

【表紙】

【提出書類】

有価証券報告書

【提出先】

関東財務局長殿

【提出日】

平成21年4月17日

【計算期間】

第2特定期間（自 平成20年7月19日
至 平成21年1月19日）

【ファンド名】

しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）
（愛称：金利の卵）

【発行者名】

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

【代表者の役職氏名】

代表取締役社長 岡野 悦夫

【本店の所在の場所】

東京都中央区京橋三丁目8番1号

【事務連絡者氏名】

野呂 俊夫

【連絡場所】

東京都中央区京橋三丁目8番1号

【電話番号】

03－5524－8161

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

第一部 【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的および基本的性格】

①ファンドの目的

主として、投資信託証券に投資し、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運用を行います。

②ファンドの基本的性格

当ファンドは、以下の「商品分類」および「属性区分」に該当します。

1. 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2. 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回			
債券 一般	年2回	グローバル (日本除く)	ファミリーファ ンド	あり ()
公債	年4回	日本		
社債		北米		
その他債券	年6回	欧州		
クレジット属性 ()	(隔月)	アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (債券))	日々	中南米	ファンド・オブ ・ファンズ	なし
資産複合 ()	その他 ()	アフリカ		
資産配分固定型		中近東 (中東)		
資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<商品分類の定義>

- 「追加型投信」…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- 「海外」…目論見書又は投資信託約款（以下、「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「債券」…目論見書等において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるもの

<属性区分の定義>

- 「その他資産（投資信託証券（債券））」…目論見書等において、投資信託証券を通じて主として債券に投資する旨の記載があるもの
- 「年6回」…目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
- 「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- 「ファンド・オブ・ファンズ」…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
- 「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないもの

※当ファンドが属さない商品分類および属性区分の定義については、社団法人投資信託協会ホームページ（<http://www.toushin.or.jp>）をご参照ください。

③ファンドの基本コンセプト

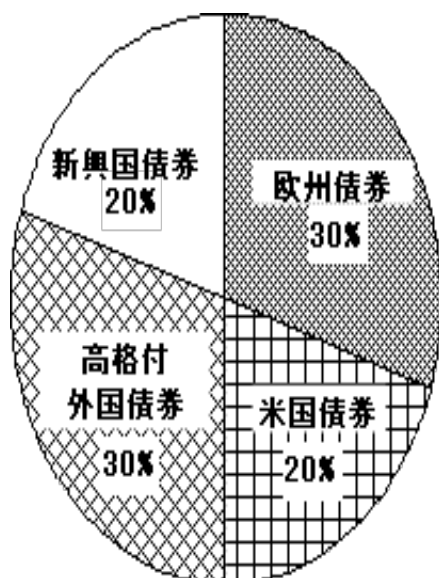
新興国を含む外国の債券に分散投資します。

④ファンドの特色

●4つの投資信託証券に投資します。

- 運用にあたっての資金配分は、原則として当ファンドの純資産総額に対してそれぞれ以下に定める範囲内で投資します。

欧州債券	「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」	30%（±10%）
米国債券	「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」	20%（±10%）
高格付外国債券	「しんきん高格付外国債券マザーファンド」	30%（±10%）
新興国債券	「ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」	20%（±10%）



欧州債券

- 主としてEMU（欧州経済通貨同盟）参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。

米国債券

- 主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。

高格付外国債券

- 日本、米国、EMU（欧州経済通貨同盟）参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とします。
- 投資対象とする公社債は、組入れ時において、格付機関であるムーディーズ社またはスタンダード＆プアーズ社のいずれかからAA格以上の格付けを取得しているものとします。

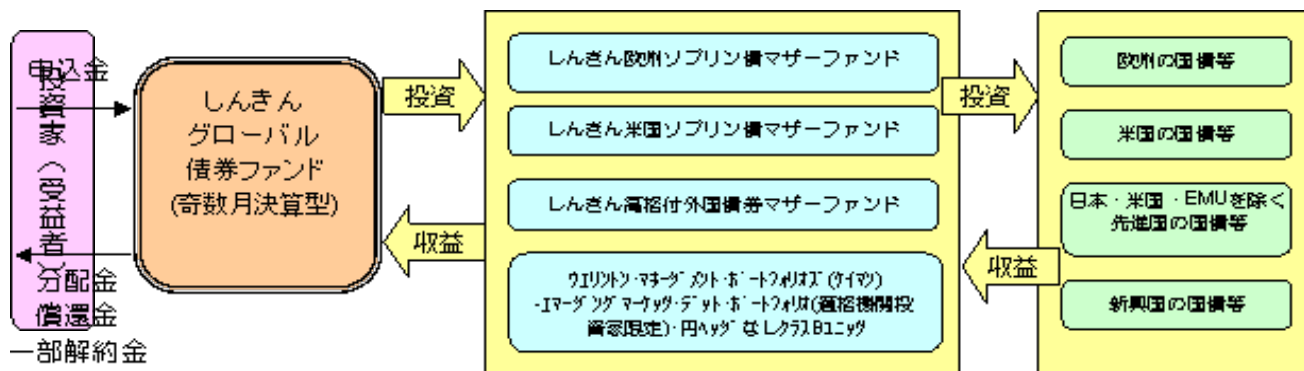
新興国債券

- 原則として、ドル建、ユーロ建および現地通貨建の新興国の国債、準ソブリン債[※]ならびに国際機関債に投資します。

※準ソブリン債とは、発行体が政府による利払い・元本の償還が遅滞なく行われるための直接的保証を受けており、政府の保有割合が半分以上であり、政府の緊密な関係に基づく恩恵を受けている企業の発行する債券を指します。

- 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。

●ファンド・オブ・ファンズの形態で運用を行います。



「しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）」は、複数の投資信託証券を投資対象として運用を行うファンドです。このような投資信託を「ファンド・オブ・ファンズ」といいます。

「ファンド・オブ・ファンズ」とは「主として投資信託証券に投資する」ファンドのことをいいます。

組入れ投資信託証券の運用成果は投資割合に応じて、すべて「しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）」に反映されます。

●新興国の債券への投資は、ウエルントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーが運用する外国投資信託[※]への投資を通じて行います。

※ケイマン籍円建外国投資信託

「ウエルントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）ーエマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」

～ウエルントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー～

- ・ウエルントン・マネージメント・グループの中核会社であり、1928年から運用業務を展開する米国の大手運用会社のひとつです。
- ・米国のマサチューセッツ州ボストンに本拠を構え、グループ全体では、米国内拠点に加え世界各地にグローバルな事業展開を図っており、40ヵ国以上の顧客に対してサービスを提供しています。

（ご参考）新興国とは

米国、日本、西欧諸国などの先進国に対して、ラテン・アメリカ、東南アジア、東欧諸国などの経済成長が初期段階にあり、今後高い経済成長が期待される国・地域をいいます。（発展途上国、エマージング・カントリーとも呼ばれます）

地 域		先進国	新興国			
			アフリカ	欧州	ラテン・アメリカ	アジア
格付※ 信用力が 高い  信用力が 低い	AAA	米・カナダ 独・仏・英・豪 ノルウェー				
	AA- ～ AA+	日本			チリ	
	A- ～ A+	ギリシャ イタリア ポルトガル	南アフリカ		メキシコ	マレーシア
	BBB- ～ BBB+		エジプト モロッコ	ブルガリア ハンガリー カザフスタン ロシア	ブラジル コロンビア ペルー	インド
	BB- ～ BB+		ナイジェリア		ベネズエラ パナマ ウルグアイ	インドネシア フィリピン ベトナム
	B- ～ B+		ガーナ	ウクライナ	アルゼンチン	

※自国通貨建長期債格付

出所：ブルームバーグおよびS & Pのデータをもとにしんきんアセットマネジメント投信が作成

○上記は投資対象国を示したのではなく、上記国の債券を組入れることを約束するものでも推奨するものでもありません。

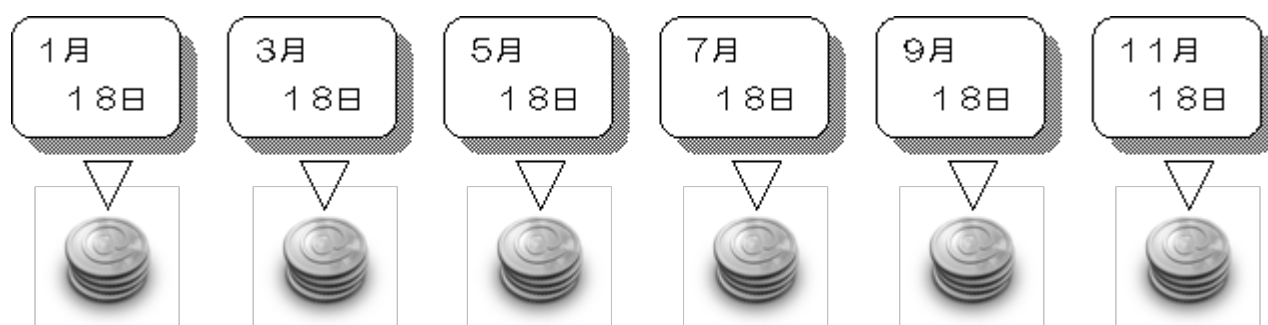
○格付けは2009年2月末現在

●収益の分配は、年6回の決算時（1月、3月、5月、7月、9月、11月の各18日、休日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づいて分配します。

○原則として、毎年隔月（奇数月）の18日（休業日の場合、翌営業日）を決算日とし、収益分配を行うことを目指します。ただし、第1計算期間は平成20年2月6日から平成20年5月19日までとします。

- ・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。）等とします。
- ・分配金は、利子・配当収益等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決定します。

《収益分配金のお支払いのイメージ》



- ※上記の図はイメージであり、将来の分配金をお約束するものではありません。
- ※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配を保証するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ※当ファンドは自動けいぞく投資専用ファンドですので、分配金は自動的に再投資されます。（再投資の際に、申込手数料はかかりません。）
- ※分配金をお受け取りになる場合には、事前に販売会社所定の手続きを行っていただく必要があります。
- ※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

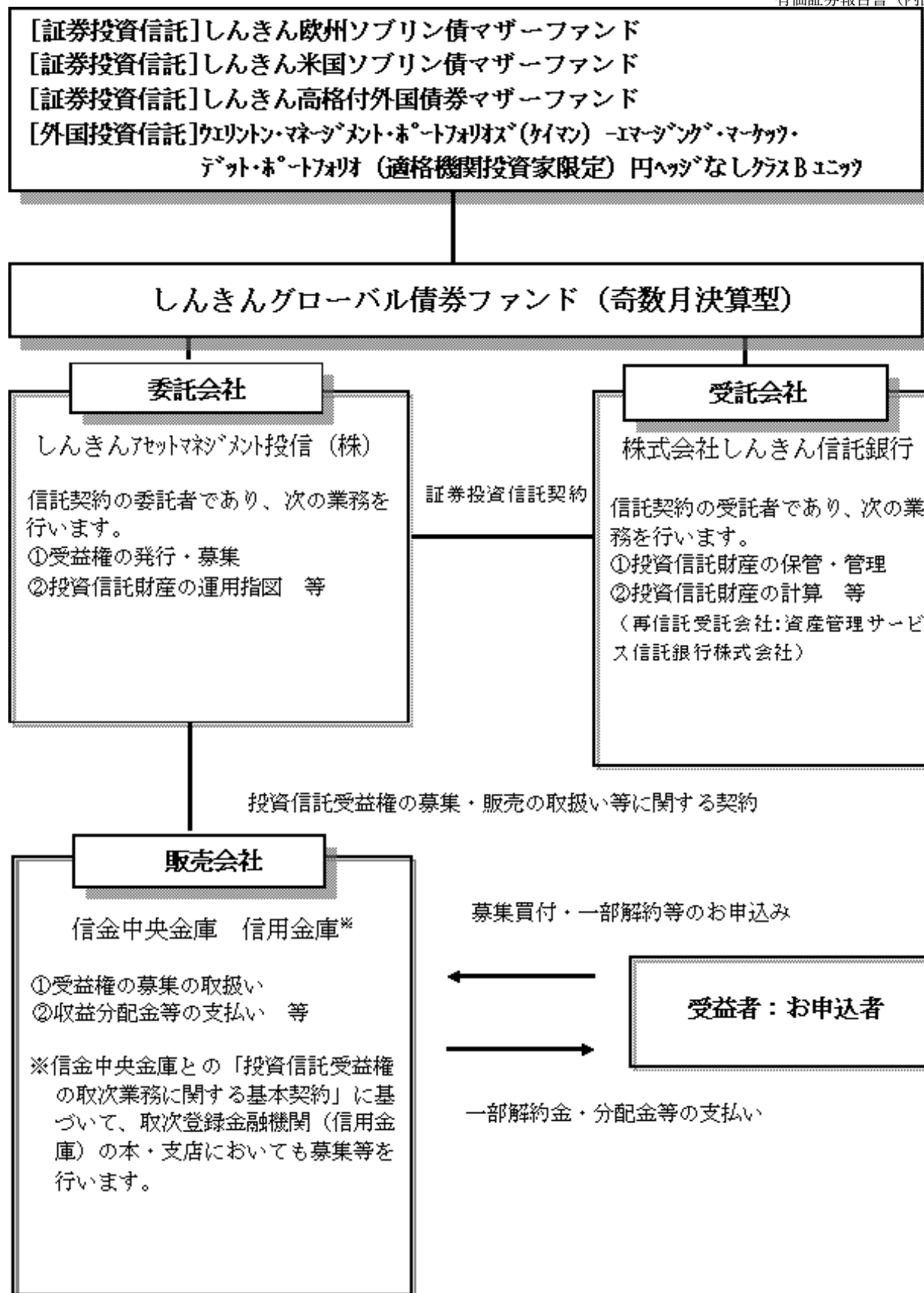
●外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

●投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。

⑤信託金の限度額

- ・3,000億円を限度額として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの仕組み】



<委託会社の概況>（平成21年4月17日現在）

①名称

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

②本店の所在の場所

東京都中央区京橋三丁目8番1号

③資本の額

200百万円

④会社の沿革

平成 2 年12月 全信連投資顧問株式会社として設立

平成 3 年 3 月 投資顧問業の登録

平成 4 年 3 月 投資一任契約に係る業務の認可

平成10年11月 「しんきんアセットマネジメント投信株式会社」に商号変更

平成10年12月 証券投資信託委託業の認可

平成19年 9 月 金融商品取引業者（投資運用業、投資助言・代理業）の登録

⑤大株主の状況

名 称	住 所	所有株式数	比 率
信金中央金庫	東京都中央区八重洲一丁目3番7号	4,000株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

①投資対象

投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

②投資態度

- 1) 主として、投資信託証券に投資し、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運用を行います。
- 2) 運用にあたっては、新興国を含む世界各国の公社債等（日本を除く）への分散投資を目的として、以下に掲げるマザーファンドの受益証券およびケイマン籍円建外国投資信託の受益証券に、それぞれ以下に定める範囲内で投資します。

- ・証券投資信託「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」・・・30%（±10%）
- ・証券投資信託「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」・・・20%（±10%）
- ・証券投資信託「しんきん高格付外国債券マザーファンド」・・・30%（±10%）
- ・外国投資信託「ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」・・・20%（±10%）

- 3) 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 4) 投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 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。

(2) 【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類

1. 特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- 1)有価証券
- 2)金銭債権
- 3)約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

- 1)為替手形

②投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次のしんきんアセットマネジメント投信株式会社を委託者とし、株式会社しんきん信託銀行を受託者として締結されたマザーファンド（その受益権を他の証券投資信託の投資信託財産に取得させることを目的とした証券投資信託であり、以下「マザーファンド」といいます。）および外国投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1) 証券投資信託 しんきん欧州ソブリン債マザーファンド
- 2) 証券投資信託 しんきん米国ソブリン債マザーファンド
- 3) 証券投資信託 しんきん高格付外国債券マザーファンド
- 4) ケイマン籍円建外国投資信託 ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット
- 5) 短期社債等（社振法第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
- 6) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

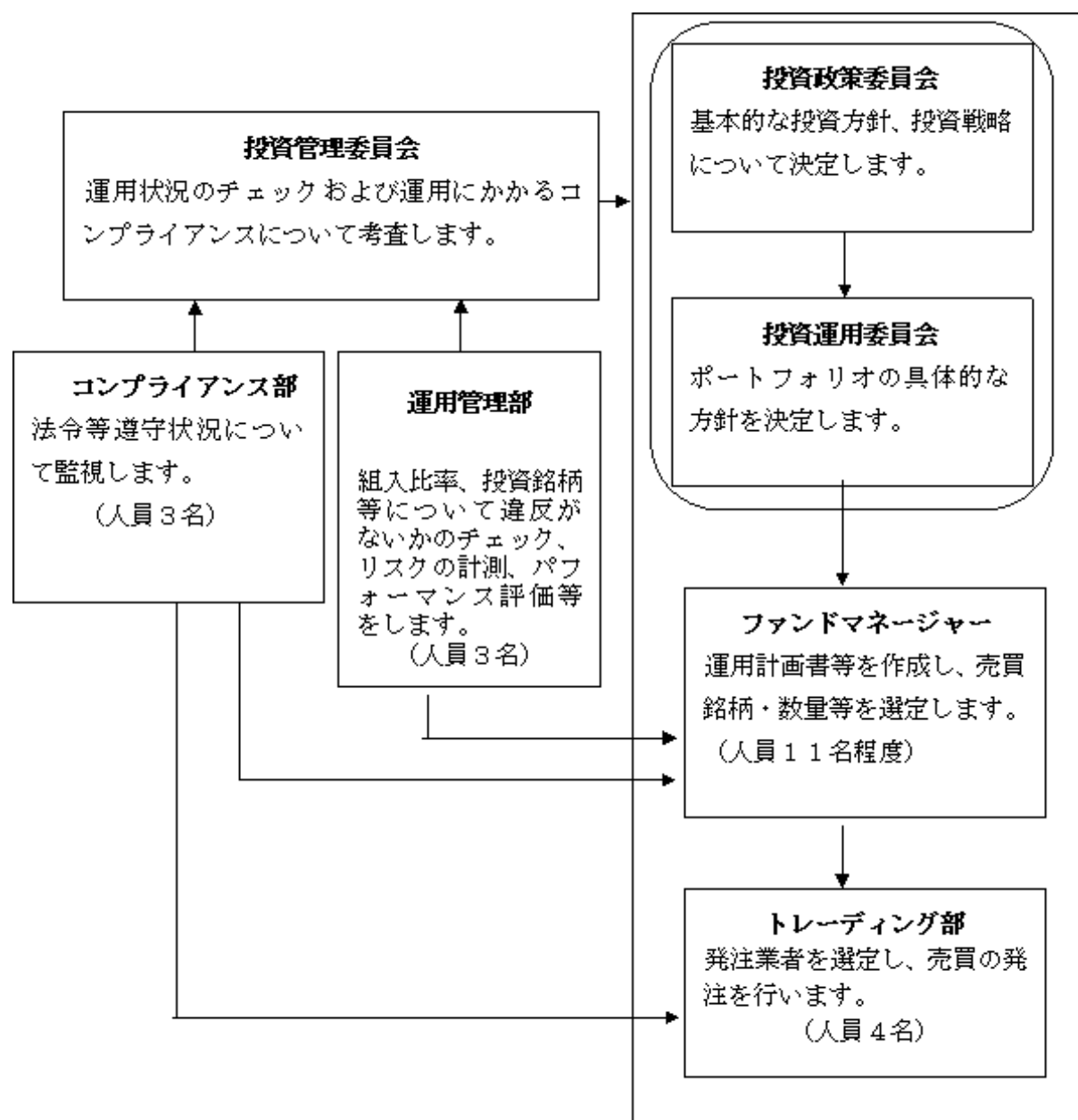
③委託会社は、信託金を、②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下同じ。）により運用することの指図をすることができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

④上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を上記③に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



《投資決定プロセス》

- ① 信金中央金庫グループ及び内外の調査機関からの情報に基づき、投資環境等について当社独自の綿密な調査・分析を行います。
- ② 投資政策委員会においては、ファンダメンタルズ分析、市場分析を踏まえて基本的な投資方針を策定します。また、投資運用委員会においては、基本的な投資方針に基づき当面の運用に当たってのガイドラインを決定し、併せて個別銘柄についての分析を行い投資対象銘柄を選定します。

※ファンドの運用体制等は平成21年4月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

年6回の決算（1月、3月、5月、7月、9月、11月の各18日、休日の場合は翌営業日）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、経費等控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②分配金額は、委託会社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、分配を行わないこともあります。
- ③留保益は、投資信託約款の運用の「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

（5）【投資制限】

「しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）」投資信託約款では、ファンドの運用に関して一定の制限および限度を定めています。かかる制限、限度は以下のとおりです。

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②同一銘柄の投資信託証券への投資は、原則として投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- ③前項の規定にかかわらず、約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されること（投資信託委託会社または販売会社による自己設定が行われる場合も含みます。）が定められている投資信託証券については、信託財産の純資産総額に対する同一銘柄の時価総額の制限を設けません。
- ④外貨建資産への直接投資は行いません。
- ⑤委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、投資信託財産において一部解約代金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

1) ⑤の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

- イ. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による、受取りの確定している資金の額の範囲内。
- ロ. 一部解約金支払日の前営業日において確定した、当該支払日における当該支払資金の不足額の範囲内。
- ハ. 借入指図を行う日における、投資信託財産の純資産総額の10%以内。

2) ⑤の借入期間は、有価証券等の売却等の代金の入金日までに限るものとします。

3) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

＜参考＞マザーファンド（しんきん欧州ソブリン債マザーファンド）の概要

(1)投資方針

①投資対象

EMU（欧州経済通貨同盟）参加国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。

②投資態度

- 1) 主としてEMU参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- 2) シティグループEMU国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）※をベンチマークとします。
- 3) 運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。
- 4) 外貨建資産の組入れ比率については原則として高位を保ちます。
- 5) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 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。

※「シティグループEMU国債インデックス」は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券インデックスで、2009年3月末現在、EMU加盟16ヵ国のうち11ヵ国（ドイツ、フランス、イタリア、ベルギー、オランダ、スペイン、オーストリア、フィンランド、アイルランド、ポルトガル、ギリシャ）の国債で構成されています。

(2)投資対象

①投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限ります。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

②投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 5) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 8) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、外国投資信託は除きます。）のうち公社債投資信託の受益証券
- 9) 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、外国投資証券およびクローズド・エンド型のものは除きます。）のうち公社債に投資する投資証券
- 10) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号の定めるもので、第1号から第5号までの証券の性質を有するものとします。）
- 11) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 12) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券

に限ります。）

- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号から第5号までの証券および第7号の証券または証書のうち第1号から第5号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第8号から第9号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ③委託会社は、信託金を②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下同じ。）により運用することの指図をすることができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形

- ④②項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変化等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を上記③に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)投資制限

- ①株式への投資は行いません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④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。

<参考>マザーファンド（しんきん米国ソブリン債マザーファンド）の概要

(1)投資方針

①投資対象

米国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。

②投資態度

- 1) 主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- 2) シティグループ米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）※をベンチマークとします。
- 3) 運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。
- 4) 外貨建資産の組入れ比率については原則として高位を保ちます。
- 5) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 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。

※「シティグループ米国国債インデックス」は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した債券インデックスで、米国の国債で構成されています。

(2)投資対象

①投資の対象とする資産

前記「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」と同じ

②投資の対象とする有価証券の範囲等

前記「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」と同じ

(3)投資制限

前記「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」と同じ

◇「シティグループEMU国債インデックス」と「シティグループ米国国債インデックス」は「シティグループ世界国債インデックス」のサブ・インデックスです。

◇「シティグループ世界国債インデックス」は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した、世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。2009年3月末現在の構成市場は、米国、日本、EMU圏（ドイツ、フランス、イタリア、ベルギー、オランダ、スペイン、オーストリア、フィンランド、アイルランド、ポルトガル、ギリシャ）、カナダ、オーストラリア、デンマーク、スウェーデン、スイス、イギリス、ポーランド、ノルウェー、シンガポール、マレーシアの23ヵ国です。

上記の指数は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産です。同社は各指数の算出、公表、利用に関する一切の権利を有しております。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。また、上記の合成指数は当社が独自に計算したものです。

<参考>マザーファンド（しんきん高格付外国債券マザーファンド）の概要

(1)投資方針

①投資対象

日本、米国、EMU（欧州経済通貨同盟）参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とします。

②投資態度

- 1) 投資対象とする公社債は、組入れ時において、格付機関であるムーディーズ社またはスタンダード&プアーズ社のいずれかからAA格以上の格付けを取得しているものとします。
- 2) 国別の投資配分比率は、各国の市場規模・経済規模等を勘案し決定します。
- 3) 各国のマクロ経済等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、債券ポートフォリオの構築を図ります。
- 4) 外貨建資産の組入れ比率については、原則として高位を保ちます。
- 5) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 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。

(2)投資対象

①投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条、第18条および第19条に定めるものに限り。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

②投資の対象とする有価証券の範囲等

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 5) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 8) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、外国投資信託は除きます。）のうち公社債投資信託の受益証券
- 9) 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、外国投資証券およびクローズド・エンド型のものは除きます。）のうち公社債に投資する投資証券
- 10) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるもので、第1号から第5号までの証券の性質を有するものとします。）
- 11) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 12) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

なお、第1号から第5号までの証券および第7号の証券または証書のうち第1号から第5号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第8号から第9号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

- ③委託者は、信託金を前項に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。以下同じ。）により運用することの指図をすることができます。

- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
- ④②項の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変化等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前項1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3)投資制限

- ①株式への投資は行いません。
- ②投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ③同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ④外貨建資産への投資割合には制限を設けません

＜参考＞ケイマン籍円建外国投資信託「ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」の概要

(1)投資方針

①主な投資対象

- 1)当ポートフォリオは、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドの構成国または地域に属し、営業活動を行う発行体によって発行された新興国債券への投資および外国為替取引を行います。そのような取引対象は、米ドル建ておよびユーロ建て、または現地通貨建てですが、現地通貨建ての債券投資および現地通貨取引に制限は設けません。
- 2)当ポートフォリオは、ソブリン、準ソブリン政府関連機関および国際機関、または政治的な機関から発行された債券を売買します。これらの債券はその他の固定金利型および変動金利型債券ならびにそれらに関する先渡契約と同様に、不動産担保証券、商業不動産担保証券抵当および資産担保証券、社債、ローン・パーティシペーション証券、クレジット証券、指数連動型証券等の形態をとる可能性があります。当ポートフォリオはヘッジ目的および当ポートフォリオの投資目的追求のため、これらの証券の空売りのポジションを保有することがあります。また、当ポートフォリオは複数の通貨で、制限なしに現金および現金同等物を保有することがあります。買い現先取引、売り現先取引およびダラーロール取引を行うことができます。
- 3)当ポートフォリオは、投資運用者が流動性についてポートフォリオの投資目的に合致すると判断した Rule 144Aおよび／またはRegulation Sに従って発行された私募証券、銀行ローン、トレード・ファイナンス・ローンを含む、その他の規制証券を保有することがあります。
- 4)当ポートフォリオは、その投資が投資管理費用等の二重徴求にならない限りにおいて、定められたポートフォリオの投資目的に合致する、投資運用者またはその関連会社が運用又は出資している投資信託のシェアまたは合同運用商品に投資することがあります。
- 5)当ポートフォリオは、金利先物、クレジット先物、指数先物および通貨先物、通貨スワップ、金利スワップ、トータル・レート・オブ・リターン・スワップおよびクレジット・デフォルト・スワップ、通貨オプション、債券オプションおよびスワップション、デリバラブル通貨フォワード契約およびノンデリバラブル通貨フォワード契約、債券先渡契約、TBA（to-be-announced）証券およびその他の派生商品取引（「デリバティブズ」と総称します。）の取引所取引および店頭取引を行うことがあります。また当ポートフォリオではデリバティブズの売りポジションを保有することがありますが、そのような場合は全て、ヘッジを含むリスク管理目的およびポートフォリオの投資目的に合致する効率的な投資エクスポージャーを取るために行います。

②投資態度および主な投資制限

- 1)当ポートフォリオはJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドをベンチマークとし、これを上回る運用成果を目指します。
- 2)当ポートフォリオ全体の金利予想はデュレーションでインデックス±1年の範囲に制限します。個別銘柄のデュレーションには制限を設けませんが、また、防衛的投資戦略の結果、個別証券および国別のレベルでデュレーションがマイナスになることがあります。
- 3)広範なクレジットに対して投資を行います。ポートフォリオ内の個別証券および通貨に対する格付けの制限は行いません。
- 4)一般的に当ポートフォリオでは国、通貨、発行体および投資戦略の分散を行います。時として集中したポジションを保有することがあります。
- 5)いかなる一つの発行体に対するネットの信用エクスポージャーも投資時点においてインデックス+10%のポートフォリオ資産を超過しません。この制限はOECD加盟国、同準ソブリン機関およびその傘下団体、または国際機関およびそれらの地域・国際関連機関ならびに機構が発行または保証する債券については

適用されません。

- 6) 保有現金および現金同等物については、ネットのエクスポージャーに関する制限が適用されません。
- 7) すべてのネットの信用エクスポージャーの買い持ち合計(保有現金および現金同等物を除きます。)は、ポートフォリオの純資産総額の100%に制限されます。すべてのネットの信用エクスポージャーの売り持ち合計はポートフォリオの純資産総額の100%に制限されます。これらの制限はOECD加盟国、同準ソブリン機関およびその傘下団体、または国際機関およびそれらの地域・国際関連機関ならびに機構が発行または保証する債券については適用されません。
- 8) デリバティブのポジションを含む、いかなる通貨の買い持ちポジションの合計はインデックス+100%のポートフォリオ資産を超過しません。
- 9) 金融商品取引法（昭和23年法律第25号、改正を含む。）において定義された有価証券以外への投資がポートフォリオ純資産総額の50%を超過する新規投資、追加投資を行いません。
- 10) ポートフォリオは空売りを行った現物有価証券の受渡代金がポートフォリオの純資産総額を超過する空売りを行いません。
- 11) 当ポートフォリオは純資産総額の10%を超過した借入れを行いません。しかしながら、合併等により一時的に超過する場合には適用されないものとします。
- 12) 当ポートフォリオで保有する一企業の同種の有価証券と、投資運用者が運用する他の投資ファンドで保有する同種の有価証券との総計は、当該企業の発行済み株式の50%を超えないものとします。
- 13) 私募有価証券、非上場有価証券、不動産等のように速やかに資金化のできない流動性の低い資産に対して、当ポートフォリオの純資産総額の15%を超過する投資は行いません。上記の比率はその投資時点の市場実勢価格に基づいて計算されます。
- 14) 当ポートフォリオでは、投資信託のシェアまたは合同運用商品に対し、純資産総額の5%を超過する投資は行いません。
- 15) 資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。

(2) その他

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
決算日と収益分配	決 算 日：年1回（毎年12月31日） 収益分配：年2回（毎年3月・9月の第1営業日、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。）
当初設定日	2008年1月31日
信託期間	2007年12月19日（信託契約締結日）から150年 ※運用会社は信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者はあらかじめ解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
信託報酬相当分	投資信託財産の純資産総額に対して・・・・・・運用会社：年率 0.50% 受託会社等：年率 0.20%

その他の費用	監査費用・信託財産に関する租税・信託事務の処理に要する諸費用・有価証券売買時の売買委託手数料、ファンド登録料等をファンドより実費として間接的にご負担いただきます。また、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。当ファンドの手数料等の合計額については、投資家の皆様がファンドを保有される期間等に応じて異なりますので、表示することができません。
販売会社	ウエリントン・グローバル・アドミニストレーター・リミテッド
運用会社	ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー
受託会社	ステート・ストリート・ケイマン・トラスト・カンパニー・リミテッド
監査法人	プライスウォーターハウスクーパース

3【投資リスク】

(1) リスク特性

① リスクについて

当ファンドは、主に投資信託証券に投資を行い、投資対象とする投資信託証券は、主に債券など値動きのある有価証券（外貨建証券は為替変動リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本は保証されているものではありません。投資信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

投資家の皆様におかれましては、投資信託説明書（目論見書）をよくお読みいただき、当ファンドの内容・リスクを十分にご理解のうえお申込みくださいますようお願いいたします。

ファンドの基準価額は、以下の要因等により変動する場合があります。

①金利リスク	金利リスクとは、金利変動により公社債等の価格が下落するリスクをいいます。一般的に金利低下局面では組入れた公社債等の価格は値上がりし、金利上昇局面では値下がります。また、残存期間が長期の公社債等の価格は、概して、短期のものより金利変動に対応して大きく変動します。組入有価証券の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。
②流動性リスク	流動性リスクとは、有価証券を売買する際に、需給動向により希望する時期、価格で売買することができなくなるリスクをいいます。ファンドが投資する有価証券の流動性が損なわれた場合には、基準価額が下落する要因となります。
③信用リスク	公社債等の発行体の財務状況の悪化や債務不履行、またその可能性が高まった場合には、当該発行体が発行する公社債および短期金融商品の価格は下落します。場合によっては投資資金が回収できなくなることもあります。組入れ証券等がこうした状況に陥った場合には、基準価額が下落する要因となります。特に、新興国の公社債等は、一般的に先進国の公社債等に比べ、格付けが低く、債務不履行の可能性が高くなること等から、当該公社債等の価格が大きく下落し、基準価額が下落する要因となります。
④カントリーリスク	海外の有価証券に投資する場合、投資する国の政治・経済情勢の悪化、外国為替規制、資本規制、制度変更等による影響を受けることがあり、基準価額が下落する要因となります。特に、新興国へ投資する場合、先進国に比べ厳格ではない開示・会計基準または規制慣習等のため、発行体や市場に関する投資判断に際して正確な情報を十分に確保できないことがあります。また、先進国の市場に比べ流動性が低く、市況動向や取引量等の状況によっては、保有債券を市場実勢から期待される価格で売却できない場合があります。
⑤為替変動リスク	外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高となった場合には、基準価額が下落する要因となります。
⑥同一マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドによる影響	当ファンドが投資対象とするマザーファンドについて、マザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドにおける資金流入や資産配分の変更等によりマザーファンド組入れ有価証券等の売買が発生した場合には、その売買による組入れ有価証券等の価格の変化や売買コスト等の負担がマザーファンドの価額に影響を及ぼすことがあります。これによりマザーファンドの価額が下落した場合には、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

②お買付けおよびご換金が制限される場合

金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お買付けおよびご換金の申込みの受付を中止することがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日のお買付けおよびご換金の申込みを撤回することができます。受益者がその申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にお申込みを受付けたものとして取扱います。

(2)投資リスクに対する管理体制

- ①投資リスク管理に係る組織は、投資管理委員会、運用管理部およびコンプライアンス部により構成されます。
- ②投資管理委員会は、社長、常勤役員以下各部の部長を構成メンバーとして原則毎月1回開催されます。運用管理部からの報告に基づいて各ファンドの運用・リスク状況を点検し、商品性に即した投資成果が得られているかを確認します。
- ③運用管理部は、当ファンドの運用状況をモニタリングして運用ガイドライン等にそって運用が行われているかをチェックします。また、当ファンドのリターンとリスクの計測・分析を行います。それらの情報を運用部門にフィードバックすることにより合理的な投資成果の追求を図ります。計測・分析にあたっては計量的な分析ツールを利用します。
- ④コンプライアンス部は、法令遵守の観点から投資リスク管理業務の一端を担います。

※投資リスクに対する管理体制等は平成21年4月17日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

①申込手数料は、買付け金額に応じて、買付け価額に2.10%（税抜2.00%）を上限に、販売会社が個別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（※買付け金額とは「買付申込日の翌営業日の基準価額×申込口数」をいいます。）

②収益分配金の再投資に際しては、申込手数料はかかりません。申込手数料は、販売会社にご確認ください。また下記においてもご照会いただけます。

お電話によるお問合わせ先（9：00～17：00 土、日、祝日を除きます。）

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

電話番号：03-5524-8181

③申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等相当額」といいます。）が課されます。

(2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はありませんが、一部解約時に基準価額の0.1%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

※「信託財産留保額」とは、運用の安定性を確保するために、換金する受益者が負担する金額で投資信託財産に留保される額です。

(3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に年率0.9975%（税抜0.95%）を乗じて得た額とします。

○当ファンドの信託報酬の配分は、以下の通りです。

時期	項目	費用・税金
毎日	信託報酬の総額	純資産総額に対し 年率0.9975% （税抜0.95%）
	信託報酬の配分	委託会社 純資産総額に対し 年率0.420% （税抜0.40%）
		販売会社 純資産総額に対し 年率0.525% （税抜0.50%）
		受託会社 純資産総額に対し 年率0.0525% （税抜0.05%）

・上記の信託報酬は、毎計算期間末または信託終了のときに投資信託財産から支払われます。

（注）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。

○受益者が当ファンドを保有する場合の実質的な信託報酬率は、以下の通りです。

当ファンドの信託報酬	年率0.9975%（税抜年率0.95%）
投資対象とする投資信託証券の信託報酬	年率0.140%±0.07%程度
実質的な信託報酬率	年率1.1375%±0.07%程度（税込み）

◇投資対象とする投資信託証券の信託報酬率は、外国投資信託「ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ(ケイマン)-エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」の信託報酬率であり、当ファンドの組入比率をもとに算出しております。

（信託報酬率0.7%×組入比率20%±10%）

- ◇当ファンドの実質的な信託報酬は、投資対象とする外国投資信託の純資産総額や組入状況によって変動します。
- ◇投資対象とする投資信託証券「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」及び「しんきん高格付外国債券マザーファンド」の信託報酬はありません。

（4）【その他の手数料等】

- ①投資信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的とし資金の借入の指図を行った場合、当該借入金の利息は投資信託財産から支払われます。
- ②投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息および投資信託財産にかかる監査費用ならびに当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、投資信託財産から支払われます。
- ③ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料にかかる消費税等相当額、先物取引・オプション取引等に要する費用は投資信託財産から支払われます。
- ④投資信託財産にかかる監査費用および当該監査費用にかかる消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のときに投資信託財産から支払われます。

(5)【課税上の取扱い】

<個人の受益者>

時期	税金
収益分配時	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%（所得税15%および地方税5%）の税率が適用されます。 ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの間については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行われ、原則として確定申告の必要はありません。 なお、上場株式等の配当等（上場株式の配当金、公募株式投資信託の分配金等をいいます。）の金額の合計額が100万円（年間1銘柄あたり1万円以下のものは除きます。）以下の部分については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用されますが、100万円を超える場合は、その超える年分について確定申告を行い、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択する必要があります。 申告分離課税の場合の税率は、100万円を超える部分については20%（所得税15%および地方税5%）となります。
換金時および償還時	換金時および償還時の差益（解約の価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額を含みます。）を控除した利益）については、平成21年1月1日からは譲渡所得として申告分離課税が適用され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率となります。 ただし、平成21年1月1日から平成22年12月31日までの間については、上場株式等の譲渡益等（上場株式の譲渡益、公募株式投資信託の解約・償還差益等。）の金額の合計額のうち、500万円以下の部分については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用されます。

<法人の受益者>

時期	税金
収益分配金 ならびに 換金時および 償還時の差益 に対する課税	収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金ならびに換金時および償還時の個別元本超過額は、平成21年1月1日から平成21年3月31日までの間については、7%（所得税のみ）が源泉徴収され、平成21年4月1日以降については15%（所得税のみ）が源泉徴収されます。

※益金不算入制度の適用はありません。

※取得申込者によって取扱いが異なる場合があります。また、上記に記載の税制は平成21年2月末日現在の内容であり、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。

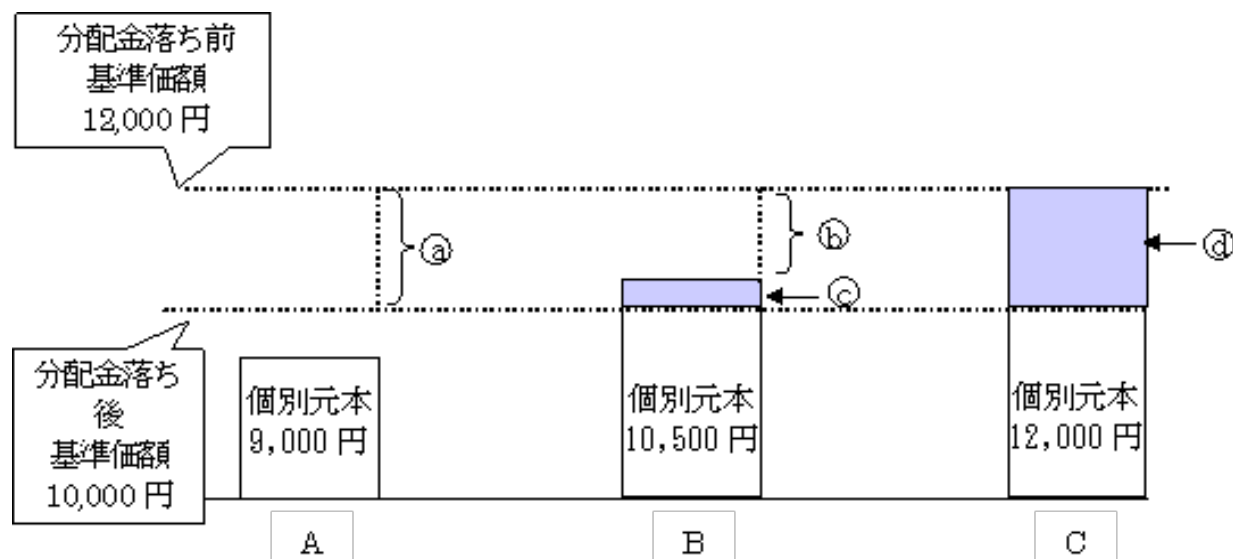
<注>個別元本及び収益分配金の課税について

- ①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- ②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- ③同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については各販売会社毎に、個別元本が算出されます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は、当該支店等毎に個別元本の算出が行われる場合があります。
- ④収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「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）の区分があります。受益者が特別分配金を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個別元本および収益分配金の課税については次ページの具体例をご参照ください。

<収益分配金に対する課税の例>

分配金支払い前の基準価額が1万口当り12,000円、2,000円の収益分配を行い分配金落ち後の基準価額が10,000円となったケース。



A) 収益分配金受取前の個別元本が9,000円の場合

分配金落ち後の基準価額が分配金受取前の個別元本を上回っているため、?の部分(2,000円)は普通分配金となり、収益分配金落ち後の個別元本は9,000円のまま変わりません。

B) 収益分配金受取前の個別元本が10,500円の場合

分配金落ち後の基準価額が当初の個別元本を下回っている?の部分(500円)は特別分配金となり、収益分配金(2,000円)から?特別分配金(500円)を差引いた残りの?の部分(1,500円)は普通分配金となります。

収益分配金受取後の個別元本は

収益分配金受取前個別元本(10,500円)－特別分配金(500円)＝10,000円 となります。

C) 収益分配金受取前の個別元本が12,000円の場合

分配金落ち後の基準価額が当初の個別元本を下回っているため、?の部分(2,000円)は特別分配金となります。

収益分配金受取後の個別元本は

収益分配金受取前個別元本(12,000円)－特別分配金(2,000円)＝10,000円 となります。

※ 取得申込者によって、取扱いが異なる場合があります。また、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。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

種類別及び地域別の投資状況

平成21年2月27日現在

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	55,279,524	78.00
投資信託受益証券	ケイマン諸島	14,917,776	21.05
小 計		70,197,300	99.05
現金・預金等・その他の資産（負債控除後）		671,168	0.95
合 計（純資産総額）		70,868,468	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価金額の比率です。

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

評価額上位銘柄

平成21年2月27日現在

国／ 地域	銘 柄	数量 (口数)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
日本	しんきん高格付外国債券マザーファンド	24,893,980	0.8301	20,664,492	0.8617	21,451,142	30.27
日本	しんきん欧州ソブリン債マザーファンド	17,326,182	1.1149	19,316,960	1.1431	19,805,558	27.94
ケイ マン 諸島	ウエリントンEMDP	1,828,383	7.543	13,791,492	8.159	14,917,776	21.05
日本	しんきん米国ソブリン債マザーファンド	12,890,995	1.0468	13,494,293	1.0878	14,022,824	19.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

※ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージングマーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなし・クラスBユニット（以下「ウエリントンEMDP」という。以下同じ。）

投資有価証券の種類別投資比率

平成21年2月27日現在

種 類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	78.00
投資信託受益証券	21.05
合 計	99.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

平成21年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産総額及び基準価額の推移は以下のとおりです。

計算期間		純資産総額（円）		基準価額（円）	
		分配落	分配付	分配落	分配付
第1特定期間	第1期末(平成20年 5 月19日)	40,691,133	40,896,151	9,924	9,974
	第2期末(平成20年 7 月18日)	49,587,225	49,833,940	10,049	10,099
第2特定期間	第3期末(平成20年 9 月18日)	71,136,023	71,588,544	9,432	9,492
	第4期末(平成20年11月18日)	60,890,326	61,359,875	7,781	7,841
	第5期末(平成21年 1 月19日)	67,699,412	68,217,019	7,848	7,908
平成20年 2 月末日		15,282,468	—	9,968	—
平成20年 3 月末日		34,174,103	—	9,691	—
平成20年 4 月末日		37,597,241	—	9,920	—
平成20年 5 月末日		42,827,278	—	9,957	—
平成20年 6 月末日		45,899,655	—	10,045	—
平成20年 7 月末日		53,618,557	—	10,161	—
平成20年 8 月末日		66,158,144	—	10,069	—
平成20年 9 月末日		72,102,117	—	9,354	—
平成20年10月末日		61,370,875	—	8,003	—
平成20年11月末日		62,166,854	—	7,928	—
平成20年12月末日		68,376,930	—	8,008	—
平成21年 1 月末日		65,111,907	—	7,533	—
平成21年 2 月末日		70,868,468	—	8,177	—

(注) 基準価額は、受益権 1 口当たりの純資産価額を 1 万口単位で表示したものです。

②【分配の推移】

計算期間		1万口当たり分配金（円）
第1特定期間	自 平成20年 2 月 6日 至 平成20年 7 月18日	100
第2特定期間	自 平成20年 7 月19日 至 平成21年 1 月19日	180

(注) 収益分配金は特定期間中の累計額を記載しております。

③【収益率の推移】

計算期間		収益率（％）
第1特定期間	自 平成20年 2 月 6 日 至 平成20年 7 月18日	1.49
第2特定期間	自 平成20年 7 月19日 至 平成21年 1 月19日	△20.11

（注）収益率は、各特定期間ごとに特定期間末の基準価額（分配落）から前特定期間末の基準価額（分配落）を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額（分配落）で除したものをパーセント表示しています。

以下、ご参考として「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」、「しんきん高格付外国債券マザーファンド」、「ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージングマーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなし・クラスBユニット」の「運用状況」を掲載します。

<ご参考>

「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」

（１）投資状況

平成21年2月27日現在

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国 債 証 券	ドイツ	4,037,142,059	28.50
国 債 証 券	フランス	3,434,861,356	24.24
国 債 証 券	イタリア	3,209,975,241	22.66
国 債 証 券	スペイン	894,685,825	6.31
国 債 証 券	ベルギー	865,033,987	6.11
特 殊 債 券	国際機関	1,324,358,884	9.35
小 計		13,766,057,352	97.17
現金・預金等・その他の資産（負債控除後）		401,097,438	2.83
合 計（純資産総額）		14,167,154,790	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価金額の比率です。

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

評価額上位銘柄（外国債券上位30銘柄）

平成21年2月27日現在

国名 地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
ドイツ	国債証券	DBR	8,100,000	13,150.98	1,065,230,011	13,415.59	1,086,663,413	4.000	2018/1/4	7.67
ドイツ	国債証券	DBR	5,600,000	13,136.70	735,655,275	13,259.68	742,542,586	3.750	2015/1/4	5.24
ドイツ	国債証券	DBR	4,900,000	13,583.30	665,582,101	13,959.72	684,026,529	4.750	2034/7/4	4.82
ドイツ	国債証券	DBR	3,500,000	15,517.56	543,114,925	15,803.29	553,115,440	6.250	2024/1/4	3.90
ドイツ	国債証券	DBR	2,500,000	13,408.14	335,203,597	13,678.96	341,974,132	4.250	2018/7/4	2.41
ドイツ	国債証券	DBR	2,500,000	13,150.98	328,774,695	13,221.79	330,544,972	3.750	2013/7/4	2.33
ドイツ	国債証券	DBR	1,600,000	13,373.35	213,973,752	13,714.99	219,439,872	4.750	2028/7/4	1.54
ドイツ	国債証券	OBL	600,000	13,030.48	78,182,908	13,139.18	78,835,115	3.500	2013/4/12	0.55
イタリア	国債証券	BTPS	6,800,000	13,199.43	897,561,750	13,148.50	894,098,217	5.000	2012/2/1	6.31
イタリア	国債証券	BTPS	4,700,000	13,225.52	621,599,712	13,225.52	621,599,712	5.250	2011/8/1	4.38
イタリア	国債証券	BTPS	3,400,000	13,154.71	447,260,299	13,088.87	445,021,675	4.750	2013/2/1	3.14
イタリア	国債証券	BTPS	3,000,000	13,389.50	401,685,282	13,331.12	399,933,639	5.250	2017/8/1	2.82
イタリア	国債証券	BTPS	3,000,000	12,816.80	384,504,273	12,798.17	383,945,238	4.250	2015/2/1	2.71
イタリア	国債証券	BTPS	2,700,000	14,276.51	385,465,813	13,969.66	377,180,914	6.500	2027/11/1	2.66
イタリア	国債証券	BTPS	700,000	12,572.07	88,004,532	12,599.40	88,195,846	2.750	2010/6/15	0.62
フランス	国債証券	FRTR	5,000,000	14,915.05	745,752,690	15,011.95	750,597,660	5.750	2032/10/25	5.29
フランス	国債証券	FRTR	4,500,000	13,101.29	589,558,311	13,131.11	590,899,995	4.000	2014/4/25	4.17
フランス	国債証券	FRTR	4,600,000	12,610.58	580,087,015	12,705.00	584,430,096	3.750	2017/4/25	4.12
フランス	国債証券	FRTR	3,300,000	13,072.72	431,399,855	13,128.62	433,244,671	4.000	2014/10/25	3.05
フランス	国債証券	FRTR	3,000,000	13,755.98	412,679,637	13,826.79	414,803,970	5.000	2016/10/25	2.92
フランス	国債証券	FRTR	2,000,000	12,013.04	240,260,820	12,177.02	243,540,492	4.000	2038/10/25	1.71
フランス	国債証券	BTNS	1,700,000	13,385.78	227,558,302	13,399.44	227,790,612	4.500	2013/7/12	1.60
フランス	国債証券	BTNS	1,500,000	12,630.58	189,458,824	12,636.92	189,553,860	3.000	2010/1/12	1.33
スペイン	国債証券	SPGB	4,300,000	13,332.36	573,291,634	13,348.51	573,986,080	5.350	2011/10/31	4.05
スペイン	国債証券	SPGB	2,000,000	12,928.49	258,569,837	12,909.98	258,199,632	4.200	2013/7/30	1.82
ベルギー	国債証券	BGB	4,500,000	13,230.49	595,372,275	13,201.79	594,080,904	5.750	2010/9/28	4.19
ベルギー	国債証券	BGB	2,100,000	12,991.97	272,831,441	12,902.52	270,953,083	4.250	2014/9/28	1.91
国際機関	特殊債券	EIB	3,600,000	13,136.08	472,898,887	13,129.86	472,675,273	5.625	2010/10/15	3.33
国際機関	特殊債券	EIB	3,500,000	12,698.79	444,457,671	12,748.48	446,196,891	3.625	2013/10/15	3.14
国際機関	特殊債券	EIB	3,000,000	13,490.13	404,704,071	13,516.22	405,486,720	5.375	2012/10/15	2.86

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成21年2月27日現在

種 類	投資比率 (%)
-----	----------

国債証券	87.82
特殊債券	9.35
合 計	97.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

業種別投資比率

該当事項はありません。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<ご参考>

「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」

（１）投資状況

平成21年2月27日現在

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国 債 証 券	アメリカ	12,121,082,079	86.11
特 殊 債 券	国際機関	1,747,693,531	12.42
小 計		13,868,775,610	98.53
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		207,238,682	1.47
合 計（純資産総額）		14,076,014,292	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価金額の比率をいいます。

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

評価額上位銘柄（外国債券上位30銘柄）

平成21年2月27日現在

国名 地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T-BOND	5,600,000	13,916.52	779,325,627	13,939.45	780,609,383	8.000	2021/11/15	5.54
アメリカ	国債証券	T-BOND	5,400,000	12,349.27	666,860,941	12,371.43	668,057,582	6.250	2023/8/15	4.74
アメリカ	国債証券	T-BOND	5,200,000	12,651.11	657,857,833	12,661.81	658,414,128	7.500	2016/11/15	4.67
アメリカ	国債証券	T-NOTE	6,000,000	10,626.13	637,568,371	10,579.52	634,771,620	4.875	2011/5/31	4.50
アメリカ	国債証券	T-NOTE	6,000,000	10,438.92	626,335,507	10,387.72	623,263,659	3.375	2012/11/30	4.42
アメリカ	国債証券	T-NOTE	5,800,000	10,739.23	622,875,475	10,707.13	621,014,029	5.000	2011/8/15	4.41
アメリカ	国債証券	T-BOND	5,300,000	11,532.41	611,217,746	11,543.10	611,784,738	5.250	2029/2/15	4.34
アメリカ	国債証券	T-NOTE	5,300,000	10,863.02	575,740,225	10,798.83	572,338,271	4.250	2013/8/15	4.06
アメリカ	国債証券	T-BOND	4,300,000	13,083.06	562,571,820	13,042.35	560,821,144	6.500	2026/11/15	3.98

アメリカ	国債証券	T-NOTE	5,000,000	10,493.17	524,658,953	10,448.85	522,442,945	4.500	2011/2/28	3.71
アメリカ	国債証券	T-NOTE	4,500,000	11,073.92	498,326,667	11,017.37	495,782,078	4.500	2015/11/15	3.52
アメリカ	国債証券	T-NOTE	4,200,000	10,205.09	428,614,119	10,228.78	429,609,029	3.500	2018/2/15	3.05
アメリカ	国債証券	T-NOTE	4,000,000	10,783.55	431,342,100	10,705.61	428,224,406	4.000	2015/2/15	3.04
アメリカ	国債証券	T-NOTE	4,000,000	10,714.77	428,591,193	10,665.87	426,634,993	4.250	2012/9/30	3.03
アメリカ	国債証券	T-BOND	2,900,000	13,950.15	404,554,386	13,973.07	405,219,188	8.125	2021/5/15	2.87
アメリカ	国債証券	T-NOTE	3,700,000	10,468.72	387,342,882	10,415.23	385,363,758	3.375	2013/7/31	2.73
アメリカ	国債証券	T-NOTE	3,600,000	9,974.32	359,075,793	9,942.99	357,947,921	2.000	2010/9/30	2.54
アメリカ	国債証券	T-NOTE	3,000,000	10,794.25	323,827,514	10,736.17	322,085,273	4.000	2014/2/15	2.28
アメリカ	国債証券	T-NOTE	2,700,000	10,765.21	290,660,754	10,743.81	290,083,064	4.875	2012/2/15	2.06
アメリカ	国債証券	T-NOTE	2,500,000	10,922.62	273,065,651	10,959.30	273,982,620	4.500	2017/5/15	1.94
アメリカ	国債証券	T-BOND	2,000,000	13,653.66	273,073,293	13,673.53	273,470,646	7.875	2021/2/15	1.94
アメリカ	国債証券	T-NOTE	2,500,000	10,413.70	260,342,710	10,424.40	260,610,159	3.750	2018/11/15	1.85
アメリカ	国債証券	T-NOTE	2,500,000	9,960.57	249,014,327	9,928.47	248,211,979	2.125	2010/4/30	1.76
アメリカ	国債証券	T-BOND	2,000,000	10,931.79	218,635,915	10,931.79	218,635,915	4.375	2038/2/15	1.55
アメリカ	国債証券	T-NOTE	2,000,000	10,029.34	200,586,915	9,994.19	199,883,905	2.625	2010/5/31	1.42
アメリカ	国債証券	T-NOTE	1,900,000	10,275.39	195,232,581	10,222.67	194,230,791	2.875	2013/1/31	1.37
国際機関	特殊債券	IADB	8,000,000	10,449.04	835,923,384	10,409.91	832,793,464	4.750	2012/10/19	5.91
国際機関	特殊債券	EIB	4,500,000	10,119.12	455,360,812	10,089.29	454,018,370	5.000	2010/2/8	3.22
国際機関	特殊債券	EIB	2,500,000	10,041.17	251,029,365	10,008.89	250,222,432	4.000	2010/3/3	1.77
国際機関	特殊債券	EIB	2,100,000	10,031.39	210,659,265	10,031.39	210,659,265	3.250	2011/2/15	1.49

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

投資有価証券の種類別投資比率

平成21年2月27日現在

種 類	投資比率（％）
国債証券	86.11
特殊債券	12.42
合 計	98.53

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率をいいます。

業種別投資比率

該当事項はありません。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<ご参考>

「しんきん高格付外国債券マザーファンド」

（１）投資状況

平成21年2月27日現在

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	イギリス	995,725,990	39.23
国債証券	カナダ	515,623,455	20.31
国債証券	ノルウェー	469,290,372	18.49
地方債証券	オーストラリア	471,763,230	18.58
小計		2,452,403,047	96.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		86,041,802	3.39
合計（純資産総額）		2,538,444,849	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率です。

（２）投資資産

①投資有価証券の主要銘柄

評価額上位銘柄（外国債券）

平成21年2月27日現在

国名 地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	簿価単価 (円)	簿価金額 (円)	評価単価 (円)	評価金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
カナダ	国債証券	CAN	2,800,000	8,193.01	229,404,436	8,775.15	245,704,455	4.50	2015/6/1	9.67
カナダ	国債証券	CAN	1,600,000	8,172.75	130,764,144	8,601.26	137,620,224	4.25	2018/6/1	5.42
カナダ	国債証券	CAN	800,000	7,896.17	63,169,428	8,519.45	68,155,668	4.00	2017/6/1	2.68
カナダ	国債証券	CAN	750,000	7,930.61	59,479,610	8,552.41	64,143,108	4.00	2016/6/1	2.52
イギリス	国債証券	UKT	3,450,000	12,962.78	447,216,040	14,720.17	507,846,099	4.00	2016/9/7	20.00
イギリス	国債証券	UKT	3,120,000	13,851.08	432,153,940	15,637.17	487,879,891	5.00	2014/9/7	19.21
ノル ウェー	国債証券	NGB	18,400,000	1,480.87	272,480,080	1,598.18	294,066,500	6.50	2013/5/15	11.58
ノル ウェー	国債証券	NGB	4,500,000	1,407.81	63,351,450	1,526.81	68,706,607	5.00	2015/5/15	2.70
ノル ウェー	国債証券	NGB	4,200,000	1,341.77	56,354,550	1,453.47	61,045,845	4.25	2017/5/19	2.40
ノル ウェー	国債証券	NGB	3,000,000	1,422.14	42,664,230	1,515.71	45,471,420	6.00	2011/5/16	1.79
オースト ラリア	地方債証 券	QTC	2,800,000	6,386.92	178,833,764	6,640.71	185,940,010	6.00	2015/10/14	7.32
オースト ラリア	地方債証 券	QTC	2,500,000	5,959.45	148,986,287	6,664.68	166,617,034	6.00	2013/8/14	6.56
オースト ラリア	地方債証 券	NSWTC	1,800,000	5,994.06	107,893,121	6,622.56	119,206,186	6.00	2012/5/1	4.69

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

平成21年2月27日

種 類	投資比率（％）
国債証券	78.03
地方債証券	18.58
合 計	96.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

業種別投資比率

該当事項はありません。

②投資不動産物件

該当事項はありません。

③その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

<ご参考>

「ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）－エマージングマーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなし・クラスBユニット」

①通貨別組入れ上位5通貨

平成21年2月27日現在

通貨名		評価金額（円）	投資比率（％）
1	米ドル	2,261,782,985	89.87%
2	ユーロ	66,431,298	2.64%
3	ブラジル・レアル	55,677,809	2.21%
4	コロンビア・ペソ	54,967,369	2.18%
5	ハンガリー・フォリント	35,627,949	1.42%

（注）投資比率は、ウエリントンEMDPの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率です。

②発行国別組入れ上位10カ国

平成21年2月27日現在

発行国		評価金額（円）	投資比率（％）
1	ブラジル	266,733,097	10.60%
2	アメリカ	263,524,164	10.47%
3	ロシア	204,918,275	8.14%
4	インドネシア	190,521,987	7.57%
5	メキシコ	162,452,938	6.46%
6	フィリピン	162,376,685	6.45%
7	コロンビア	153,511,662	6.10%
8	トルコ	134,531,615	5.35%
9	ウルグアイ	130,000,452	5.17%
10	ペルー	113,448,685	4.51%

（注）投資比率は、ウエリントンEMDPの純資産総額に対する当該資産の評価金額の比率です。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成20年2月6日 信託契約締結、ファンドの設定、運用開始。

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

- 1) 申込みの際、取得申込者は、販売会社との間の権利義務関係を明確にすることを目的とした契約を結びます。
- 2) 販売会社は「自動けいぞく投資約款」を取得申込者に交付し、取得申込者は当該約款に基づく自動けいぞく投資の申込みを行います。
- 3) 申込単位は、1万円以上1円単位です。
- 4) 申込にかかる受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.10%（税抜2.00%）を上限に販売会社が個別に定める手数料率を乗じて得た申込手数料を加算した額となります。収益分配金を再投資する場合の受益権の買付価額は、原則として、各計算期間終了日の基準価額とします。
- 5) 各営業日の午後3時（半休日においては午前11時）までに受付けた取得の申込みを、当日の申込受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。
- 6) ニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの金融商品取引所の休業日またはニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの銀行が休業日の場合は、受益権の取得の申込みを受付けません。ただし、「自動けいぞく投資約款」にしたがって契約を結んだ取得申込者においては、収益分配金の再投資にかかる追加信託の申込みに限ってこれを受付けるものとします。
- 7) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付けを中止することができます。取得申込みの受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の取得申込みを撤回できます。
- 8) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせください。

《照会先》

しんきんアセットマネジメント投信株式会社（委託会社）

電話番号：03-5524-8181

（9：00～17：00 土、日、祝日を除きます。）

委託会社のホームページアドレス：<http://www.skam.co.jp>

2【換金（解約）手続等】

- 1) 受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行を請求することにより換金することができます。
- 2) 各営業日の午後3時（半休日においては午前11時）までに受付けた換金（解約）の申込みを、当日の申込受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。
- 3) ニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの金融商品取引所の休業日またはニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの銀行が休業日の場合は、受益権の換金（解約）の申込みを受付けません。
- 4) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。受益者が一部解約の実行を請求するときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
- 5) 解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額の0.1%を信託財産留保額として控除した価額とします。
- 6) 解約時の課税に関しては、前記「ファンド情報」の「4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。
- 7) 一部解約金にかかる収益調整金（注）は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- 8) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、5)の規定に準じて算定した価額とします。
- 9) 解約代金の支払いは、原則として上記解約請求日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。
- 10) 受託会社は、一部解約代金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払い込みます。受託会社は、委託会社に一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

（注）収益調整金は、所得税法施行令第27条の規定によるものとし、受益者ごとの信託時の受益権の価額と元本の差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

ファンドの換金（解約）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせください。

《照会先》

しんきんアセットマネジメント投信株式会社（委託会社）

電話番号：03-5524-8181

（9：00～17：00 土、日、祝日を除きます。）

委託会社のホームページアドレス：<http://www.skam.co.jp>

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

1) 基準価額の計算方法

- イ. 基準価額は、委託会社によって毎営業日算出されます。
- ロ. 基準価額とは、投資信託財産に属する資産を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。
- ハ. 基準価額（受益権1口当りの純資産価額を1万口単位で表示したもの）は、委託会社および販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として日本経済新聞朝刊に掲載されます。

ニ. ファンドの主要な投資対象資産の評価方法

○投資信託受益証券

原則として、基準価額計算日の基準価額で評価しております。

○親投資信託受益証券

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価しております。

《照会先》

しんきんアセットマネジメント投信株式会社（委託会社）

電話番号：03-5524-8181

（9：00～17：00 土、日、祝日を除きます。）

委託会社のホームページアドレス：<http://www.skam.co.jp>

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は無期限です。ただし、後記「(5) その他」の1) ファンドの繰上償還条項により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

- 1) この信託に計算期間は、原則として毎年1月19日から3月18日まで、3月19日から5月18日まで、5月19日から7月18日まで、7月19日から9月18日まで、9月19日から11月18日まで、11月19日から翌年1月18日までとします。ただし、第1計算期間は平成20年2月6日から平成20年5月19日までとします。
- 2) 上記にかかわらず、上記の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日以降の最初の営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款の第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) ファンドの繰上償還条項

- a. 委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 前項の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. b. からd. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、投資信託約款の変更の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社とその任務を辞任する場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

2) 投資信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、前項の事項（前項の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 前項の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は

受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. b. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. b. から e. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 前各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

3) 反対者の買取請求権

前記1)に規定する信託契約の解約または2)に規定する重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。

この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、信託契約の解約または重大な約款の変更等に規定する書面に付記します。

4) 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（投資信託受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約書）は、期間満了の1ヵ月前までに当事者のいずれからも、別段の意思表示がない場合は、自動的に1年更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により、随時変更される場合があります。

5) 運用報告書

委託会社は、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に基づき毎年1月および7月の特定期間の末日を基準に運用報告書を作成し、投資信託財産にかかる知られたる受益者に、販売会社を通じて交付します。

6) 公告

委託会社が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載されます。

2 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

①収益分配金に対する請求権

- 1) 収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から、毎計算期間の末日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託会社が委託会社の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が販売会社に支払われます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の取得の申込みに応じるものとします。当該取得申込みにより増加した受益権

は、振替口座簿に記載または記録されます。

- 2) 販売会社は、受益者が自己に帰属する受益権について、あらかじめ収益分配金の再投資にかかる受益権の取得申込みを中止することを申し出た場合には、当該受益権に帰属する収益分配金を当該計算期間終了のつど受益者に支払います。
- 3) 受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

②償還金に対する請求権

- 1) 受益者は、ファンドにかかる償還金を持分に応じて請求する権利を有します。
- 2) 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対し委託会社がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録を行います。
- 3) 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。
- 4) 受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

③換金（解約）請求権

受益者は、委託会社に受益権の一部解約の実行を請求することにより換金する権利を有します。権利行使の方法等については、上記「第2 手続等」の「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

④帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に当該受益者にかかる投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

第4【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）（以下「財務諸表等規則」という。）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号及び平成20年12月12日付内閣府令第80号により改正されておりますが、前特定期間（平成20年2月6日から平成20年7月18日まで）については内閣府令第50号附則第2条1項1号により、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則及び内閣府令第80号改正前の財務諸表等規則に基づき作成しており、当特定期間（平成20年7月19日から平成21年1月19日まで）については内閣府令第50号附則第2条1項1号により、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則及び内閣府令第80号改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

また、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。
3. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前特定期間（平成20年2月6日から平成20年7月18日まで）及び当特定期間（平成20年7月19日から平成21年1月19日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 【財務諸表】

しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成20年7月18日現在)	当期 (平成21年1月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,132,737	1,060,554
投資信託受益証券	9,565,789	13,791,492
親投資信託受益証券	39,210,828	53,475,745
未収利息	10	1
流動資産合計	49,909,364	68,327,792
資産合計	49,909,364	68,327,792
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	246,715	517,607
未払受託者報酬	3,954	5,799
未払委託者報酬	71,093	104,414
その他未払費用	377	560
流動負債合計	322,139	628,380
負債合計	322,139	628,380
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※3 49,343,082	※1, ※3 86,267,874
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	244,143	※2 △18,568,462
（分配準備積立金）	929,310	735,804
元本等合計	49,587,225	67,699,412
純資産合計	49,587,225	67,699,412
負債純資産合計	49,909,364	68,327,792

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 (自 平成20年 2 月 6 日 至 平成20年 7 月18日)	当期 (自 平成20年 7 月19日 至 平成21年 1 月19日)
営業収益		
受取配当金	—	365,919
受取利息	1,114	1,213
有価証券売買等損益	1,426,617	△15,409,380
その他収益	—	386
営業収益合計	1,427,731	△15,041,862
営業費用		
受託者報酬	7,843	17,014
委託者報酬	141,071	306,312
その他費用	741	1,643
営業費用合計	149,655	324,969
営業利益又は営業損失（△）	1,278,076	△15,366,831
経常利益又は経常損失（△）	1,278,076	△15,366,831
当期純利益又は当期純損失（△）	1,278,076	△15,366,831
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△102,967	△190,762
期首剰余金又は期首欠損金（△）	—	244,143
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,449	149,637
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,449	118,632
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	—	31,005
剰余金減少額又は欠損金増加額	707,616	2,346,496
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	707,616	2,346,496
分配金	※1 451,733	※1 1,439,677
期末剰余金又は期末欠損金（△）	244,143	△18,568,462

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前期 (自 平成20年2月 6日 至 平成20年7月18日)	当期 (自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、当該投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、当該親投資信託の基準価額で評価しております。	投資信託受益証券 同左 親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	—————	計算期間の取り扱い 当特定期間は、当期末が休日のため、平成20年7月19日から平成21年1月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (平成20年7月18日現在)	当期 (平成21年1月19日現在)
※1信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	期首元本額 7,002,941円 期中追加設定元本額 45,277,282円 期中一部解約元本額 2,937,141円	期首元本額 49,343,082円 期中追加設定元本額 38,976,473円 期中一部解約元本額 2,051,681円
※2元本の欠損	—————	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は18,568,462円であります。
※3特定期間末日における受益権の総数	49,343,082口	86,267,874口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自 平成20年2月 6日 至 平成20年7月18日)	当期 (自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日)
※ 1 分配金の計算過程 第 1 期 計算期間末における経費控除後の配当等収益258,010円（1万口当たり62.92円）、経費控除後の有価証券等損益279,143円（1万口当たり68.07円）、及び収益調整金42,986円（1万口当たり10.48円）を分配対象収益とし、分配金は205,018円(1万口当たり50.00円)としております。 第 2 期 計算期間末における経費控除後の配当等収益260,205円（1万口当たり52.73円）、経費控除後の有価証券等損益583,685円（1万口当たり118.29円）、収益調整金130,133円（1万口当たり26.37円）及び分配準備積立金332,135円（1万口当たり67.31円）を分配対象収益とし、分配金は246,715円(1万口当たり50.00円)としております。	※ 1 分配金の計算過程 第 3 期 計算期間末における経費控除後の配当等収益655,051円（1万口当たり86.85円）、収益調整金758,729円（1万口当たり100.60円）及び分配準備積立金929,310円（1万口当たり123.22円）を分配対象収益とし、分配金は452,521円(1万口当たり60.00円)としております。 第 4 期 計算期間末における経費控除後の配当等収益278,680円（1万口当たり35.61円）、収益調整金864,051円（1万口当たり110.41円）及び分配準備積立金1,104,067円（1万口当たり141.08円）を分配対象収益とし、分配金は469,549円(1万口当たり60.00円)としております。 第 5 期 計算期間末における経費控除後の配当等収益340,213円（1万口当たり39.44円）、収益調整金1,053,690円（1万口当たり122.14円）及び分配準備積立金913,198円（1万口当たり105.86円）を分配対象収益とし、分配金は517,607円(1万口当たり60.00円)としております。

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

	前期 （平成20年7月18日現在）		当期 （平成21年1月19日現在）	
種 類	貸借対照表 計上額	当特定期間の損益 に 含まれた評価差額	貸借対照表 計上額	当特定期間の損益に 含まれた評価差額
投資信託 受益証券	9,565,789	△48,278	13,791,492	512,744
親投資信託 受益証券	39,210,828	963,064	53,475,745	688,127
合 計	48,776,617	914,786	67,267,237	1,200,871

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

前期 （自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日）	当期 （自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日）
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

前期 （自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日）	当期 （自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日）
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

前期 （平成20年7月18日現在）	当期 （平成21年1月19日現在）
1口当たり純資産額 1.0049円 （1万口当たり純資産額 10,049円）	1口当たり純資産額 0.7848円 （1万口当たり純資産額 7,848円）

(4) 【附属明細表】
第1 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額(口)	評価額 (円)	備 考
投資信託受益証券	ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）-エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット	1,828,383	13,791,492	—
親投資信託受益証券	しんきん欧州ソブリン債マザーファンド	17,326,182	19,316,960	11,149円
親投資信託受益証券	しんきん米国ソブリン債マザーファンド	12,890,995	13,494,293	10,468円
親投資信託受益証券	しんきん高格付外国債券マザーファンド	24,893,980	20,664,492	8,301円
合 計		56,939,540	67,267,237	—

備考欄は、親投資信託受益証券の1万口当たりの基準価額

第2 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

（参考情報）

当ファンドは、「ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオズ（ケイマン）-エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ（適格機関投資家限定）・円ヘッジなしクラスBユニット」を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は同投資信託です。

なお、同投資信託の状況は次のとおりです。

組入資産の明細

(2009年1月16日現在)

投資対象国	銘柄		通貨	数量	取得単価 (現地通貨建) Unit Cost Local	評価単価 (現地通貨建) Price Local	参考	
	Security Name	Security Description					評価金額(円) (邦貨建)	比率 (%)
(ラテン・アメリカ)								
アルゼンチン	ARGENTINA Boden	3.1270% 08-03-12	USD	340,000	41.34	27.90	8,543,092	0.4
	Argentina EUR Disc	7.8200% 12-31-33	EUR	116,202	64.96	26.50	3,648,109	0.2
	Argentina USD Disc	8.2800% 12-31-33	USD	247,528	92.00	34.85	7,768,906	0.3
ブラジル	Brazil NTN-B IPCA	6.0000% 08-15-10	BRL	32,000	1,681.63	1,810.40	22,159,296	0.9
	Brazil NTN-B IPCA	6.0000% 05-15-11	BRL	30,000	1,640.94	1,758.46	20,178,329	0.9
	Brazilian Real	On-Hand	BRL	-4,132			-	0.0
	Brazil Republic RgSS	8.5000% 09-24-12	EUR	170,000	110.80	106.50	21,448,994	0.9
	Banco Nac Desen RgSS	6.3690% 06-16-18	USD	440,000	100.00	92.00	36,456,288	1.6
	Brazil Republic	8.2500% 01-20-34	USD	445,000	117.64	115.25	46,188,397	2.0
	Brazil Republic	8.8750% 10-14-19	USD	220,000	110.70	117.00	23,181,444	1.0
	Brazil Republic	8.0000% 01-15-18	USD	425,000	109.60	108.25	41,433,229	1.8
	Brazil Republic	7.1250% 01-20-37	USD	105,000	100.92	106.50	10,070,960	0.4
	Brazil Republic	6.0000% 01-17-17	USD	505,000	89.25	99.75	45,366,599	1.9
	Eletrobras OTHR RgSS	7.7500% 11-30-15	USD	125,000	105.70	103.25	11,623,369	0.5
	Brazilian Real Fwd	2.225000 03-18-09	BRL/USD	45,000	-	2.382	-	-
	Brazilian Real Fwd	2.237000 03-18-09	BRL/USD	-1,864,000	-	2.382	-	-
	Brazilian Real Fwd	2.454500 03-18-09	BRL/USD	824,000	-	2.382	-	-
	Brazilian Real Fwd	2.475000 03-18-09	BRL/USD	-90,000	-	2.382	-	-
チリ	Chile Republic	7.1250% 01-11-12	USD	250,000	110.82	109.61	24,679,592	1.1
	Codelco Inc RgSS	4.7500% 10-15-14	USD	300,000	99.15	93.18	25,174,022	1.1
	Codelco Inc RgSS	6.1500% 10-24-36	USD	275,000	99.93	78.39	19,413,716	0.8
	Codelco Inc OTH RgSS	5.6250% 09-21-35	USD	440,000	86.59	74.66	29,586,259	1.3
コロンビア	Colombia Republic	12.0000% 10-22-15	COP	688,000,000	108.10	115.73	31,929,346	1.4
	Colombia Republic	9.8500% 06-28-27	COP	594,000,000	84.22	104.21	24,822,197	1.1
	Colombia Republic	10.0000% 01-23-12	USD	100,000	105.69	112.00	10,086,720	0.4
	Colombia Republic	10.7500% 01-15-13	USD	215,000	120.93	115.75	22,412,557	1.0
	Colombia Republic	7.3750% 09-18-37	USD	220,000	90.77	92.50	18,327,210	0.8
	Colombia Republic	7.3750% 03-18-19	USD	195,000	99.14	99.25	17,429,987	0.7
	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.3750% 01-27-17	USD	120,000	104.50	100.75	10,888,254	0.5
	Colombian Peso		COP	-1			-	0.0
	Colombian Peso Fwd	2365.000000 01-23-09	COP/USD	-1,100,401,000	-	2,233.532	-	-

	Colombian Peso Fwd	2342.500000 01-23-09	COP/USD	-87,600,000	-	2,233.532	-	-
	Colombian Peso Fwd	2212.000000 01-23-09	COP/USD	-182,700,000	-	2,233.532	-	-
ドミニカ共和国	Dominican Rep E RgSS	9.0400% 01-23-18	USD	109,298	65.28	68.00	6,693,479	0.3
エクアドル	Republic Ecuado RgSS	9.3750% 12-15-15	USD	200,000	101.75	36.50	561,999	0.0
	Ecuador Rep RgSS	10.0000% 08-15-30	USD	20,000	96.00	31.00	6,787,044	0.3
エルサルバドル	El Salvador Int RgSS	7.6250% 09-21-34	USD	105,000	101.65	79.00	7,470,477	0.3
	El Salvador Rep RgSS	7.7500% 01-24-23	USD	100,000	106.88	92.00	8,285,520	0.4
	El Salvador Rep RgSS	8.2500% 04-10-32	USD	295,000	77.33	76.00	20,191,452	0.9
メキシコ	IRS MXN PAY Float	8.7018% 01-25-13	MXN	-1,525,000	100.00	100.00	-9,851,500	-0.4
	IRS MXN PAY Float	8.7050% 04-03-18	MXN	-1,475,000	100.00	100.00	-9,528,500	-0.4
	IRS MXN REC Fixed	7.8700% 01-25-13	MXN	1,525,000	100.00	102.06	10,054,539	0.4
	IRS MXN REC Fixed	7.9800% 04-03-18	MXN	1,475,000	100.00	100.64	9,589,768	0.4
	Pemex Proj RgSS FRN	3.29625% 06-15-10	USD	435,000	100.63	96.00	37,609,056	1.6
	Pemex Proj Fdg RgSS	5.7500% 03-01-18	USD	410,000	99.84	86.75	32,032,091	1.4
	United Mexican Sts	7.5000% 01-14-12	USD	125,000	111.74	108.50	12,214,388	0.5
	United Mexican Sts	6.6250% 03-03-15	USD	240,000	110.55	105.25	22,749,156	1.0
	United Mexican Sts	5.6250% 01-15-17	USD	200,000	91.90	98.10	17,669,772	0.8
	United Mexican Sts	6.0500% 01-11-40	USD	1,280,000	98.29	91.13	105,051,748	4.5
	Mexican Peso	On-Hand	MXN	832			-	0.0
	Mexican Peso Fwd	13.905500 03-18-09	MXN/USD	63,000	-	14.095	-	-
	Mexican Peso Fwd	13.885000 03-18-09	MXN/USD	94,000	-	14.095	-	-
	Mexican Peso Fwd	13.900000 03-18-09	MXN/USD	93,000	-	14.095	-	-
パナマ	Panama Rep	7.2500% 03-15-15	USD	50,000	109.56	103.00	4,638,090	0.2
	Panama Republic	7.1250% 01-29-26	USD	145,000	106.60	95.75	12,503,705	0.5
	Panama Rep Put06	9.3750% 04-01-29	USD	289,000	132.99	113.00	29,410,894	1.3
ペルー	Peru Republic	9.1250% 02-21-12	USD	340,000	115.32	110.50	33,835,542	1.4
	Peru Republic	9.8750% 02-06-15	USD	290,000	126.85	117.00	30,557,358	1.3
	Peru Republic	7.3500% 07-21-25	USD	175,000	81.25	99.50	15,681,698	0.7
	Peru Republic	6.5500% 03-14-37	USD	275,000	103.30	88.50	21,918,353	0.9
	New Sol	On-Hand	PEN	-28			-	0.0
	Peru Nuevos Sol Fwd	3.205000 03-18-09	PEN/USD	-956,000	-	3.173	-	-
	Peru Nuevos Sol Fwd	3.134000 03-18-09	PEN/USD	685,000	-	3.173	-	-
	Peru Nuevos Sol Fwd	3.192000 06-05-09	PEN/USD	-370,000	-	3.197	-	-
	Peru Nuevos Sol Fwd	3.110000 03-18-09	PEN/USD	271,000	-	3.173	-	-
トリニダード・トバゴ	Trinidad & Toba RgSS	5.8750% 05-17-27	USD	225,000	98.32	81.07	16,428,227	0.7
ウルグアイ	Uruguay Republic	5.0000% 09-14-18	UYU	1,270,000	123.20	84.17	4,169,089	0.2
	Uruguay Republic	9.2500% 05-17-17	USD	230,000	121.12	105.00	21,749,490	0.9
	Uruguay Republic	8.0000% 11-18-22	USD	115,000	88.83	92.00	9,528,348	0.4
	Uruguay Republic	7.6250% 03-21-36	USD	980,000	104.86	82.00	72,372,216	3.1
	Uruguay Peso	On-Hand	UYU	0			-	0.0
ベネズエラ	Venezuela Rep	8.5000% 10-08-14	USD	85,000	86.00	57.25	4,382,545	0.2

	PDVSA RgSS	5.2500% 04-12-17	USD	175,000	73.65	39.50	6,225,398	0.3
	Venezuela Repub RgSS	6.0000% 12-09-20	USD	85,000	40.50	40.50	3,100,316	0.1
	Venezuela Repub RgSS	9.0000% 05-07-23	USD	325,000	87.77	48.00	14,049,360	0.6
	PDVSA RgSS	5.3750% 04-12-27	USD	450,000	62.13	33.00	13,373,910	0.6
	Venezuela Rep	9.2500% 09-15-27	USD	395,000	95.63	57.50	20,454,878	0.9
	Venezuela Rep	9.3750% 01-13-34	USD	85,000	48.25	49.75	3,808,412	0.2
(ヨーロッパ・アフリカ・中東)								
エジプト	Egyptian Pound		EGP	130			-	0.0
ハンガリー	Hungary Government	6.0000% 10-24-12	HUF	40,200,000	88.35	88.58	15,087,601	0.6
	Hungary Government	5.5000% 02-12-14	HUF	45,000,000	77.79	84.67	16,143,796	0.7
	Hungary Forint Fwd	207.250000 03-18-09	HUF/USD	-36,481,000	-	213.489	-	-
	Hungary Forint Fwd	216.250000 03-18-09	HUF/USD	-31,300,000	-	213.489	-	-
	Hungary Forint Fwd	193.675000 03-18-09	HUF/USD	-8,700,000	-	213.489	-	-
イラク	Republic of Ira RgSS	5.8000% 01-15-28	USD	325,000	69.50	42.00	12,293,190	0.5
イスラエル	Israel Electric RgSS	7.2500% 01-15-19	USD	285,000	102.24	95.74	24,574,195	1.0
カザフスタン	Intergas Financ RgSS	6.3750% 05-14-17	USD	160,000	87.63	58.00	8,357,568	0.4
	Kazmunaigaz Nat RgSS	8.3750% 07-02-13	USD	100,000	87.00	78.00	7,024,680	0.3
	Kazmunaigaz Nat RgSS	9.1250% 07-02-18	USD	490,000	100.64	68.00	30,007,992	1.3
	Kazakhstan Teng Fwd	127.300000 05-15-09	KZT/USD	-28,700,000	-	141.10	-	-
モロッコ	Morocco Kingdom RgSS	5.3750% 06-27-17	EUR	185,000	97.33	85.00	18,629,408	0.8
ナイジェリア	NGN CLN RgSS	0.0000% 02-05-09	USD	75,000	100.04	84.68	5,719,913	0.2
	NGN CLN Discount RgSS	Discount 03-06-09	USD	100,000	100.08	83.89	7,555,133	0.3
	Nigeria Tre CLN RgSS	0.0000% 04-09-09	USD	70,000	100.00	84.21	5,308,704	0.2
ポーランド	Poland Government	5.2500% 01-15-14	USD	75,000	97.50	99.62	6,728,833	0.3
	Poland Government	5.0000% 10-19-15	USD	35,000	90.64	97.60	3,076,450	0.1
	Poland Zloty Fwd	2.900240 03-18-09	PLN/USD	355,000	-	3.226	-	-
	Poland Zloty Fwd	2.994497 03-18-09	PLN/USD	-355,000	-	3.226	-	-
ロシア	TransCapitalIn RgSS	7.7000% 08-07-13	USD	135,000	100.00	79.00	9,604,899	0.4
	TransCapitalInv RgSS	8.7000% 08-07-18	USD	135,000	100.00	69.00	8,389,089	0.4
	Russia Fed RgSS	7.5000% 03-31-30	USD	1,891,400	110.14	89.75	152,879,687	6.5
	Gazprom RgSS	8.6250% 04-28-34	USD	40,000	95.50	78.50	2,827,884	0.1
セルビア	Serbia Rep RgSS	3.7500% 11-01-24	USD	115,000	67.75	65.00	6,731,985	0.3
南アフリカ	South Africa Rep	7.3750% 04-25-12	USD	155,000	94.25	102.38	14,290,833	0.6
	South Africa Rep	6.5000% 06-02-14	USD	275,000	105.75	98.25	24,333,086	1.0
	South Africa Rep	5.8750% 05-30-22	USD	240,000	64.75	88.00	19,020,672	0.8
チュニジア	Banque de Tunisie	7.3750% 04-25-12	USD	230,000	102.93	101.50	21,024,507	0.9
トルコ	TURKGB I/L 2-15-12	10.0000% 02-15-12	TRY	232,740	81.65	93.50	12,153,640	0.5
	Turkey Republic	11.0000% 01-14-13	USD	240,000	115.25	112.50	24,316,200	1.0
	Turkey Republic	9.5000% 01-15-14	USD	155,000	115.88	108.50	15,145,841	0.6
	Turkey Republic	7.0000% 03-11-19	USD	500,000	96.48	94.00	42,328,200	1.8

	Turkey Republic	6.8750% 03-17-36	USD	325,000	98.63	83.50	24,440,033	1.0
	Turkey Republic	7.2500% 03-05-38	USD	280,000	85.40	89.00	22,442,952	1.0
	Turkish Lira (New) Fwd	1.571500 03-18-09	TRY/USD	-123,000	-	1.652	-	-
	Turkish Lira (New) Fwd	1.634500 03-18-09	TRY/USD	-24,000	-	1.652	-	-
	Turkish Lira (New) Fwd	1.619500 03-18-09	TRY/USD	-40,000	-	1.652	-	-
ウクライナ	Ukraine Govt In RgSS	6.3850% 06-26-12	USD	560,000	102.13	48.00	24,208,128	1.0
	CDS UKRAI 3.64 07-13	3.6400% 07-20-13	USD	-210,000	100.00	45.32	-8,571,001	-0.4
(アジア)								
中国	China Renminbi Fwd	6.800000 09-21-09	CNY/USD	615,000	-	6.999	-	-
	China Renminbi Fwd	6.797000 09-21-09	CNY/USD	625,000	-	6.999	-	-
	China Renminbi Fwd	6.797500 09-21-09	CNY/USD	625,000	-	6.999	-	-
	China Renminbi Fwd	7.010000 09-21-09	CNY/USD	-933,000	-	6.999	-	-
	China Renminbi Fwd	7.010000 09-21-09	CNY/USD	-932,000	-	6.999	-	-
インドネシア	PLN IJ RgSS	7.2500% 10-17-11	USD	415,000	100.00	78.00	29,152,422	1.2
	PLN IJ RgSS	7.2500% 06-28-17	USD	240,000	57.00	57.00	12,320,208	0.5
	Indonesia Rep RgSS	6.7500% 03-10-14	USD	425,000	102.68	86.00	32,916,930	1.4
	Indonesia Rep RgSS	7.7500% 01-17-38	USD	840,000	103.04	71.00	53,711,784	2.3
	Indonesia Rupia Fwd	9725.000000 07-16-09	IDR/USD	1,285,629,000	-	12,022.159	-	-
	Indonesia Rupia Fwd	10020.00 07-16-09	IDR/USD	-1,285,629,000	-	12,022.159	-	-
マレーシア	Petronas RgSS	7.0000% 05-22-12	USD	625,000	107.20	104.57	58,860,402	2.5
	Penerbangan MY RgSS	5.6250% 03-15-16	USD	115,000	107.03	104.86	10,860,349	0.5
パキスタン	Pakistan Govt I RgSS	7.1250% 03-31-16	USD	140,000	44.00	40.00	5,043,360	0.2
	Pakistan Govt I RgSS	6.8750% 06-01-17	USD	200,000	39.50	40.00	7,204,800	0.3
フィリピン	Philippines Republic	8.3750% 02-15-11	USD	245,000	109.38	105.25	23,223,097	1.0
	Philippines Rep	9.0000% 02-15-13	USD	255,000	106.00	106.00	24,343,218	1.0
	Philippines Republic	8.2500% 01-15-14	USD	240,000	105.50	104.75	22,641,084	1.0
	Philippine Rep Put12	9.3750% 01-18-17	USD	195,000	111.00	110.00	19,317,870	0.8
	Philippines Republic	8.3750% 06-17-19	USD	485,000	99.16	102.75	44,880,275	1.9
	National Power RgSS	6.8750% 11-02-16	USD	275,000	102.00	87.00	21,546,855	0.9
	National Power Corp	9.6250% 05-15-28	USD	240,000	84.00	85.50	18,480,312	0.8
	Philippines Republic	6.2500% 03-15-16	EUR	100,000	82.50	83.25	9,862,628	0.4
韓国	S Korean Won Fwd	1006.750000 07-01-09	KRW/USD	-140,945,000	-	1,350.682	-	-
	S Korean Won Fwd	1129.000000 07-01-09	KRW/USD	140,945,000	-	1,350.682	-	-
ベトナム	Vietnam Dong Fwd	19000.000000 05-29-09	VND/USD	-4,023,300,000	-	18,749.515	-	-
(ヨーロッパ)								
ユーロ	EUR Fwd	1.257410 03-18-09	EUR/USD	-55,000	-	1.323	-	-
	EUR Fwd	1.247500 03-18-09	EUR/USD	-45,000	-	1.323	-	-
	EUR Fwd	1.300800 03-18-09	EUR/USD	-130,000	-	1.323	-	-
	EUR Fwd	1.298000 03-18-09	EUR/USD	-29,000	-	1.323	-	-
	EUR Fwd	1.296600 03-18-09	EUR/USD	-52,000	-	1.323	-	-
	EUR Fwd	1.278300 03-18-09	EUR/USD	-31,000	-	1.323	-	-

	EUR	Fwd	1.245400 03-18-09	EUR/USD	-57,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.245800 03-18-09	EUR/USD	-30,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.266700 03-18-09	EUR/USD	-46,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.275950 03-18-09	EUR/USD	125,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.402400 03-18-09	EUR/USD	-89,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.382421 03-18-09	EUR/USD	86,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.396350 03-18-09	EUR/USD	-20,000	-	1.323	-	-
	EUR	Fwd	1.316853 03-18-09	EUR/USD	-88,000	-	1.323	-	-
(北アメリカ)									
アメリカ	SSB Euro Time Dep		0.0100%	USD	1,631,531	100.00	100.00	146,935,643	6.3
	Futures Collateral			USD	24,200	100.00	100.00	2,179,452	0.1
	US Dollar	Trade Receivable		USD	59,851			-	0.0
	US Dollar			USD	10			-	0.0
	CDS UKRAI Offset		0.0000% 07-20-13	USD	210,000	100.00	100.00	18,912,600	0.8
	US 10YR TYH9	03-09		USD	11		126.53	125,349,200	5.4

[次へ](#)

当ファンドは「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」および「しんきん高格付外国債券マザーファンド」受益証券を投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次のとおりです。

「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外です。

財務諸表

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

（１）貸借対照表

区分		平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		9,213,627	10,829,939
コール・ローン		186,831,412	207,239,948
国債証券		17,417,349,618	12,382,233,293
特殊債券		1,693,166,833	1,292,124,733
未収入金		487,092,376	—
未収利息		395,553,903	194,503,686
前払費用		38,946,909	6,671,203
流動資産合計		20,228,154,678	14,093,602,802
資産合計		20,228,154,678	14,093,602,802
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,895,000	—
未払金		247,885,738	—
未払解約金		173,500,000	500,000
流動負債合計		424,280,738	500,000
負債合計		424,280,738	500,000
純資産の部			
元本等			
元本	※1,※2	14,029,577,956	12,641,005,652
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		5,774,295,984	1,452,097,150
剰余金又は欠損金合計（△）		5,774,295,984	1,452,097,150
元本等合計		19,803,873,940	14,093,102,802
純資産合計		19,803,873,940	14,093,102,802
負債・純資産合計		20,228,154,678	14,093,602,802

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成20年2月 6日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
----	------------------------------	------------------------------

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券及び特殊債券 同左
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書の開示対象ファンドの特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
----	--------------	--------------

※ 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	期首元本額 15,383,332,293円	期首元本額 14,029,577,956円
	期中追加設定元本額 215,853,767円	期中追加設定元本額 68,180,045円
元本の内訳	期中一部解約元本額 1,569,608,104円	期中一部解約元本額 1,456,752,349円
	しんきん海外ソブリン債セレクション 欧州ソブリン債ポートフォリオ 1,696,069,917円 しんきん海外ソブリン債セレクション 欧米ソブリン債ポートフォリオ 1,310,936,407円 しんきん3資産ファンド （毎月決算型） 9,187,710,303円 しんきんグローバル6資産ファンド （毎月決算型） 1,824,439,433円 しんきんグローバル債券ファンド （奇数月決算型） 10,421,896円	しんきん海外ソブリン債セレクション 欧州ソブリン債ポートフォリオ 1,504,877,761円 しんきん海外ソブリン債セレクション 欧米ソブリン債ポートフォリオ 1,333,491,407円 しんきん3資産ファンド （毎月決算型） 8,171,115,562円 しんきんグローバル6資産ファンド （毎月決算型） 1,614,194,740円 しんきんグローバル債券ファンド （奇数月決算型） 17,326,182円
※ 2 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	合計14,029,577,956円	合計12,641,005,652円
	14,029,577,956口	12,641,005,652口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

	平成20年7月18日現在		平成21年1月19日現在	
種 類	貸借対照表計上額	当期間の損益に 含まれた評価差額	貸借対照表計上額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	17,417,349,618	△809,279,310	12,382,233,293	305,351,475
特殊債券	1,693,166,833	△74,372,047	1,292,124,733	21,558,815
合 計	19,110,516,451	△883,651,357	13,674,358,026	326,910,290

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

項目	自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として利用しています。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減を図ることを目的とします。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	取引について、発注伝票の事前審査を行い適正な取引であることを確認しております。また、事後的には、運用管理票を用いて、組入比率・評価損益等についてチェックしております。	同左

II 取引の時価等に関する事項
（通貨関連）

平成20年7月18日現在					
区 分	種 類	契約額（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ユーロ	249,990,000	—	252,885,000	△2,895,000

合 計	249,990,000	—	252,885,000	△2,895,000
-----	-------------	---	-------------	------------

平成21年1月19日現在

該当事項はありません。

(注) 時価の算定方法

1. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日にもっとも近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19 日 至 平成21年1月19日
該当事項はありません。	同左

(1口当たり情報)

平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
1口当たり純資産額 1.4116円 (1万口当たり純資産額 14,116円)	1口当たり純資産額 1.1149円 (1万口当たり純資産額 11,149円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ユーロ	BGB 4.250 9/28/14	2,100,000.00	2,195,760.00	
国債証券	ユーロ	BGB 5.750 9/28/10	4,500,000.00	4,779,360.00	
国債証券	ユーロ	BTNS 3.000 01/12/10	1,500,000.00	1,522,770.00	
国債証券	ユーロ	BTNS 4.500 07/12/13	1,700,000.00	1,831,750.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 2.750 06/15/10	700,000.00	706,300.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 4.250 02/01/15	3,000,000.00	3,079,800.00	

国債証券	ユーロ	BTPS 4.750 02/01/13	3,400,000.00	3,561,160.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 5.000 02/01/12	6,800,000.00	7,179,440.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 5.250 08/01/11	4,700,000.00	4,961,320.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 5.250 08/01/17	3,000,000.00	3,220,500.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 5.250 11/01/29	3,600,000.00	3,581,640.00	
国債証券	ユーロ	BTPS 6.500 11/01/27	4,700,000.00	5,358,000.00	
国債証券	ユーロ	DBR 3.750 01/04/15	5,600,000.00	5,993,960.00	
国債証券	ユーロ	DBR 3.750 07/04/13	3,500,000.00	3,727,150.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.00 01/04/18	8,100,000.00	8,841,150.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.25 07/04/18	2,500,000.00	2,776,000.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.750 07/04/34	4,900,000.00	5,485,060.00	
国債証券	ユーロ	DBR 6.250 01/04/24	3,500,000.00	4,506,600.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 3.750 4/25/17	4,600,000.00	4,750,420.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 4.000 04/25/14	5,500,000.00	5,812,950.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 4.000 10/25/14	3,300,000.00	3,496,350.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 5.000 10/25/16	3,000,000.00	3,360,300.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 5.750 10/25/32	5,000,000.00	6,149,500.00	
国債証券	ユーロ	OBL 3.50 4/12/13	600,000.00	631,410.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 5.350 10/31/11	4,300,000.00	4,604,440.00	
ユーロ 小計			94,100,000 (11,410,566,000)	102,113,090.00 (12,382,233,293)	
国債証券 合計			11,410,566,000 <11,410,566,000>	12,382,233,293 <12,382,233,293>	
特殊債券	ユーロ	EIB 3.625 10/15/13	3,500,000.00	3,591,000.00	
特殊債券	ユーロ	EIB 5.375 10/15/12	3,000,000.00	3,262,500.00	
特殊債券	ユーロ	EIB 5.625 10/15/10	3,600,000.00	3,802,320.00	
ユーロ 小計			10,100,000 (1,224,726,000)	10,655,820.00 (1,292,124,733)	
特殊債券 合計			1,224,726,000 <1,224,726,000>	1,292,124,733 <1,292,124,733>	
合 計			12,635,292,000 <12,635,292,000>	13,674,358,026 <13,674,358,026>	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

注2 合計欄の< >内の金額は外貨建有価証券の邦貨換算額の合計であり、内書で表示しています。

注3 外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
ユーロ	国債証券25銘柄	100.0%	90.6%
	特殊債券 3銘柄	100.0%	9.4%

第2 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）に記載しております。

「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外です。

財務諸表

しんきん米国ソブリン債マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分		平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		26,199,437	9,122,885
金銭信託		261,882	301,601
コール・ローン		336,214,538	127,191,703
国債証券		17,031,408,273	12,300,075,176
特殊債券		1,872,189,455	1,648,230,996
未収入金		—	187,870,968
未収利息		208,609,722	162,835,502
前払費用		27,838,626	2,088,481
流動資産合計		19,502,721,933	14,437,717,312
資産合計		19,502,721,933	14,437,717,312
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		—	1,045,880
未払金		21,503,493	91,773,759
未払解約金		185,000,000	100,000,000
流動負債合計		206,503,493	192,819,639
負債合計		206,503,493	192,819,639
純資産の部			
元本等			
元本	※1, ※2	17,523,180,335	13,608,659,926
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		1,773,038,105	636,237,747
剰余金又は欠損金合計（△）		1,773,038,105	636,237,747
元本等合計		19,296,218,440	14,244,897,673
純資産合計		19,296,218,440	14,244,897,673
負債・純資産合計		19,502,721,933	14,437,717,312

(2) 注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19 日 至 平成21年1月19 日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券及び特殊債券 同左
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書開示対象ファンドの特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
※ 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額	期首元本額 18,157,879,409円 期中追加設定元本額 584,105,386円 期中一部解約元本額 1,218,804,460円	期首元本額 17,523,180,335円 期中追加設定元本額 34,814,084円 期中一部解約元本額 3,949,334,493円
元本の内訳	しんきん海外ソブリン債セレクション 米国ソブリン債ポートフォリオ 1,915,236,728円 しんきん海外ソブリン債セレクション 欧米ソブリン債ポートフォリオ 1,654,373,775円 しんきん3資産ファンド (毎月決算型) 11,659,936,017円 しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 2,284,818,700円 しんきんグローバル債券ファンド (奇数月決算型) 8,815,115円 合計17,523,180,335円	しんきん海外ソブリン債セレクション 米国ソブリン債ポートフォリオ 1,470,062,040円 しんきん海外ソブリン債セレクション 欧米ソブリン債ポートフォリオ 1,454,851,450円 しんきん3資産ファンド (毎月決算型) 8,934,606,270円 しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 1,736,249,171円 しんきんグローバル債券ファンド (奇数月決算型) 12,890,995円 合計13,608,659,926円
※ 2 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	17,523,180,335口	13,608,659,926口

(有価証券関係に関する注記)

売買目的有価証券

(単位：円)

平成20年7月18日現在			平成21年1月19日現在	
種 類	貸借対照表計上額	当期間の損益に含まれた評価差額	貸借対照表計上額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	17,031,408,273	△358,423,927	12,300,075,176	865,886,552
特殊債券	1,872,189,455	△23,094,540	1,648,230,996	28,278,426
合 計	18,903,597,728	△381,518,467	13,948,306,172	894,164,978

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

I 取引の状況に関する事項

項目	自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
----	-------------------------------	------------------------------

1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として利用しています。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減を図ることを目的とします。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	取引について、発注伝票の事前審査を行い適正な取引であることを確認しております。また、事後的には、運用管理票を用いて、組入比率・評価損益等についてチェックしております。	同左

II 取引の時価等に関する事項 (通貨関連)

平成20年7月18日現在
該当事項はありません。

平成21年1月19日現在					
区 分	種 類	契約額（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 ドル	99,065,120	—	100,111,000	△1,045,880
合 計		99,065,120	—	100,111,000	△1,045,880

(注) 時価の算定方法

1. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - ① 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 - ② 計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日にもっとも近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
1口当たり純資産額 1.1012円 (1万口当たり純資産額 11,012円)	1口当たり純資産額 1.0468円 (1万口当たり純資産額 10,468円)

(2) 附属明細表

第1 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	T-BOND 4.375 2/15/38	2,000,000.00	2,584,687.50	
国債証券	米ドル	T-BOND 5.250 2/15/29	5,300,000.00	6,874,265.62	
国債証券	米ドル	T-BOND 6.250 8/15/23	5,400,000.00	7,273,968.75	
国債証券	米ドル	T-BOND 6.50 11/15/26	5,800,000.00	8,411,812.50	
国債証券	米ドル	T-BOND 7.5 11/15/16	5,200,000.00	7,050,062.50	
国債証券	米ドル	T-BOND 7.875 2/15/21	2,000,000.00	2,940,625.00	
国債証券	米ドル	T-BOND 8.000 11/15/21	5,600,000.00	8,407,000.00	
国債証券	米ドル	T-BOND 8.125 5/15/21	2,900,000.00	4,357,250.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.500 12/31/13	1,000,000.00	1,001,640.63	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.00 9/30/10	3,600,000.00	3,689,578.11	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.125 04/30/10	3,000,000.00	3,065,507.82	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.625 5/31/10	2,000,000.00	2,058,359.38	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.875 1/31/13	1,900,000.00	2,031,218.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.875 6/30/10	4,200,000.00	4,346,671.89	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.375 07/31/13	3,700,000.00	4,042,828.12	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.375 11/30/12	6,000,000.00	6,515,156.28	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.5 2/15/18	4,200,000.00	4,611,468.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.750 11/15/18	2,500,000.00	2,811,718.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.875 10/31/12	1,800,000.00	1,982,250.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.875 5/15/18	1,600,000.00	1,813,750.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.0 02/15/15	4,000,000.00	4,568,125.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.0 2/15/14	3,000,000.00	3,403,593.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.000 8/15/18	1,000,000.00	1,144,687.50	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.25 9/30/12	4,000,000.00	4,448,437.52	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.250 8/15/13	5,300,000.00	6,030,406.25	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.5 5/15/17	2,500,000.00	2,920,312.50	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.5 11/15/15	4,500,000.00	5,331,796.87	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.500 2/28/11	5,000,000.00	5,397,265.65	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.875 2/15/12	2,700,000.00	3,009,656.25	
国債証券	米ドル	T-NOTE 4.875 5/31/11	6,000,000.00	6,577,031.28	
国債証券	米ドル	T-NOTE 5.000 8/15/11	5,800,000.00	6,434,828.15	
米ドル 小計			113,500,000 (10,330,770,000)	135,135,961.07 (12,300,075,176)	
国債証券 合計			10,330,770,000 <10,330,770,000>	12,300,075,176 <12,300,075,176>	
特殊債券	米ドル	EIB 3.250 02/15/11	2,100,000.00	2,170,140.00	

特殊債券	米ドル	EIB 4.000 03/03/10	2,500,000.00	2,575,475.00	
特殊債券	米ドル	EIB 5.000 02/08/10	4,500,000.00	4,675,633.65	
特殊債券	米ドル	IADB 4.75 10/19/12	8,000,000.00	8,687,200.00	
米ドル 小計			17,100,000 (1,556,442,000)	18,108,448.65 (1,648,230,996)	
特殊債券 合計			1,556,442,000 <1,556,442,000>	1,648,230,996 <1,648,230,996>	
合 計			11,887,212,000 <11,887,212,000>	13,948,306,172 <13,948,306,172>	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

注2 合計欄の< >内の金額は外貨建有価証券の邦貨換算額の合計であり、内書で表示しています。

注3 外貨建有価証券の内訳

通 貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券31銘柄	100.0%	88.2%
	特殊債券 4銘柄	100.0%	11.8%

第2 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等および時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

「しんきん高格付外国債券マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外です。

財務諸表

しんきん高格付外国債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分		平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		4,150,759	14,376,092
コール・ローン		37,143,497	29,801,119
国債証券		2,841,104,470	1,966,621,675
地方債証券		697,551,511	463,807,426
未収利息		46,676,743	40,647,771
前払費用		222,413	36,679
流動資産合計		3,626,849,393	2,515,290,762
資産合計		3,626,849,393	2,515,290,762
純資産の部			
元本等			
元本	※1, ※3	3,154,138,634	3,030,256,290
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）	※2	472,710,759	△514,965,528
剰余金又は欠損金合計（△）		472,710,759	△514,965,528
元本等合計		3,626,849,393	2,515,290,762
純資産合計		3,626,849,393	2,515,290,762
負債・純資産合計		3,626,849,393	2,515,290,762

(2) 注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び地方債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。	国債証券及び地方債証券 同左
2. デリバティブ等の評価基準および評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として本報告書開示対象ファンドの特定期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
----	--------------	--------------

※ 1 信託財産に係る 期首元本額、期 中追加設定元本 額及び期中一部 解約元本額	期首元本額 3,286,231,552円 期中追加設定元本額 20,996,949円 期中一部解約元本額 153,089,867円	期首元本額 3,154,138,634円 期中追加設定元本額 12,030,186円 期中一部解約元本額 135,912,530円
元本の内訳	しんきんグローバル6資産ファン ド （毎月決算型） 2,235,114,895円 しんきんグローバル債券ファン ド （奇数月決算型） 12,863,794円 しんきん高格付外国債券スペシ ャ ル （適格機関投資家限定） 906,159,945円 合計3,154,138,634円	しんきんグローバル6資産ファン ド （毎月決算型） 2,102,872,090円 しんきんグローバル債券ファン ド （奇数月決算型） 24,893,980円 しんきん高格付外国債券スペシ ャ ル （適格機関投資家限定） 902,490,220円 合計3,030,256,290円
※ 2 元本の欠損	-----	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 514,965,528円であります。
※ 3 本報告書におけ る開示対象ファ ンドの特定期間 末日における受 益権の総数	3,154,138,634口	3,030,256,290口

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

（単位：円）

	平成20年7月18日現在		平成21年1月19日現在	
種 類	貸借対照表 計上額	当期間の損益に 含まれた評価差額	貸借対照表 計上額	当期間の損益に 含まれた評価差額
国債証券	2,841,104,470	29,886,698	1,966,621,675	197,807,982
地方債証券	697,551,511	10,683,253	463,807,426	48,107,592
合 計	3,538,655,981	40,569,951	2,430,429,101	245,915,574

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

I 取引の状況に関する事項

項目	自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
1. 取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として利用しています。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減を図ることを目的とします。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	取引について、発注伝票の事前審査を行い適正な取引であるかを確認しております。また、事後的には、運用管理票を用いて、組入比率・評価損益等についてチェックしております。	同左

II 取引の時価等に関する事項

（通貨関連）

平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
該当事項はありません。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成20年2月 6 日 至 平成20年7月18日	自 平成20年7月19日 至 平成21年1月19日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

平成20年7月18日現在	平成21年1月19日現在
1口当たり純資産額 1.1499円 (1万口当たり純資産額 11,499円)	1口当たり純資産額 0.8301円 (1万口当たり純資産額 8,301円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

①株式

該当事項はありません。

②株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	カナダドル	CAN 4.00 6/1/16	750,000.00	837,300.00	
国債証券	カナダドル	CAN 4.00 6/1/17	800,000.00	893,192.00	
国債証券	カナダドル	CAN 4.25 6/1/18	1,600,000.00	1,813,600.00	
国債証券	カナダドル	CAN 4.500 6/1/15	3,500,000.00	4,010,300.00	
カナダドル 小計			6,650,000.00 (487,112,500)	7,554,392.00 (553,359,214)	
国債証券	ポンド	UKT 4.000 9/7/16	3,450,000.00	3,650,962.50	
国債証券	ポンド	UKT 5.000 9/7/14	3,120,000.00	3,477,021.60	
ポンド 小計			6,570,000.00 (887,935,500)	7,127,984.10 (963,347,051)	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 4.250 5/19/17	4,200,000.00	4,465,440.00	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 5.000 5/15/15	4,500,000.00	4,981,500.00	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 6.000 5/16/11	3,000,000.00	3,236,700.00	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 6.500 5/15/13	18,400,000.00	21,272,240.00	
ノルウェークローネ 小計			30,100,000.00 (398,825,000)	33,955,880.00 (449,915,410)	
国債証券 合計			1,773,873,000 <1,773,873,000>	1,966,621,675 <1,966,621,675>	
地方債証券	オーストラリアドル	NSWTC 6.00 5/01/12	1,800,000.00	1,889,892.00	
地方債証券	オーストラリアドル	QTC 6.000 10/14/15	1,200,000.00	1,291,050.00	
地方債証券	オーストラリアドル	QTC 6.000 6/14/11	1,600,000.00	1,675,776.00	
地方債証券	オーストラリアドル	QTC 6.000 8/14/13	2,500,000.00	2,655,550.00	
オーストラリアドル 小計			7,100,000.00 (438,354,000)	7,512,268.00 (463,807,426)	
地方債証券 合計			438,354,000 <438,354,000>	463,807,426 <463,807,426>	
合 計			2,212,227,000 <2,212,227,000>	2,430,429,101 <2,430,429,101>	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額です。

注2 合計欄の< >内の金額は外貨建有価証券の邦貨換算額の合計であり、内書で表示しています。

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
カナダドル	国債証券4銘柄	100.0%	22.8%
ポンド	国債証券2銘柄	100.0%	39.6%
ノルウェークローネ	国債証券4銘柄	100.0%	18.5%
オーストラリアドル	地方債証券4銘柄	100.0%	19.1%

第2 デリバティブ取引および為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。[前へ](#)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年2月27日現在

I 資産総額	70,939,620	円
II 負債総額	71,152	円
III 純資産総額（I－II）	70,868,468	円
IV 発行済数量	86,666,647	口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.8177	円

（参考）「しんきんグローバル債券ファンド」（奇数月決算型）の各ポートフォリオが投資する「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」及び「しんきん高格付外国債券マザーファンド」のファンドの純資産額計算書は、以下のとおりです。

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

I 資産総額	14,196,154,790	円
II 負債総額	29,000,000	円
III 純資産総額（I－II）	14,167,154,790	円
IV 発行済数量	12,394,112,778	口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1431	円

しんきん米国ソブリン債マザーファンド

I 資産総額	14,078,014,292	円
II 負債総額	2,000,000	円
III 純資産総額（I－II）	14,076,014,292	円
IV 発行済数量	12,939,370,269	口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0878	円

しんきん高格付外国債券マザーファンド

I 資産総額	2,538,444,849	円
II 負債総額	—	円
III 純資産総額（I－II）	2,538,444,849	円
IV 発行済数量	2,945,705,233	口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.8617	円

第5【設定及び解約の実績】**しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）**

計算期間	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間 自：平成20年 2 月 6日 至：平成20年 7 月18日	52,280,223	2,937,141
第2特定期間 自：平成20年 7 月19日 至：平成21年 1 月19日	38,976,473	2,051,681

（注）設定口数には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本の額

200百万円(本書提出日現在)

委託会社が発行する株式総数 16,000株

発行済株式総数 4,000株

最近5年間ににおける主な資本の額の増減ありません。

(2)委託会社の機構

①会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は就任後1年内の最終の決算期に関する定時株主総会の終結の時までです。ただし、補欠または増員で選任された取締役の任期は、現任取締役の任期の満了の時までとします。

取締役会は、代表取締役を選任し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議に従い業務を執行します。また、取締役会は、その決議をもって、取締役社長1名、専務取締役および常務取締役若干名を置くことができます。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、原則として取締役社長が招集します。取締役会の議長は、原則として取締役社長がこれにあたります。

取締役会の決議は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役の過半数が出席して、出席取締役の過半数をもって決します。

②投資運用の意思決定機構

a 商品企画体制

・商品検討委員会

当委員会において、事務局である運用本部運用企画部が情報を収集し、投資環境、運用環境、販売環境に適合した商品企画案を提出します。また当委員会は、新規設定する商品に関する基本的な重要事項について協議し、委員長がこれを決定します。

b 運用体制

・投資政策委員会

当委員会において、経済環境、資産別市場見通し並びに投資環境等を検討し、基本的な投資方針、投資戦略について協議し、委員長がこれを決定します。

・投資運用委員会

当委員会は、投資政策委員会において協議、決定された基本的な投資方針等に基づいて、ファンド運用についての具体的なガイドライン、諸方策を協議、決定します。併せて、個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。

・投資管理委員会

事務局である運用管理部が、前1ヵ月間の、①各ファンドの運用成績、②ポートフォリオの運用内容等について考査し、当委員会に報告を行います。またコンプライアンス部が、③法令・諸規則や運用に関する諸決定事項の遵守状況等について当委員会において報告を行います。

・投資決定プロセス

- i 信金中央金庫グループ及び内外の調査機関からの情報に基づき、投資環境等について当社独自の綿密な調査・分析を行います。
- ii 投資政策委員会で、これらのファンダメンタルズ分析、市場分析を踏まえて基本的な投資方針を策定します。また、毎週開かれる投資運用委員会においては、基本的な投資方針に基づき当面の運用に当たってのガイドラインを決定します。また、併せて個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。

C コンプライアンス体制

当社は、「コンプライアンス規程」にもとづき、取締役会のもとでコンプライアンスに係る問題を一元管理するため、以下の機関をもって構成するコンプライアンス管理体制を構築しています。

1) 取締役会

当社のコンプライアンスに関する基本方針ならびに重要事項について決定します。

2) コンプライアンス委員会

社長を委員長として、原則として月1回開催される他、必要に応じて随時開催し、コンプライアンス上の重要事項について審議します。

3) コンプライアンス部

コンプライアンスに関する全般を担当し、コンプライアンス第2次審査を行います。

4) 部門長

所管業務に関し、コンプライアンス第1次審査を行い、取締役会で決定したコンプライアンスプログラムを推進します。

5) コンプライアンス担当者

各業務部門に配置され、部門長を補佐して、コンプライアンス第1次審査を行い、コンプライアンスプログラムを推進します。

6) 内部監査部

社内検査に関し、企画・立案・実施を担当します。

2 【事業内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行います。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行います。

委託会社の運用する証券投資信託は、平成21年2月27日現在、以下のとおりです。

（親投資信託を除きます。）

（単位：百万円）

種 類	本 数	純資産総額
追加型株式投資信託	34	267,608

合 計	34	267,608
-----	----	---------

(注)純資産総額は百万円未満を切捨てしています。

3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、前事業年度(平成18年4月1日から平成19年3月31日まで)については改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、改正前の「投資信託及び投資法人に関する法律施行規則」（平成12年総理府令第129号）に基づいて作成しており、当事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条および第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）および「企業内容等の開示に関する内閣府令等の一部を改正する内閣府令」（平成19年内閣府令第65号）附則第11条第3項に基づいて作成しております。

2. 当社は、証券取引法第193条の2の規定に基づき、前事業年度（平成18年4月1日から平成19年3月31日まで）の財務諸表についてはみずす監査法人の監査を受けており、当事業年度（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき新日本監査法人の監査を受けております。

また、第19期事業年度に係る中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

なお、新日本監査法人は監査法人の種類の変更により平成20年7月1日をもって新日本有限責任監査法人となりました。

1 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

科 目	注記 番号	前事業年度 (平成19年3月31日現在)			当事業年度 (平成20年3月31日現在)		
		金 額		構成比 (%)	金 額		構成比 (%)
(資産の部)		千円	千円		千円	千円	
流 動 資 産							
現金			297			—	
預金			1,109,533			—	
現金・預金			—			1,449,948	
前払費用			23,621			22,242	
繰延税金資産			29,304			37,800	
未収委託者報酬			258,316			276,090	
未収収益			25,862			25,358	
その他の流動資産			3,518			6,922	
流 動 資 産 計			1,450,454	91.1		1,818,363	92.8
固 定 資 産							
有形固定資産	*1		71,427	4.5		65,621	3.3
建物		49,296			44,675		
器具備品		22,131			20,946		
無形固定資産	*2		4,057	0.3		12,790	0.7
ソフトウェア		2,715			11,489		
電話加入権		959			959		
その他		381			341		
投資その他の資産			65,906	4.1		62,999	3.2
繰延税金資産		17,481			15,142		
長期差入保証金		46,324			46,324		
長期前払費用		1,062			1,531		
その他投資		18,703			—		
貸倒引当金		△17,665			—		
固 定 資 産 計			141,391	8.9		141,411	7.2
資 産 合 計			1,591,845	100.0		1,959,775	100.0

		前事業年度 (平成19年3月31日現在)			当事業年度 (平成20年3月31日現在)		
科 目	注記 番号	金 額		構成比 (%)	金 額		構成比 (%)
(負債の部)		千円	千円		千円	千円	
流 動 負 債							
未払金			199,925			222,098	
未払手数料	*4	166,579			190,422		
その他未払金		33,345			31,676		
未払法人税等			62,738			115,027	
未払消費税			14,453			18,855	
前受収益			12,993			9,828	
賞与引当金			53,244			63,014	
その他の流動 負債			6,633			15,300	
流 動 負 債 計			349,988	22.0		444,125	22.7
固 定 負 債							
退職給付引当金			25,297			29,902	
役員退職慰労 引当金			—			7,312	
固 定 負 債 計			25,297	1.6		37,215	1.9
負 債 合 計			375,286	23.6		481,340	24.6
科 目	注記 番号	金 額		構成比 (%)	金 額		構成比 (%)
(純資産の部)		千円	千円		千円	千円	
株 主 資 本							
資 本 金	*3		200,000	12.5		200,000	10.2
利益剰余金							
利益準備金			2,000			2,000	
その他利益剰 余金			388,000			388,000	
役員退職慰 労積立金		18,000			18,000		
別途積立金		370,000			370,000		
繰越利益剰余金			626,559			888,434	
利益剰余金計			1,016,559	63.9		1,278,434	65.2
純 資 産 合 計			1,216,559	76.4		1,478,434	75.4
負 債 ・ 純 資 産 合 計			1,591,845	100.0		1,959,775	100.0

(2) 【損益計算書】

科 目	注記 番号	前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日			当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日		
		金 額		百分比 (%)	金 額		百分比 (%)
営 業 収 益		千円	千円		千円	千円	
投資顧問料			135,559			134,356	
委託者報酬			2,219,125			2,849,956	
営 業 収 益 計			2,354,685	100.0		2,984,312	100.0
営 業 費 用							
支払手数料			1,019,835			1,365,047	
広告宣伝費			9,457			8,517	
調査費			279,292			384,369	
営業雑経費			84,244			126,434	
印刷費		78,764			121,010		
郵便料		321			344		
電信電話料		1,979			1,969		
協会費		3,178			3,110		
営 業 費 用 計			1,392,829	59.2		1,884,369	63.1
一 般 管 理 費							
給料			353,894			393,685	
役員報酬	*1	23,601			30,249		
給料・手当		237,579			267,619		
賞与		44,666			38,919		
法定福利費		38,586			44,337		
福利厚生費		1,115			1,449		
その他給料		8,344			11,109		
役員退職慰労金			1,500			—	
役員退職慰労引当金繰入			—			2,250	
交際費			4,850			5,299	
旅費交通費			16,058			15,384	
租税公課			9,975			5,195	
不動産賃借料			60,072			60,058	
賞与引当金繰入			53,244			63,014	
退職給付費用			34,926			37,663	
固定資産減価償却費			13,623			14,549	
諸経費			47,592			56,522	
一 般 管 理 費 計			595,737	25.3		653,623	21.9
営 業 利 益			366,117	15.5		446,319	15.0
営 業 外 収 益							
受取利息			902			3,204	
その他営業外収益			40			122	
営 業 外 収 益 計			942	0.0		3,327	0.1
営 業 外 費 用							
雑損失			185			594	
営 業 外 費 用 計			185	0.0		594	0.0
経 常 利 益			366,874	15.6		449,053	15.1

		前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日			当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日		
科 目	注記 番号	金 額		百分比 (%)	金 額		百分比 (%)
特 別 利 益		千円	千円		千円	千円	
貸倒引当金戻入		0			85		
賞与引当金戻入		—			831		
前年度損益修正		—			5		
特 別 利 益 計			0	0.0		922	0.0
特 別 損 失							
中途解約手数料			1,411	0.1		—	—
過年度役員退職慰労引当金繰入			—	—		5,062	0.2
特 別 損 失 計			1,411	0.1		5,062	0.2
税引前当期純利益			365,463	15.5		444,913	14.9
法人税等	*2		152,347			—	
法人税、住民税及び事業税			—			189,195	
法人税等調整額			△1,832			△6,158	
当 期 純 利 益			214,948	9.1		261,875	8.8

（３）【株主資本等変動計算書及び利益処分計算書】
前事業年度（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

	株主資本									
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				自己株式	株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計		
						任意積立金	繰越利益剰余金			
平成18年3月31日残高(千円)	200,000	—	—	—	2,000	388,000	411,611	801,611	—	1,001,611
事業年度中の変動額										
新株の発行	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
当期純利益	—	—	—	—	—	—	214,948	214,948	—	214,948
自己株式の取得	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
株式資本以外の当期変動額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
事業年度中の変動額合計(千円)	—	—	—	—	—	—	214,948	214,948	—	214,948
平成19年3月31日残高(千円)	200,000	—	—	—	2,000	388,000	626,559	1,016,559	—	1,216,559

	評価・換算差額等			新株予約権	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰越ヘッジ損益	評価・換算差額等合計		
平成18年3月31日残高(千円)	—	—	—	—	1,001,611
事業年度中の変動額					
新株の発行	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—
当期純利益	—	—	—	—	214,948
自己株式の取得	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—
株式資本以外の当期変動額	—	—	—	—	—
事業年度中の変動額合計(千円)	—	—	—	—	214,948
平成19年3月31日残高(千円)	—	—	—	—	1,216,559

当事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

	株主資本									
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				自己株式	株主 資本 合計
		資本 準備 金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計		
						任意 積立金	繰越利益 剰余金			
平成19年3月31日残高 (千円)	200,000	—	—	—	2,000	388,000	626,559	1,016,559	—	1,216,559
事業年度中の変動額										
新株の発行	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
当期純利益	—	—	—	—	—	—	261,875	261,875	—	261,875
自己株式の取得	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
株式資本以外の当期 変動額	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
事業年度中の変動額合 計(千円)	—	—	—	—	—	—	261,875	261,875	—	261,875
平成20年3月31日残高 (千円)	200,000	—	—	—	2,000	388,000	888,434	1,278,434	—	1,478,434

	評価・換算差額等			新株予約権	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰越ヘッジ損益	評価・換算差額等合計		
平成19年3月31日残高(千円)	—	—	—	—	1,216,559
事業年度中の変動額					
新株の発行	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—
当期純利益	—	—	—	—	261,875
自己株式の取得	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—
株式資本以外の当期変動額	—	—	—	—	—
事業年度中の変動額合計(千円)	—	—	—	—	261,875
平成20年3月31日残高(千円)	—	—	—	—	1,478,434

[次へ](#)

重要な会計方針

項目	前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日	当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日
1.固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産 定額法を採用しております。主な耐用年数は以下のとおりです。 建 物 6年～24年 器具・備品 3年～15年	(1)有形固定資産 同左 建 物 6年～24年 器具・備品 3年～15年 （会計方針の変更） 当事業年度より、法人税法の改正（「所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号」及び「法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号」）に伴い、平成19年4月1日以降に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。 これによる損益に与える影響は軽微であります。 （追加情報） 当事業年度から、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。 これによる損益に与える影響は軽微であります。
2.引当金の計上基準	(2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。 (1)貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しています。 (2)賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しています。	(2)無形固定資産 同左 (1)貸倒引当金 同左 (2)賞与引当金 同左

	(3)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上しています。	(3)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務を計上しております。なお、退職給付引当金の対象従業員が300名未満であるため、簡便法によっており、退職給付債務の金額は当事業年度末における自己都合要支給額としております。 (4)役員退職慰労引当金 当社常勤役員の退職慰労金の支給に充てるため、「常勤役員退職慰労金規程」に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。 （会計方針の変更） 役員退職慰労金は、従来、支出時の費用として処理しておりましたが、「役員賞与に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成17年11月29日 企業会計基準第4号）の公表により役員賞与が費用処理されることとなったこと等役員報酬に係る処理方法が整備されたことから、「租税特別措置法上の準備金及び特別法上の引当金又は準備金並びに役員退職慰労引当金等に関する監査上の取扱い」（日本公認会計士協会 平成19年4月13日 監査・保証実務委員会報告第42号）が公表されたことを踏まえ、当事業年度より内規に基づく期末要支給額を役員退職慰労引当金として計上しております。 この変更により、当事業年度発生額2,250千円は販売費及び一般管理費へ、過年度分相当額5,062千円は特別損失に計上しております。この結果、従来と同一の方法を採用した場合と比べ、営業利益及び経常利益は2,250千円減少し、税引前当期純利益は7,312千円減少しております。
3. リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっています。	同左
4. その他財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっています。 なお、仮払消費税等および仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	同左

会計処理方法の変更

項目	前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日	当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日
	（貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等） 当事業年度から「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準」（企業会計基準第5号 平成17年12月9日）及び「貸借対照表の純資産の部の表示に関する会計基準等の適用指針」（会計基準適用指針第8号 平成17年12月9日）を適用しております。 従来の「資本の部」の合計に相当する金額は1,216百万円であります。 なお、当事業年度における貸借対照表純資産の部については、財務諸表等規則の改正に伴い、改正後の財務諸表等規則により作成しております。	—

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成19年3月31日現在)	当事業年度 (平成20年3月31日現在)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 43,246千円 器具・備品 40,485千円	※1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 48,177千円 器具・備品 48,436千円
※2 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 5,724千円	※2 —
※3 授權株式数及び発行済株式総数 授權株式数 16,000株 発行済株式総数 4,000株	※3 同左
※4 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払手数料 113,794千円	※4 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。 未払手数料 127,107千円

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日	当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日
＊1 役員報酬の範囲額 取締役 年額 69,500千円以内 監査役 年額 13,750千円以内	＊1 —
＊2 法人税等には、法人住民税及び事業税が含まれております。	＊2 —
＊3 損益計算書上税引前当期純利益と法人税法上の課税所得との差異 税引前当期純利益金額 365,463千円 (加算項目) 交際費等の損金不算入額 4,010千円 賞与引当金繰入超過額 59,911千円 退職給付引当金繰入超過額 6,255千円 損金の額に算入した事業税 3,846千円 (減算項目) 事業税の納税充当金取崩額 49,125千円 賞与引当金取崩額 41,683千円 退職給付引当金取崩容認額 787千円 課税所得金額 347,890千円	＊3 —
＊4 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 関係会社への営業費用 984,260千円	＊4 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。 関係会社への営業費用 1,339,497千円

(株主資本等変動計算書関係)

1. 発行済株式及び総数に関する事項

株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
普通株式(千株)	4	—	—	4
計	4	—	—	4

(リース取引関係)

前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日			当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日		
リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引			リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引		
①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額			①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額		
	ソフトウェア 千円	合計 千円		ソフトウェア 千円	合計 千円
取得価額			取得価額		
相 当 額	81,000	81,000	相 当 額	81,000	81,000
減価償却			減価償却		
累計額相当額	48,600	48,600	累計額相当額	64,800	64,800
期末残高			期末残高		
相 当 額	32,400	32,400	相 当 額	16,200	16,200
②未経過リース料期末残高相当額（純額法）			②未経過リース料期末残高相当額（純額法）		
1年以内		16,566千円	1年以内		16,947千円
1 年 超		16,947千円	1 年 超		0千円
合 計		33,513千円	合 計		16,947千円
③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額			③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額		
支払リース料		17,160千円	支払リース料		17,160千円
減価償却費相当額		16,200千円	減価償却費相当額		16,200千円
支払利息相当額		968千円	支払利息相当額		593千円
④減価償却相当額の算定方法			④減価償却費相当額の算定方法		
リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっています。			同左		
⑤利息相当額の算定方法			⑤利息相当額の算定方法		
リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。			同左		

[次へ](#)

（有価証券関係）

前事業年度（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

有価証券関係 該当事項はありません。

当事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

有価証券関係 該当事項はありません。

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

デリバティブ取引関係 該当事項はありません。

当事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

デリバティブ取引関係 該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度（自 平成18年4月1日 至 平成19年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度と厚生年金基金制度を併用しております。

2. 退職給付債務及びその内訳

小規模企業等における簡便法を採用し、退職一時金制度については前事業年度末（平成19年3月31日現在）自己都合要支給額25,297千円を退職給付債務として計上しております。

なお、総合設立の厚生年金基金に加入しており、掛金拠出割合等により計算した年金資産の額は、486,802千円です。

	前事業年度 (平成19年3月31日現在)
	千円
(1)退職給付債務	25,297
(2)年金資産	—
(3)未積立退職給付債務 (1)+(2)	25,297
(4)会計基準変更時の未処理額	—
(5)未認識数理計算上の差異	—
(6)未認識過去勤務債務（債務の減額）	—
(7)貸借対照表計上額純額 (3)+(4)+(5)+(6)	25,297
(8)前払年金費用	—
(9)退職給付引当金 (7)－(8)	25,297

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (平成19年3月31日現在)
退職給付費用	(千円)
(1)勤務費用	34,926 (注1)
(2)利息費用	—
(3)期待運用収益(減算)	—
(4)会計処理基準変更時差異の費用処理額	—

(注1)勤務費用には、総合設立の厚生年金基金への要拠出額23,522千円を含みます。

4. 退職給付債務の計算基礎

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、小規模企業等における簡便法を採用し、当期末自己都合要支給額を退職給付債務として計上しております。厚生年金基金については、総合設立の全国信用金庫厚生年金基金に加入しておりますが、自社の拠出に対応する年金原資の額を合理的に計算することができないため、当該年金への要拠出額を退職給付費用として、営業経費に計上しております。

当事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度と厚生年金基金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

小規模企業等における簡便法を採用し、退職一時金制度については当事業年度末（平成20年3月31日現在）自己都合要支給額29,902千円を退職給付債務として計上しております。

なお、要拠出額を退職給付費用として処理している複数事業主制度に関する事項は次の通りであります。

3. 退職給付費用に関する事項

	当事業年度 (平成20年3月31日現在)
退職給付費用	(千円)
勤務費用	37,663 (注2)

(注2) 勤務費用には、総合設立の厚生年金基金への要拠出額26,929千円を含みます。

4. 退職給付債務の計算基礎

退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、小規模企業等における簡便法を採用し、当期末自己都合要支給額を退職給付債務として計上しております。厚生年金基金については、総合設立の全国信用金庫厚生年金基金に加入しておりますが、自社の拠出に対応する年金原資の額を合理的に計算することができないため、当該年金への要拠出額を退職給付費用として、営業経費に計上しております。

5. 要拠出額を退職給付費用として処理している複数事業主制度に関する事項

（1）制度全体の積立状況に関する事項（平成19年3月31日現在）

年金資産の額	1,391,419,681千円
年金財政計算上の給付債務の額	1,588,552,627千円
差引額	△197,132,946千円

（2）制度全体に占める当社の掛金拠出割合（平成19年3月分）

0.0335%

（3）補足説明

過去勤務債務残高	274,571,891千円
別途積立金	77,438,944千円

本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年の元利均等定率償却（予定償却完了日：平成37年4月1日）であります。

[前へ](#) [次へ](#)

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成19年3月31日現在)		当事業年度 (平成20年3月31日現在)	
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
	千円		千円
繰延税金資産		繰延税金資産	
賞与引当金繰入限度超過額	21,665	賞与引当金繰入限度超過額	25,640
退職給付引当金繰入限度超過額	10,293	退職給付引当金繰入限度超過額	15,142
貸倒引当金繰入限度超過額	7,187	未払事業税	8,921
未払事業税	4,926	その他	3,239
その他	2,712		
繰延税金資産計	46,785	繰延税金資産計	52,943
繰延税金負債計	—	繰延税金負債計	—
繰延税金資産の純額	46,785	繰延税金資産の純額	52,943
繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。		繰延税金資産の純額は、貸借対照表の以下の項目に含まれております。	
流動資産—繰延税金資産	29,304	流動資産—繰延税金資産	37,800
固定資産—繰延税金資産	17,481	固定資産—繰延税金資産	15,142
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。		法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	

[前へ](#) [次へ](#)

(関連当事者との取引)

前事業年度（自平成18年4月1日 至平成19年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主など

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出資金	事業の内容	議決権等の 所有(被所有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社	信金中央金庫	東京都中央区	290,998 百万円	信用金庫連合会事業	直接 (被所有) 100%	兼任1人	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	794,311 千円	未払手 数料	94,532 千円
								償還金・ 分配金支 払の代理 事務	2,400,845 千円	—	—
								支払保証 委託契約	25,000 千円	—	—

(2)兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出資金	事業の内容	議決権等の 所有(被所有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社 の子会社	しんきん証券株式会社	東京都中央区	20,000 百万円	証券業	—	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	189,137 千円	未払手 数料	19,285 千円
								償還金・ 分配金支 払の代理 事務	26,095,471 千円	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち、委託者報酬分の配分を両者協議のうえ合理的に決定しております。

当事業年度（自平成19年4月1日 至平成20年3月31日）

(1)親会社及び法人主要株主など

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は出資金	事業の内容	議決権等の 所有(被所有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社	信金中央金庫	東京都中央区	290,998 百万円	信用金庫連合会事業	直接 (被所有) 100%	兼任1人	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	1,153,248 千円	未払手 数料	98,133 千円
								償還金・ 分配金支 払の代理 事務	8,729,277 千円	—	—
								支払保証 委託契約	25,000 千円	—	—

(2)兄弟会社等

属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は出資 金	事業の 内容	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼務等	事業上の 関係				
親会社 の子会 社	しんき ん証券 株式会 社	東京都 中央区	20,000 百万円	証券業	—	なし	証券投資 信託受益 証券の募 集販売	投資信託 の代行手 数料	185,696 千円	未払手 数料	28,974 千円
								償還金・ 分配金支 払の代理 事務	2,757,470 千円	—	—

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

信託約款に定める受益者の負担する信託報酬のうち、委託者報酬分の配分を両者協議のうえ合理的に決定しております。

[前へ](#) [次へ](#)

(1株当たり情報)

前事業年度 自 平成18年4月 1日 至 平成19年3月31日	当事業年度 自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日
1株当たりの純資産額 304,139円86銭 1株当たりの当期純利益 53,737円06銭	1株当たりの純資産額 369,608円70銭 1株当たりの当期純利益 65,468円84銭
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益額については、潜在株式がないため記載しておりません。 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりです。	(注) 1. 同左 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりです。
当期純利益 214,948千円 普通株主に帰属しない金額 一千円 普通株式に係る当期純利益 214,948千円 期中平均株式数 4,000 株	当期純利益 261,875千円 普通株主に帰属しない金額 一千円 普通株式に係る当期純利益 261,875千円 期中平均株式数 4,000 株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[前へ](#) [次へ](#)

2 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

当中間会計期間末 平成20年9月30日			
科 目	金 額		構成比
	千円	千円	%
(資産の部)			
流 動 資 産			
現金・預金		1,204,121	
前払費用		15,996	
未収委託者報酬		236,051	
未収収益		24,527	
繰延税金資産		27,669	
その他 *2		13,828	
流 動 資 産 計		1,522,195	86.0
固 定 資 産			
有形固定資産 *1		160,534	
建物	113,385		
器具備品	47,149		
無形固定資産		11,338	
ソフトウェア	10,078		
電話加入権	959		
その他	300		
投資その他の資産		75,640	
長期前払費用	1,296		
繰延税金資産	74,344		
固 定 資 産 計		247,514	14.0
資 産 合 計		1,769,710	100.0

当中間会計期間末 平成20年9月30日			
科 目	金 額		構成 比
	千円	千円	%
(負債の部)			
流 動 負 債			
未払金		214,314	
未払手数料	177,262		
その他未払金	37,052		
未払法人税等		948	
前受収益		34,972	
賞与引当金		59,762	
その他		10,034	
流 動 負 債 計		320,030	18.1
固 定 負 債			
役員退職慰労引当金		12,018	
退職給付引当金		33,120	
固 定 負 債 計		45,139	2.5
負 債 合 計		365,170	20.6
(純資産の部)			
株主資本		1,404,539	79.4
資 本 金		200,000	
利 益 剰 余 金		1,204,539	
利益準備金	2,000		
その他利益剰余金	1,202,539		
別途積立金	370,000		
繰越利益剰余金	832,539		
純 資 産 合 計		1,404,539	79.4
負債・純資産合計		1,769,710	100.0

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間 自 平成20年4月 1 日 至 平成20年9月30日			
科 目	金 額		百分比
	千円	千円	%
営 業 収 益			
投資顧問料		60,470	
委託者報酬		1,218,335	
営業収益計		1,278,806	100.0
営 業 費 用			
支払手数料		616,599	
広告宣伝費		3,932	
調査費		195,134	
調査費	126,623		
委託調査費	68,510		
営業雑経費		46,451	
印刷費	43,460		
郵便料	205		
電信電話料	1,050		
協会費	1,734		
営業費用計		862,117	67.4
一般管理費			
給料		207,897	
役員報酬	15,549		
給料・手当	157,517		
法定福利費	28,489		
福利厚生費	1,895		
その他給料	4,444		
役員退職慰労引当金繰入		4,706	
交際費		2,391	
旅費交通費		6,713	
租税公課		1,315	
不動産賃借料		40,759	
賞与引当金繰入		59,762	
退職給付費用		23,506	
固定資産減価償却費 *1		11,245	
諸経費		51,815	
一般管理費計		410,113	32.1
営 業 利 益		6,575	0.5
営 業 外 収 益			
受取利息		1,824	
その他営業外収益		101	
営業外収益計		1,925	0.2
営 業 外 費 用			
事務過誤損失負担金		3,209	
その他営業外費用		140	
営業外費用計		3,349	0.3
経 常 利 益		5,152	0.4

当中間会計期間 自 平成20年4月 1 日 至 平成20年9月30日			
科 目	金 額		百分比
	千円	千円	%
特別損失			
本社移転費用	76,214		
事務過誤損失負担金	51,387		
特別損失計		127,602	10.0
税引前中間純損失（△）		△122,450	△9.6
法人税、事業税及び住民税		514	0.0
法人税等調整額		△49,070	△3.8
中間純損失（△）		△73,895	△5.8

(3) 中間株主資本等変動計算書

(自平成20年4月1日 至平成20年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本									
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				自己株式	株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計		
						別途積立金	繰越利益剰余金			
平成20年3月31日残高	200,000	—	—	—	2,000	388,000	888,434	1,278,434	—	1,478,434
中間会計期間中の変動額										
新株の発行	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—	△18,000	18,000	—	—	—
中間純損失（△）	—	—	—	—	—	—	△73,895	△73,895	—	△73,895
自己株式の取得	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
株主資本以外の項目 の中間会計期間中の 変動額(純額)	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中間会計期間中の変動 額合計	—	—	—	—	—	△18,000	△55,895	△73,895	—	△73,895
平成20年9月30日残高	200,000	—	—	—	2,000	370,000	832,539	1,204,539	—	1,404,539

	評価・換算差額等			新株予約権	純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計		
平成20年3月31日残高	—	—	—	—	1,478,434
中間会計期間中の変動額					
新株の発行	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—
任意積立金の積立	—	—	—	—	—
任意積立金の取崩	—	—	—	—	—
中間純損失（△）	—	—	—	—	△73,895
自己株式の取得	—	—	—	—	—
自己株式の処分	—	—	—	—	—
株主資本以外の項目の中間会計期間中の変動額（純額）	—	—	—	—	—
中間会計期間中の変動額合計	—	—	—	—	△73,895
平成20年9月30日残高	—	—	—	—	1,404,539

(中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項)

項 目	当中間会計期間 自 平成20年4月 1 日 至 平成20年9月30日
1. 固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産 定額法を採用しております。主な耐用年数は以下のとおりです。 建 物 3年～50年 器具備品 3年～20年 (2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
2. 引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務を計上しております。なお、退職給付引当金の対象従業員が300名未満であるため、簡便法により、退職給付債務の金額は当中間会計期間末における自己都合要支給額としております。 (3)役員退職慰労引当金 当社常勤役員の退職慰労金の支給に充てるため、「常勤役員退職慰労金規程」に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更)

項 目	当中間会計期間 自 平成20年4月 1 日 至 平成20年9月30日
リース取引の処理方法	(リース取引に関する会計基準) 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当中間会計期間より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準委員会 平成19年3月30日 企業会計基準第13号）および「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 平成19年3月30日 企業会計基準適用指針第16号）が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 これによる損益に与える影響はありません。

(中間貸借対照表関係)

項 目	当中間会計期間末 平成20年9月30日
*1有形固定資産の減価償却累計額	建物 2,869千円 器具備品 25,181千円
*2消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ流動資産のその他に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

項 目	当中間会計期間 自 平成20年4月 1 日 至 平成20年9月30日
*1 減価償却実施額	有形固定資産 9,793千円 無形固定資産 1,452千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成20年4月1日 至 平成20年9月30日）

発行済株式に関する事項

株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式（千株）	4	—	—	4

(リース取引関係)

当中間会計期間
自 平成20年4月 1 日
至 平成20年9月30日

リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引
リース取引開始日が、平成20年4月1日前の所有権移転外ファイナンス・リース取引につい
て、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。当該取引は次
のとおりであります。

①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間期末残高相当額

	ソフトウェ ア (千円)	合 計 (千円)
取 得 価 額		
相 当 額	81,000	81,000
減 価 償 却		
累計額相当額	72,900	72,900
	中間期末残高 相 当 額 8,100	8,100

②未経過リース料中間期末残高相当額（純額法）

一 年 以 内	8,521千円
一 年 超	-千円
合 計	8,521千円

③支払リース料、減価償却費及び支払利息相当額

支 払 リ ー ス 料	8,580千円
減価償却費相当額	8,100千円
支払利息相当額	153千円

④減価償却費相当額の算定方法

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。

⑤利息相当額の算定方法

リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法に
ついては、利息法によっております。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成20年9月30日）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間末（平成20年9月30日）

当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間			
自 平成20年4月 1日			
至 平成20年9月30日			
1株当たり純資産額	351,134円91銭		
1株当たり中間純損失（△）	△18,473円78銭		
潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないおよび1株当たり中間純損失のため記載しておりません。			
(注)算定上の基礎			
1株当たり中間純損失（△）			
中間純損失（△）	△73,895	千円	
普通株主に帰属しない金額	—	千円	
普通株式に係る中間純損失（△）	△73,895	千円	
期中平均株式数	4,000	株	

(重要な後発事象)

当中間会計期間末（平成20年9月30日）

該当事項はありません。

[前へ](#)

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(1)から(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

（１）取締役の変更

取締役は、株主総会において株主により選任され、株主の決議により解任されます。

（２）定款の変更

定款の変更に関しては、株主総会において株主の決議が必要です。

（３）訴訟事件その他の重要事項

委託会社及びファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本の額及び事業の内容】

１－（１）名称

信金中央金庫（指定登録金融機関）

（２）資本の額

提出日現在 290,998百万円

（３）事業の内容

全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の需給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上及び業務機能の補完を図っています。

２－（１）名称

株式会社しんきん信託銀行（受託会社）

（２）資本の額

提出日現在 10,000百万円

（３）事業の内容

信用金庫を代理店とした特定贈与信託、公益信託の取扱いにより、信用金庫取引先等に信託サービスの提供を行うとともに、ファンド・トラスト、有価証券信託、金銭債権信託の取扱いを行います。

＜再信託受託会社の概要＞

・名称

資産管理サービス信託銀行株式会社

・資本の額

提出日現在 50,000百万円

・事業の内容

銀行法に基づき、銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 信金中央金庫における関係業務の概要

委託会社の指定する登録金融機関として、当該受益権の募集の取扱い、償還金等の支払を行います。

(2) 株式会社しんきん信託銀行における関係業務の概要

投資信託財産の保管・管理業務を行い、分配金、解約金及び償還金の委託者への交付、受益権の認証等を行います。

3【資本関係】

信金中央金庫は、委託会社の発行済株式総数4,000株を全て保有します。

第3【参考情報】

当特定期間において、提出されたファンドに係る金融商品取引法第25条第1項各号に掲げる書類は以下の通りです。

- | | |
|------------------|--|
| （1）有価証券報告書 | 平成20年10月17日
関東財務局長に提出 |
| （2）有価証券届出書の訂正届出書 | 平成20年10月17日
関東財務局長に提出 |
| （3）臨時報告書 | 平成20年 7月25日
平成20年 9月26日
平成20年11月28日
関東財務局長に提出 |

独立監査人の監査報告書

平成20年10月7日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田中 俊之 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 志保 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているしんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）の平成20年2月6日から平成20年7月18日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）の平成20年7月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

しんきんアセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

-
- （注）1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 前計算期間の財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成19年6月29日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御 中

みすず監査法人

指 定 社 員
業務執行社員 公認会計士 安 義利 印指 定 社 員
業務執行社員 公認会計士 吉田 波也人 印

当監査法人は、証券取引法第193条の2の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているしんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成18年4月1日から平成19年3月31日までの第17期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成19年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

（注）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

独立監査人の監査報告書

平成21年3月19日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
取締役会御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	田中 俊之 印
--------------------	-------	---------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤 志保 印
--------------------	-------	---------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているしんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）の平成20年7月19日から平成21年1月19日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんグローバル債券ファンド（奇数月決算型）の平成21年1月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

しんきんアセットマネジメント投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- （注）1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成20年6月25日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
取締役会御中

新日本監査法人

代表社員 業務執行社員	公認会計士	田中 俊之 印
----------------	-------	---------

業務執行社員	公認会計士	伊藤 志保 印
--------	-------	---------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているしんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第18期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（※）上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成20年12月19日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社
取締役会 御中**新日本有限責任監査法人**指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 田中 俊之 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 伊藤 志保 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているしんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の平成20年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成20年4月1日から平成20年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

（※）上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[前へ](#)