越損益金(G) | 1,063,001,734 | |

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)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。