

○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7期:2021年6月7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2021年6月7日に第7期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

 しんきんアセットマネジメント投信株式会社

〒104-0031 東京都中央区京橋3丁目8番1号

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

目 次

◇しんきんJ P X日経400オープン	頁
最近5期の運用実績	1
当期中の基準価額と市況等の推移	1
第7期の運用経過等	2
1万口当たりの費用明細	5
売買及び取引の状況	7
株式売買比率	7
利害関係人との取引状況等	7
第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況	7
自社による当ファンドの設定・解約状況	7
組入資産の明細	7
投資信託財産の構成	8
資産、負債、元本及び基準価額の状況	8
損益の状況	8
分配金のお知らせ	9
◇親投資信託の運用報告書	
しんきんJ P X日経400マザーファンド	10

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンドとし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		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	中期騰落率	ポイント	騰落率			
	円	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
3期(2017年6月5日)	12,780	230	21.3	14,358.44	19.6	94.6	2.5	3,260
4期(2018年6月5日)	13,950	220	10.9	15,696.35	9.3	93.7	6.2	4,568
5期(2019年6月5日)	12,302	0	△11.8	13,608.16	△13.3	90.9	8.9	6,190
6期(2020年6月5日)	13,118	280	8.9	14,534.54	6.8	97.8	1.9	4,358
7期(2021年6月7日)	15,919	270	23.4	17,706.94	21.8	97.3	2.5	3,868

(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		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	ポイント	騰落率		
(期首) 2020年6月5日	円	%	ポイント	%	%	%
	13,118	—	14,534.54	—	97.8	1.9
6月末	12,691	△3.3	14,049.87	△3.3	96.2	3.6
7月末	12,188	△7.1	13,498.21	△7.1	94.7	5.2
8月末	13,182	0.5	14,611.26	0.5	94.9	5.0
9月末	13,288	1.3	14,617.28	0.6	93.0	6.8
10月末	12,909	△1.6	14,210.19	△2.2	93.7	6.1
11月末	14,483	10.4	15,954.48	9.8	96.8	1.9
12月末	14,856	13.2	16,341.80	12.4	97.7	2.0
2021年1月末	14,908	13.6	16,410.28	12.9	95.5	4.6
2月末	15,328	16.8	16,871.64	16.1	96.0	3.7
3月末	16,136	23.0	17,622.89	21.2	93.4	6.3
4月末	15,651	19.3	17,101.14	17.7	95.9	3.7
5月末	15,899	21.2	17,385.08	19.6	95.7	3.5
(期末) 2021年6月7日	円	%	ポイント	%	%	%
	16,189	23.4	17,706.94	21.8	97.3	2.5

(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。

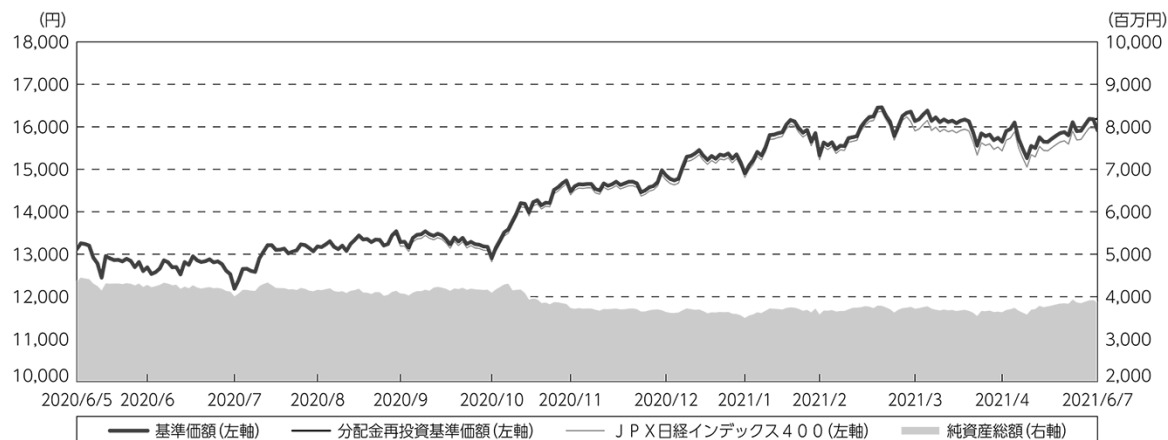
(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(注4) 株式先物比率＝買建比率－売建比率。

※「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7期の運用経過等（2020年6月6日～2021年6月7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(2020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。

＜基準価額の主な変動要因＞

当ファンドは、親投資信託である「しんきんJ P X日経400マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、J P X日経インデックス400(以下「J P X日経400」という。)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行っています。

当期における基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

＜上昇要因＞

- ・各国で、新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響軽減のため、金融政策および経済対策がとられたこと。
- ・米国大統領選の勝敗が判明し、米国政治の不透明感が後退したこと。
- ・企業の業績に回復が見られたこと。

＜下落要因＞

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、投資家にリスク回避姿勢が広がったこと。

＜投資環境＞

(2020年6月～9月)

当期のJ P X日経400は、14,534.54ポイント（2020年6月5日終値）で始まりました。

6月の株式市場は、国内外で新型コロナウイルスの感染拡大が続く一方、ワクチン開発が進み、経済活動が本格的に再開することへの期待から、一進一退の展開が続きました。7月は月末にかけ軟調となりましたが、8月はトランプ大統領が失業給付の増額など追加経済対策の大統領令を発令したことで、米国景気の先行きに安心感が広がったことなどから、国内外の株価は再び堅調な動きになりました。その後は、安倍首相が辞意を固めたことから、国内政治の先行き不透明感が広がり一時的に下落する場面もありましたが、9月には、自民党総裁選に菅官房長官が出馬を検討と伝わり、安倍政権の政策が継続するとの期待が高まり、堅調な展開となりました。

(2020年10月～12月)

10月の株式市場は欧米での新型コロナウイルスの感染拡大や米国大統領選への警戒などから軟調となりましたが、11月は米国大統領選の勝敗が判明し、米国政治の不透明感が後退するとの見方から、国内外の株価は大きく上昇しました。12月は、新型コロナウイルスのワクチン接種が始まったことを受け、世界的な経済活動の正常化への期待や、米国の金融緩和政策が長期化するとの見方から高値圏での推移となりました。

(2021年1月～3月)

1月の株式市場は、緊急事態宣言の再発令への警戒から下落して始まりましたが、米国で民主党が大統領と上下両院の過半数を押さえるトリプルブルーとなり、大型の追加経済対策が実施されるとの期待から、高値圏での推移となりました。2月は、米国議会下院が2021会計年度の予算決議案を可決し、大規模な経済対策が早期に成立するとの見方が広がったことや、ワクチン普及による景気回復期待で堅調な動きになりました。3月も内外の長期金利上昇に対する警戒から売られる場面もありましたが、堅調に推移しました。

(2021年4月～期末)

4月は、新型コロナウイルスの感染拡大で経済活動の再開が遅れるとの見方が強まり下落しました。5月は4月の米国消費者物価指数（C P I）が市場予想を上回ったことを受け、インフレへの警戒が一段と強まったことなどから、大きく値を下げましたが、期末にかけて値を戻し、期末のJ P X日経400は17,706.94ポイント（2021年6月7日終値）で終了しました。

当期中のJ P X日経400は21.8%の上昇となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

J P X日経400の動きに連動する投資成果を目指して、親投資信託である「しんきんJ P X日経400マザーファンド」の受益証券の組入れを行い、当期を通じて組入比率が高位となるように調整しました。

●しんきんJ P X日経400マザーファンド

J P X日経400に連動する投資成果を目指し、設定・解約に応じた株式売上のほか、指数構成銘柄変更に伴う入替えなどを、必要に応じて実施しました。また、株式組入比率はT O P I X先物等を利用しながら、高位の水準を保つように努めました。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

決算日時点の基準価額の騰落率(分配金込み)は+23.4%となり、同期間のJ P X日経400の騰落率である+21.8%を、1.6%上回りました。

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

<分配金>

当期の収益分配金については、経費控除後の配当等収益や期末の基準価額水準などを勘案して1万口当たり270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7期
	2020年6月6日～ 2021年6月7日
当期分配金 (対基準価額比率)	270 1.668%
当期の収益	270
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,986

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

<今後の運用方針>

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

●しんきんJ P X日経400マザーファンド

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年6月6日～2021年6月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 95	% 0.664	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(40)	(0.277)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(47)	(0.332)	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 ）	(8)	(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	1	0.010	(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)	(0.002)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(1)	(0.008)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.001	(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)	(0.001)	信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	96	0.675	
期中の平均基準価額は、14,293円です。			

(注1) 期中の費用（消費税等の掛かるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しています。

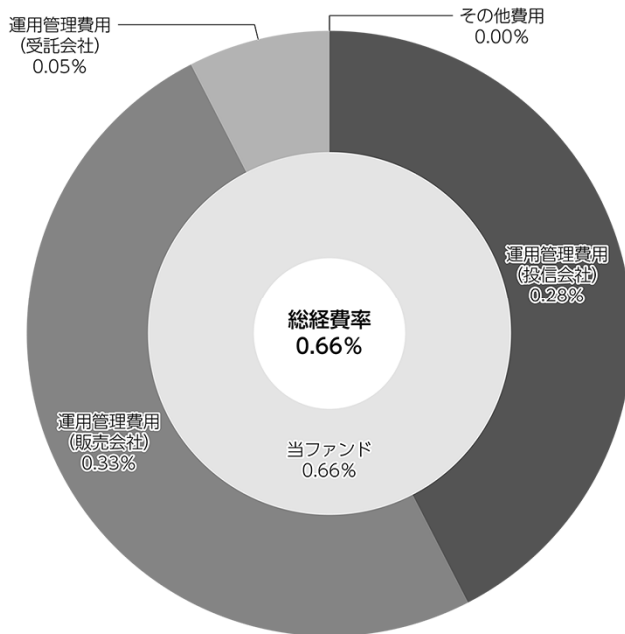
(注3) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数点以下第3位未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.66%です。



(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2020年6月6日～2021年6月7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 652,573	千円 1,054,100	千口 1,509,282	千円 2,405,050

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年6月6日～2021年6月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	しんきんJ P X日経400マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	2,524,438千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,674,247千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月6日～2021年6月7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

(2020年6月6日～2021年6月7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

(2020年6月6日～2021年6月7日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年6月7日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
しんきんJ P X日経400マザーファンド	千口 2,983,423	千円 3,858,922	千口 2,126,714	千円 3,858,922

(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

(2021年6月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
しんきんJ P X日経400マザーファンド	3,858,922	97.4
コール・ローン等、その他	103,524	2.6
投資信託財産総額	3,962,446	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 (2021年6月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,962,446,413
コール・ローン等	40,523,853
しんきんJ P X日経400マザーファンド(評価額)	3,858,922,560
未収入金	63,000,000
(B) 負債	93,621,963
未払収益分配金	65,618,422
未払解約金	15,697,007
未払信託報酬	12,306,251
未払利息	99
その他未払費用	184
(C) 純資産総額(A-B)	3,868,824,450
元本	2,430,311,929
次期繰越損益金	1,438,512,521
(D) 受益権総口数	2,430,311,929口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,919円

(注1) 当ファンドの期首元本額は3,322,288,575円、期中追加設定元本額は1,520,230,771円、期中一部解約元本額は2,412,207,417円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.5919円です。

○損益の状況 (2020年6月6日～2021年6月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 9,754
支払利息	△ 9,754
(B) 有価証券売買損益	576,877,351
売買益	830,477,156
売買損	△ 253,599,805
(C) 信託報酬等	△ 26,029,629
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	550,837,968
(E) 前期繰越損益金	38,273,321
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	915,019,654 (927,666,403)
(売買損益相当額)	(△ 12,646,749)
(G) 計(D+E+F)	1,504,130,943
(H) 収益分配金	△ 65,618,422
次期繰越損益金(G+H)	1,438,512,521
追加信託差損益金 (配当等相当額)	915,019,654 (931,534,194)
(売買損益相当額)	(△ 16,514,540)
分配準備積立金	523,492,867

(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(65,813,989円)、費用控除後の有価証券等損益額(456,320,995円)、信託約款に規定する収益調整金(931,534,194円)および分配準備積立金(66,976,305円)より分配対象収益は1,520,645,483円(10,000口当たり6,256円)であり、うち65,618,422円(10,000口当たり270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)	270円
------------------	------

◇分配金を再投資される場合のお手取分配金は、自動けいぞく投資約款の規定に基づき、決算日の翌営業日に再投資いたしました。

◇分配金をお受け取りになる場合の分配金は、決算日から起算して5営業日目までにお支払いを開始しています。

◇分配金のお取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

(注1) 分配金は、分配後の基準価額と各受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)があります。分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は全額が「普通分配金」となります。分配後の基準価額を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が「元本払戻金(特別分配金)」、残りの部分が「普通分配金」となります。

(注2) 個人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)の税率が適用されます。

(注3) 法人の受益者の場合、収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金については、15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)が源泉徴収されます。

(注4) 当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

(注5) 税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

運用報告書

親投資信託

しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンド

第 7 期

(決算日：2021年6月7日)

しんきん J P X 日経 4 0 0 マザーファンドの第 7 期に係る運用状況をご報告申し上げます。

○当ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	親投資信託
信託期間	無期限
主要投資対象	我が国の金融商品取引所に上場している株式（上場予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
運用方針	①主として我が国の金融商品取引所に上場している株式に投資し、J P X 日経インデックス 4 0 0 の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 ②株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。 ③運用の効率化および J P X 日経インデックス 4 0 0 への連動を図るため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨ならびに金利に係る先物取引およびオプション取引、および外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。 ④株式以外の資産への投資割合は、原則として、投資信託財産の総額の50%以下とします。 ⑤市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。
投資制限	①株式への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。 ③外貨建資産への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ④投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤上場投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		J P X日経インデックス400※		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落			
	円	%	ポイント		%	%	百万円
3期(2017年6月5日)	13,447	22.1	14,358.44		19.6	94.7	3,257
4期(2018年6月5日)	15,005	11.6	15,696.35		9.3	93.7	4,567
5期(2019年6月5日)	13,318	△11.2	13,608.16		△13.3	90.9	6,188
6期(2020年6月5日)	14,602	9.6	14,534.54		6.8	97.8	4,356
7期(2021年6月7日)	18,145	24.3	17,706.94		21.8	97.6	3,859

(注) 株式先物比率=買建比率-売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		J P X日経インデックス400※		株式組入比率	株式先物比率
	騰落	率	(ベンチマーク)	騰落		
(期首) 2020年6月5日	円	%	ポイント		%	%
	14,602	—	14,534.54		—	97.8
6月末	14,136	△3.2	14,049.87		△3.3	96.2
7月末	13,583	△7.0	13,498.21		△7.1	94.7
8月末	14,699	0.7	14,611.26		0.5	94.9
9月末	14,826	1.5	14,617.28		0.6	93.0
10月末	14,410	△1.3	14,210.19		△2.2	93.7
11月末	16,177	10.8	15,954.48		9.8	96.8
12月末	16,603	13.7	16,341.80		12.4	97.7
2021年1月末	16,670	14.2	16,410.28		12.9	95.5
2月末	17,148	17.4	16,871.64		16.1	96.0
3月末	18,063	23.7	17,622.89		21.2	93.5
4月末	17,530	20.1	17,101.14		17.7	95.9
5月末	17,817	22.0	17,385.08		19.6	95.7
(期末) 2021年6月7日	円	%	ポイント		%	%
	18,145	24.3	17,706.94		21.8	97.6

(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7期の運用経過等（2020年6月6日～2021年6月7日）

＜当期中の基準価額等の推移＞



当ファンドは、J P X日経インデックス400（以下「J P X日経400」という。）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行っています。

当期における基準価額の主な変動要因は、以下のとおりです。

＜上昇要因＞

- ・各国で、新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響軽減のため、金融政策および経済対策がとられたこと。
- ・米国大統領選の勝敗が判明し、米国政治の不透明感が後退したこと。
- ・企業の業績に回復が見られたこと。

＜下落要因＞

- ・新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、投資家にリスク回避姿勢が広がったこと。

＜投資環境＞

(2020年6月～9月)

当期のJ P X日経400は、14,534.54ポイント（2020年6月5日終値）で始まりました。

6月の株式市場は、国内外で新型コロナウイルスの感染拡大が続く一方、ワクチン開発が進み、経済活動が本格的に再開することへの期待から、一進一退の展開が続きました。7月は月末にかけ軟調となりましたが、8月はトランプ大統領が失業給付の増額など追加経済対策の大統領令を発令したことで、米国景気の先行きに安心感が広がったことなどから、国内外の株価は再び堅調な動きになりました。その後は、安倍首相が辞意を固めたことから、国内政治の先行き不透明感が広がり一時的に下落する場面もありましたが、9月には、自民党総裁選に菅官房長官が出馬を検討と伝わり、安倍政権の政策が継続するとの期待が高まり、堅調な展開となりました。

(2020年10月～12月)

10月の株式市場は欧米での新型コロナウイルスの感染拡大や米国大統領選への警戒などから軟調となりましたが、11月は米国大統領選の勝敗が判明し、米国政治の不透明感が後退するとの見方から、国内外の株価は大きく上昇しました。12月は、新型コロナウイルスのワクチン接種が始まったことを受け、世界的な経済活動の正常化への期待や、米国の金融緩和と政策が長期化するとの見方から高値圏での推移となりました。

(2021年1月～3月)

1月の株式市場は、緊急事態宣言の再発令への警戒から下落して始まりましたが、米国で民主党が大統領と上下両院の過半数を押さえるトリプルブルーとなり、大型の追加経済対策が実施されるとの期待から、高値圏での推移となりました。2月は、米国議会下院が2021会計年度の予算決議案を可決し、大規模な経済対策が早期に成立するとの見方が広がったことや、ワクチン普及による景気回復期待で堅調な動きになりました。3月も内外の長期金利上昇に対する警戒から売られる場面もありましたが、堅調に推移しました。

(2021年4月～期末)

4月は、新型コロナウイルスの感染拡大で経済活動の再開が遅れるとの見方が強まり下落しました。5月は4月の米国消費者物価指数(CPI)が市場予想を上回ったことを受け、インフレへの警戒が一段と強まったことなどから、大きく値を下げましたが、期末にかけて値を戻し、期末のJ P X日経400は17,706.94ポイント(2021年6月7日終値)で終了しました。

当期中のJ P X日経400は21.8%の上昇となりました。

<当ファンドのポートフォリオ>

J P X日経400に連動する投資成果を目指し、設定・解約に応じた株式売買のほか、指数構成銘柄変更に伴う入替えなどを、必要に応じて実施しました。また、株式組入比率はT O P I X先物等を利用しながら、高位の水準を保つように努めました。

<当ファンドのベンチマークとの差異>

決算日時点の基準価額の騰落率は+24.3%となり、同期間のJ P X日経400の騰落率である+21.8%を、2.5%上回りました。

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

<今後の運用方針>

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

○1万口当たりの費用明細

(2020年6月6日～2021年6月7日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先物・オプション)	円 2 (0) (1)	% 0.010 (0.002) (0.008)	(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	0.011	
期中の平均基準価額は、15,971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6月6日～2021年6月7日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 258 (△234)	千円 646,891 ()	千株 722	千円 1,877,546

(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 3,026	百万円 3,051	百万円 -	百万円 -

(注) 単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年6月6日～2021年6月7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	2,524,438千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,674,247千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.68

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月6日～2021年6月7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6月7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%)			
日本水産	3.3	2.3	1,260
マルハニチロ	0.5	0.4	979
鉱業 (0.2%)			
I N P E X	13.1	9.1	7,361
建設業 (2.3%)			
安藤・間	2	1.6	1,352
東急建設	1	0.7	532
コムシスホールディングス	1.2	0.9	2,853
東建コーポレーション	—	0.1	980
大成建設	2.5	1.8	6,939
大林組	7.6	5.7	5,318
清水建設	7.7	5.3	5,050
長谷工コーポレーション	2.9	1.9	2,964
鹿島建設	5.9	4.2	6,396
西松建設	0.6	0.4	1,356
三井住友建設	1.8	1.4	673

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
前田建設工業	1.9	1.4	1,398
戸田建設	3.1	2.4	1,860
熊谷組	0.4	0.3	862
大東建託	0.9	0.6	7,056
N I P P O	0.6	0.5	1,478
五洋建設	3	2.4	1,912
住友林業	1.9	1.3	2,887
大和ハウス工業	7.5	5.3	17,781
積水ハウス	8.3	6.2	13,987
協和エクシオ	1.1	0.9	2,457
九電工	0.5	0.4	1,380
食料品 (3.5%)			
森永製菓	0.6	0.4	1,390
江崎グリコ	0.7	—	—
寿スブリッツ	—	0.2	1,500
カルビー	1.1	0.8	1,988
森永乳業	—	0.3	1,716

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7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			
ヤクルト本社	1.7	1.3	7,787			
明治ホールディングス	1.6	1.2	7,992			
日本ハム	0.9	0.7	3,150			
アサヒグループホールディングス	5.1	4	21,824			
キリンホールディングス	10.3	7.7	17,255			
サントリー食品インターナショナル	1.6	1.2	5,130			
伊藤園	—	0.6	3,906			
キッコーマン	1.7	1.3	9,295			
味の素	5.3	4.3	11,175			
キュービー	1.3	1	2,605			
カゴメ	—	0.7	2,049			
アリアケジャパン	0.2	0.2	1,290			
ニチレイ	1.2	0.9	2,577			
東洋水産	1.2	0.9	3,838			
日清食品ホールディングス	1	0.7	5,425			
日本たばこ産業	14	9.8	21,560			
繊維製品 (0.4%)						
帝人	1.9	1.7	3,065			
東レ	17.1	12.9	9,838			
ゴールドウイン	0.4	0.3	1,983			
パルプ・紙 (0.1%)						
王子ホールディングス	9.9	8	5,392			
化学 (7.7%)						
クラレ	3.7	2.8	3,152			
旭化成	15.7	11.8	14,991			
昭和電工	1.7	1.4	5,047			
住友化学	17.4	14	8,694			
日産化学	1.3	1	5,800			
東ソー	3.7	2.7	5,313			
トクヤマ	0.7	0.5	1,167			
デンカ	0.9	0.6	2,292			
信越化学工業	4.1	3.3	63,954			
エア・ウォーター	2.2	1.8	3,220			
日本酸素ホールディングス	2.3	1.5	3,249			
三菱瓦斯化学	2.2	1.8	4,532			
三井化学	2.1	1.5	5,910			
J S R	2.2	1.8	5,859			
三菱ケミカルホールディングス	15.8	11.9	10,900			
KHネオケム	—	0.3	840			

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			
ダイセル	3.1	2.4	2,210			
積水化学工業	5.1	3.8	7,273			
アイカ工業	0.7	0.5	1,967			
宇部興産	1.2	0.9	2,124			
日立化成	1.1	—	—			
ダイキョーニシカワ	0.5	—	—			
日油	0.9	0.7	4,025			
花王	5.8	4.3	28,676			
日本ペイントホールディングス	2	7.3	11,453			
関西ペイント	2.7	2	5,896			
D I C	1	0.8	2,390			
資生堂	4.8	3.6	28,483			
ライオン	3.1	2.4	4,584			
ファンケル	—	0.7	2,352			
コーセー	0.5	0.3	5,373			
ポーラ・オルビスホールディングス	1	0.8	2,331			
小林製薬	0.7	0.5	4,625			
日東電工	1.7	1.1	9,493			
ニフコ	0.9	0.7	2,807			
ユニ・チャーム	4.7	3.9	17,175			
医薬品 (5.8%)						
協和キリン	2.4	1.8	6,480			
武田薬品工業	15.4	12.8	46,924			
アステラス製薬	20.9	15.7	29,673			
大日本住友製薬	1.8	1.3	2,839			
塩野義製薬	3.1	2.3	12,873			
日本新薬	0.6	0.5	4,065			
中外製薬	2.5	5.7	24,099			
科研製薬	0.4	0.3	1,408			
エーザイ	2.9	2	15,502			
ロート製薬	—	0.9	2,472			
小野薬品工業	5.5	4.2	10,161			
久光製薬	0.6	0.5	2,855			
参天製薬	4.5	3.2	4,652			
沢井製薬	0.5	—	—			
第一三共	6.9	14.8	35,024			
大塚ホールディングス	4.6	3.8	17,483			
パプチドリーム	1.2	—	—			
サワイグループホールディングス	—	0.4	1,942			

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7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
石油・石炭製品 (0.5%)			
出光興産	2.7	2	5,372
ENEOSホールディングス	36.3	27.3	12,962
コスモエネルギーホールディングス	0.7	0.6	1,461
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	1.4	1.1	2,563
TOYO TIRE	—	1	2,285
ブリヂストン	7	4.8	23,880
住友ゴム工業	2.2	1.6	2,406
ガラス・土石製品 (0.8%)			
AGC	2.4	1.7	8,245
太平洋セメント	1.5	1.1	2,719
東海カーボン	2.5	1.8	2,997
TOTO	1.7	1.3	7,644
日本碍子	2.9	2	4,102
日本特殊陶業	1.8	1.4	2,401
ニチアス	0.7	0.5	1,421
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	10.7	8.6	16,529
ジェイ エフ イー ホールディングス	6.4	5.2	6,968
日立金属	2.6	—	—
非鉄金属 (0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	6	—	—
住友金属鉱山	3.1	2.3	11,184
DOWAホールディングス	0.6	—	—
古河電気工業	0.7	0.6	1,775
住友電気工業	8.9	6.3	11,021
アサヒホールディングス	—	0.7	1,612
金属製品 (0.3%)			
SUMCO	2.9	2.3	6,019
三和ホールディングス	2.2	1.7	2,276
リンナイ	0.5	0.3	3,141
東プレ	0.4	—	—
機械 (5.7%)			
日本製鋼所	—	0.5	1,492
三浦工業	—	0.8	4,072
アマダ	3	2.6	3,036
FUJ I	—	0.7	1,886
オーエスジー	1.1	0.9	1,772

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
DMG森精機	1.5	1.1	2,178
ディスコ	0.3	0.2	6,810
ナブテスコ	1.4	1.1	5,610
三井海洋開発	0.3	—	—
SMC	0.8	0.5	33,185
小松製作所	10.9	8.2	25,633
住友重機械工業	1.4	1	3,445
日立建機	1	0.8	2,848
ハーモニック・ドライブ・システムズ	0.5	—	—
クボタ	12.8	9.5	23,351
ダイキン工業	3.1	2.3	48,714
ダイフク	1.2	1	9,360
竹内製作所	0.4	0.3	870
T P R	0.3	—	—
ホシザキ	—	0.6	6,030
日本精工	4.5	3.7	3,929
ジェイテクト	2.3	—	—
THK	1.4	1.1	3,971
マキタ	3.1	2.4	12,312
三菱重工業	4	2.9	10,251
I H I	1.7	1.2	3,506
電気機器 (18.4%)			
コニカミノルタ	5.3	—	—
ブラザー工業	2.9	2.2	5,130
ミネベアミツミ	4.5	3.1	9,265
日立製作所	11.6	8.7	52,896
三菱電機	24.1	18.2	32,932
富士電機	1.5	1.1	5,863
安川電機	2.6	2	10,620
東芝テック	0.3	0.2	898
日本電産	5.8	4.4	55,088
日新電機	0.6	—	—
オムロン	2.2	1.5	12,855
MC J	—	0.6	655
日本電気	2.9	2.3	11,684
富士通	2.3	1.6	29,792
ルネサスエレクトロニクス	11.5	7.8	9,711
セイコーエプソン	3	2.3	4,565
アルバック	0.4	0.3	1,623

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7期ー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エレコム	0.3	0.4	834
パナソニック	27.6	19.4	24,589
シャープ	—	2.4	4,848
アンリツ	—	1.1	2,272
富士通ゼネラル	0.7	—	—
ソニーグループ	10.2	5.9	64,015
TDK	1.2	0.9	12,978
アルプスアルパイン	2.1	1.5	1,825
ヒロセ電機	0.4	—	—
横河電機	2.2	1.8	3,142
アズビル	1.5	1.2	5,124
日本光電工業	1	0.8	2,512
堀場製作所	0.5	0.4	2,924
アドバンテスト	1.8	1.4	14,308
キーエンス	1.7	1.1	59,950
シスメックス	1.7	1.4	15,085
OBARA GROUP	0.1	0.1	400
レーザーテック	1.1	0.8	18,224
スタンレー電気	1.7	1.3	4,277
カシオ計算機	2.1	1.5	2,926
ファナック	2.3	1.6	41,616
浜松ホトニクス	1.7	1.3	8,788
京セラ	3.4	2.8	19,163
太陽誘電	1.1	0.8	4,336
村田製作所	7.1	5.3	45,272
小糸製作所	1.4	1.1	8,030
SCREENホールディングス	0.4	0.3	3,192
キャノン	13	9	23,373
東京エレクトロン	1.6	1.1	53,405
輸送用機器 (6.4%)			
トヨタ紡織	0.7	0.5	1,134
豊田自動織機	2	1.5	14,595
デンソー	5.3	4	31,428
川崎重工業	1.9	—	—
いすゞ自動車	7	5.1	7,752
トヨタ自動車	9.2	6.3	62,477
日野自動車	3	2.3	2,366
アイシン	2	1.3	6,376
マツダ	7.1	5.7	5,802

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	19	14.3	51,337
スズキ	4.8	3.6	17,395
S U B A R U	7.5	5.2	11,585
ヤマハ発動機	3.1	2.6	8,554
豊田合成	0.8	0.6	1,640
シマノ	0.9	0.7	16,859
テイ・エス テック	0.6	0.8	1,323
精密機器 (3.1%)			
テルモ	6.8	5.6	23,570
島津製作所	2.9	2.3	9,062
ブイ・テクノロジー	0.1	0.1	568
東京精密	0.4	0.3	1,671
ニコン	3.8	2.8	3,357
オリンパス	13.4	10.1	24,088
HOYA	4.8	3.6	50,292
朝日インテック	2.7	1.9	5,065
その他製品 (1.9%)			
パナダイナムコホールディングス	2.5	1.5	11,796
パイロットコーポレーション	0.4	0.3	1,078
タカラトミー	1.1	—	—
ヤマハ	1.4	1.1	7,139
ビジョン	1.5	1.2	3,876
任天堂	1.5	0.7	48,006
電気・ガス業 (1.1%)			
中部電力	7.4	5.6	7,361
関西電力	9.1	6.9	7,327
中国電力	—	2.6	2,652
東北電力	6	4.3	3,745
九州電力	5	4	3,448
北海道電力	—	1.7	851
電源開発	1.9	1.4	2,249
東京瓦斯	4.6	3.5	7,367
大阪瓦斯	4.7	3.3	6,666
陸運業 (3.9%)			
東武鉄道	2.5	1.9	5,629
相鉄ホールディングス	1	0.8	1,794
東急	6.1	4.6	7,217
小田急電鉄	3.6	2.9	8,360
京王電鉄	1.3	1	6,840

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7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
京成電鉄	1.7	1.4	5,166
東日本旅客鉄道	4.2	3.2	26,819
西日本旅客鉄道	2.2	1.6	11,009
東海旅客鉄道	2	1.5	26,632
西武ホールディングス	3.2	2.2	3,141
近鉄グループホールディングス	2.3	1.7	6,987
阪急阪神ホールディングス	3	2.3	8,314
南海電気鉄道	—	1.1	2,654
京阪ホールディングス	1.4	1	3,615
名古屋鉄道	2.5	1.9	4,206
日本通運	0.8	0.6	5,388
ヤマトホールディングス	4	2.4	7,156
山九	0.6	0.4	1,948
日立物流	0.4	0.4	1,412
九州旅客鉄道	—	1.3	3,508
空運業 (0.6%)			
日本航空	4	4.2	10,907
ANAホールディングス	4.2	4.6	12,732
情報・通信業 (7.8%)			
システナ	—	0.6	1,167
日鉄ソリューションズ	0.4	0.3	994
T I S	2.4	1.8	5,045
コーエーテクモホールディングス	—	0.5	2,530
ネクソン	6.6	4.5	11,146
コロブラ	0.8	—	—
ティーガイア	0.2	0.2	390
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	0.6	0.4	860
GMOペイメントゲートウェイ	0.5	0.4	5,120
アカツキ	0.1	0.1	357
野村総合研究所	3.6	3.1	10,524
インフォコム	—	0.2	617
オービック	0.8	0.6	12,102
ジャストシステム	—	0.3	1,770
Zホールディングス	32.5	24.5	12,379
トレンドマイクロ	1.1	1	5,460
日本オラクル	0.5	0.4	3,960
伊藤忠テクノソリューションズ	1.1	0.8	2,732
大塚商会	1.3	1	5,930
東映アニメーション	—	0.1	1,237

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デジタルガレージ	0.4	0.3	1,422
日本ユニシス	0.7	0.6	1,890
日本テレビホールディングス	2	—	—
日本電信電話	24.1	19.4	57,230
KDD I	17.6	14.3	53,281
光通信	0.2	0.2	4,238
NTTドコモ	17.5	—	—
東宝	1.4	1.1	5,032
エス・ティ・ティ・データ	6.3	4.7	8,210
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1	0.8	4,560
カプコン	1.1	1.5	4,980
S C S K	0.5	0.4	2,516
コナミホールディングス	0.9	0.6	4,326
ソフトバンクグループ	11.4	7.4	60,332
卸売業 (5.1%)			
双日	13.1	9.9	3,465
アルフレッサ ホールディングス	2.6	1.9	3,165
神戸物産	0.8	1.2	3,418
ダイワボウホールディングス	0.2	1	1,773
TOKAIホールディングス	1.3	0.9	794
シップヘルスケアホールディングス	0.4	0.6	1,567
コマダホールディングス	0.5	0.4	809
第一興商	0.5	0.4	1,704
メディアパルホールディングス	2.6	1.8	3,853
日本ライフライン	0.7	0.6	823
伊藤忠商事	16.6	12.5	41,800
丸紅	24.7	17.6	17,828
豊田通商	2.7	1.8	9,144
兼松	0.9	0.7	1,042
三井物産	20.9	14.5	37,011
住友商事	15	11.3	17,594
三菱商事	16.7	10.9	33,659
岩谷産業	0.5	0.4	2,564
PALTAC	0.4	0.3	1,716
日鉄物産	0.2	0.1	436
ミスミグループ本社	3	2.2	7,953
小売業 (4.5%)			
ローソン	0.6	0.5	2,510
エービーシー・マート	0.4	0.3	1,992

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7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	千円	
日本マクドナルドホールディングス	1	0.7	3,468	
セリア	0.6	0.4	1,544	
ビックカメラ	1.4	1.1	1,230	
Monotaro	1.7	2.5	6,387	
J. フロント リテイリング	2.8	2.1	2,433	
マツモトキヨシホールディングス	1	0.7	3,563	
ZOZO	1.6	1.1	4,196	
ウエルシアホールディングス	0.7	0.9	3,073	
クリエイトSDホールディングス	0.4	0.3	973	
すかいらーくホールディングス	2.7	2	3,170	
コスモス薬品	0.2	0.2	3,088	
セブン&アイ・ホールディングス	9.3	7	34,888	
ツルハホールディングス	0.5	0.4	5,444	
クスリのアオキホールディングス	0.2	0.2	1,572	
FOOD & LIFE COMPANIES	—	1	4,820	
ノジマ	0.4	0.3	904	
良品計画	3.2	2.3	4,830	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	5.2	3.6	8,100	
ゼンショーホールディングス	1.1	1	2,715	
ワークマン	0.2	0.2	1,460	
ユナイテッドアローズ	0.2	—	—	
スギホールディングス	0.5	0.4	3,376	
ファミリーマート	1.9	—	—	
しまむら	0.3	—	—	
丸井グループ	2.2	1.5	3,306	
イオン	9.1	6.9	20,727	
イズミ	0.5	0.4	1,706	
ヤオコー	0.3	0.2	1,256	
ケーズホールディングス	2.3	1.5	1,960	
アインホールディングス	0.3	0.3	2,100	
ニトリホールディングス	1	0.7	12,911	
ファーストリテイリング	0.3	0.2	16,824	
サンドラッグ	0.9	0.7	2,481	
銀行業 (5.5%)				
めぶきフィナンシャルグループ	12.4	9.3	2,194	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	13.6	10.9	4,479	
新生銀行	1.7	1.5	2,469	
あおぞら銀行	1.4	1.1	2,763	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	120.1	114.8	72,209	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
りそなホールディングス	26.1	19.5	9,145	
三井住友トラスト・ホールディングス	4.5	3.4	12,648	
三井住友フィナンシャルグループ	15.9	12.4	49,699	
千葉銀行	7.9	6	4,194	
ふくおかフィナンシャルグループ	—	1.6	3,195	
セブン銀行	8	6	1,410	
みずほフィナンシャルグループ	323.4	24.3	41,115	
証券、商品先物取引業 (0.9%)				
FPG	0.7	0.6	484	
SBIホールディングス	2.7	2.2	6,111	
大和証券グループ本社	19.1	13.4	8,616	
野村ホールディングス	41.9	27.4	16,577	
松井証券	1.4	—	—	
保険業 (2.4%)				
SOMPOホールディングス	4.5	3.2	14,096	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	6.2	4.4	15,065	
ソニーフィナンシャルホールディングス	2	—	—	
第一生命ホールディングス	13.5	9.5	21,812	
東京海上ホールディングス	8.4	5.9	31,264	
T&Dホールディングス	7.1	5.4	8,159	
その他金融業 (1.2%)				
全国保証	0.7	0.5	2,337	
芙蓉総合リース	0.2	0.2	1,472	
東京センチュリー	0.5	0.4	2,608	
イオンフィナンシャルサービス	1.5	1.1	1,442	
アコム	—	3.6	1,814	
オリエントコーポレーション	6.4	4.8	758	
オリックス	14.9	10.9	21,543	
三菱HCキャピタル	6	4	2,516	
日本取引所グループ	6.8	4.8	12,326	
不動産業 (2.4%)				
いちご	3	2	700	
ヒューリック	5	3.8	4,833	
野村不動産ホールディングス	1.4	1.1	3,223	
プレサンスコーポレーション	0.4	—	—	
オープンハウス	0.7	0.6	3,114	
東急不動産ホールディングス	6.5	4.9	3,464	
飯田グループホールディングス	2	1.5	4,530	
パーク24	1.3	1	2,478	

しんきんJ P X日経400マザーファンド ー第7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
三井不動産	11.7	8.2	22,152
三菱地所	16.7	11.8	21,688
東京建物	2.5	1.8	3,033
住友不動産	5.4	4	15,280
スターツコーポレーション	0.3	0.2	560
イオンモール	1.2	0.9	1,652
日本空港ビルデング	0.8	0.6	3,072
サービス業 (5.3%)			
ミクシィ	0.6	0.4	1,068
ジェイエイシーリクルートメント	0.2	—	—
日本M&Aセンター	1.7	2.8	7,529
UTグループ	0.4	0.3	878
エス・エム・エス	0.7	0.6	1,830
パーソルホールディングス	2.3	1.7	3,692
総合警備保障	0.9	0.7	3,563
カカコム	1.7	1.3	4,472
ディップ	0.3	0.3	1,051
ベネフィット・ワン	0.8	0.6	1,941
エムスリー	5.1	3.1	22,304
アウトソーシング	1.3	1	1,961
ディー・エヌ・エー	1.1	—	—
博報堂DYホールディングス	3.2	2.4	4,444

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
電通グループ	2.4	2	7,830	
オリエンタルランド	2.5	1.8	30,501	
リゾートトラスト	1.1	—	—	
ユー・エス・エス	2.6	1.9	3,551	
サイバーエージェント	1.4	—	—	
楽天グループ	10.7	8.1	10,400	
エン・ジャパン	0.4	0.3	1,137	
テクノプロ・ホールディングス	0.5	0.3	2,373	
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.1	1,284	
リクルートホールディングス	16.5	11.5	65,630	
ペイカレント・コンサルティング	—	0.1	3,780	
リログループ	1.3	0.9	1,997	
エイチ・アイ・エス	—	0.3	769	
カナモト	0.4	0.3	800	
セコム	2.4	1.7	14,684	
メイテック	0.3	0.2	1,256	
合 計	株 数・金 額	2,012	1,314	3,765,512
	銘柄数<比率>	398	399	<97.6%>

(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	柄	別	当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 98	百万円 —

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) ー印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2021年6月7日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,765,512	96.0
コール・ローン等、その他	156,508	4.0
投資信託財産総額	3,922,020	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 (2021年6月7日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	3,922,015,544
コール・ローン等	128,811,099
株式(評価額)	3,765,512,070
未収入金	2,133,900
未収配当金	23,343,475
差入委託証拠金	2,215,000
(B) 負債	63,001,720
未払解約金	63,000,000
未払利息	317
その他未払費用	1,403
(C) 純資産総額(A-B)	3,859,013,824
元本	2,126,714,004
次期繰越損益金	1,732,299,820
(D) 受益権総口数	2,126,714,004口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,145円

(注1) 当親投資信託の期首元本額は2,983,423,305円、期中追加設定元本額は652,573,184円、期中一部解約元本額は1,509,282,485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2,126,714,004円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1.8145円です。

○損益の状況 (2020年6月6日~2021年6月7日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	76,915,530
受取配当金	77,035,631
その他収益金	18,049
支払利息	△ 138,150
(B) 有価証券売買損益	735,029,923
売買益	877,970,381
売買損	△ 142,940,458
(C) 先物取引等取引損益	41,792,900
取引益	52,894,500
取引損	△ 11,101,600
(D) 保管費用等	△ 24,560
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	853,713,793
(F) 前期繰越損益金	1,372,826,726
(G) 追加信託差損益金	401,526,816
(H) 解約差損益金	△ 895,767,515
(I) 計(E+F+G+H)	1,732,299,820
次期繰越損益金(I)	1,732,299,820

(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。