

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年11月8日
【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 堀 泰彦
【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】	米山 亮
【電話番号】	03 - 5524 - 8161
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	しんきん世界アロケーションファンド（積極型） （愛称：しんきんラップ（積極型））
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	2,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

しんきん世界アロケーションファンド（積極型）

（ファンドの愛称を「しんきんラップ（積極型）」とします。）

（以下「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。（以下「受益権」といいます。）

委託会社からの依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下、「振替法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（振替法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社であるしんきんアセットマネジメント投信株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行(売出)価額の総額】

2,000億円を上限とします。

### （４）【発行(売出)価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額とは、投資信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または下記の照会先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。また、委託会社のホームページで、最新の基準価額をご覧になることもできます。

<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）

<コールセンター> 0120-781812

携帯電話・PHSからは 03-5524-8181（受付時間：営業日の9:00～17:00）

<ホームページ> <http://www.skam.co.jp>

### （５）【申込手数料】

申込手数料は、購入金額に応じて、購入価額に1.65%（税抜1.5%）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。

（購入金額とは「買付申込日の翌営業日の基準価額×申込口数」をいいます。）

収益分配金の再投資に際しては、申込手数料は掛かりません。

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。

販売会社が定める申込手数料については、販売会社また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)  
< コールセンター > 0120-781812  
携帯電話・PHSからは 03-5524-8181(受付時間: 営業日の9:00~17:00)  
< ホームページ > <http://www.skam.co.jp>

(6) 【申込単位】

販売会社が定める単位

取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」に従って契約を締結します。

(7) 【申込期間】

2019年11月9日から2020年5月8日まで

(なお、申込期間は、上記期間満了日前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みに係る取扱い等は販売会社が行っています。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

委託会社への照会

ホームページ <http://www.skam.co.jp>

コールセンター 0120-781812(携帯電話・PHSからは 03-5524-8181)

(受付時間: 営業日の9:00から17:00まで)

(9) 【払込期日】

・取得申込者は、販売会社が定める期日までに、取得申込代金を販売会社において支払うものとします。

・販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行われる日に、委託会社の口座に払い込みます。委託会社は、同日、各取得申込受付日に係る発行価額の総額を、受託会社の当ファンドに係る口座に払い込みます。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込金額は、お申し込みされた販売会社の営業所等で支払うものとします。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

取得申込みに際しては、販売会社の営業時間内に販売会社所定の方法でお申し込みください。

各営業日の午後3時までに受け付けた取得および換金の申込み（当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取り扱います。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。

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け付けません。ただし、収益分配金の再投資に係る追加信託の申込みに限って、これを受け付けるものとします。

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、申込手数料は掛かりません。）取得申込者は、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従い契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合、上記契約または規定は、当該別の名称に読み替えるものとします。

#### 振替受益権について

- ・ファンドの受益権は、振替法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則に従って取り扱われるものとします。
- ・ファンドの分配金、償還金、換金代金は、振替法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

#### 投資信託振替制度について

- ・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託へ分散投資を行い、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。

###### 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 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産
	内外	(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 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり ( )
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式・債券・ 不動産投信))	年4回	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	年6回 (隔月)			
	年12回 (毎月)			
	日々			
	その他 ( )			

(注1) 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。

(注2) 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

< 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

「内外」...目論見書または投資信託約款(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国内および海外の資産を源泉とする旨の記載があるもの

「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信およびその他の資産のうち、複数の資産による投資収益を実質的に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(株式・債券・不動産投信))」...目論見書等において、投資信託証券(マザーファンド)を通じて主として株式・債券・不動産投信に投資する旨の記載があるもの

「年1回」...目論見書等において、年1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

「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資する旨の記載があるもの

「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また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、一般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。

## ファンドの特色

**特色1** 日本を含む世界各国の6つの異なる資産を投資対象とします。

- ◆長期運用に適した6つの異なる資産（国内株式・外国株式・国内債券・外国債券・国内不動産投資信託（国内リート）・外国不動産投資信託（外国リート））を投資対象とします。

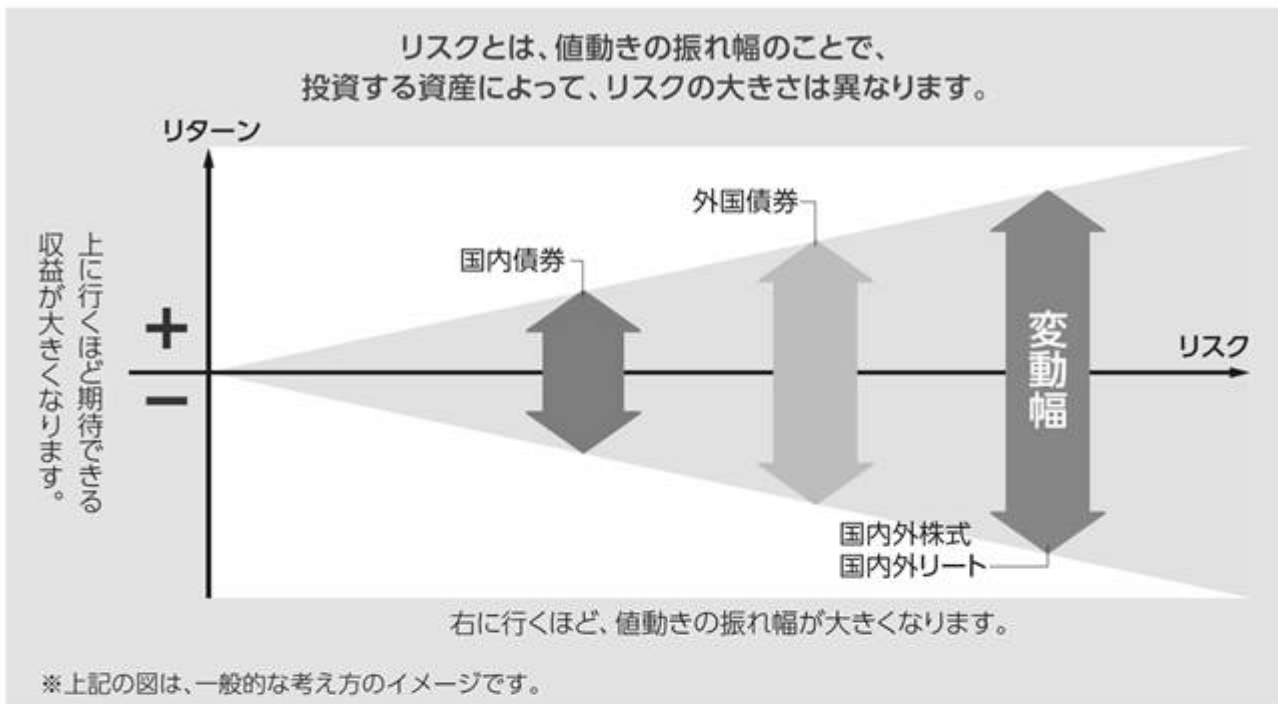
※常に全ての投資対象に投資を行うとは限りません。

- ◆配当金、利子および分配金収入が期待できる資産に投資して、収益性と安定性のバランスを重視した運用を行います。



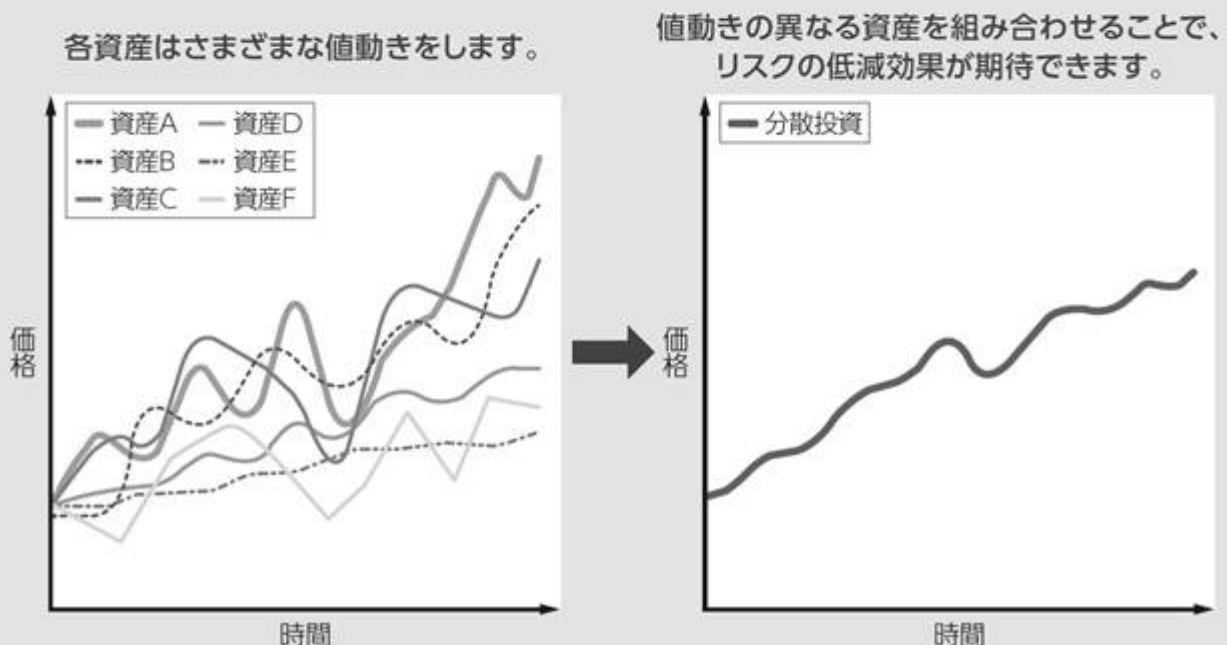
## 特色2 分散投資を通じてリスクを抑えた運用が期待できます。

- ◆ 投資する資産はそれぞれ異なるリスク（値動きの振れ幅）を持っています。



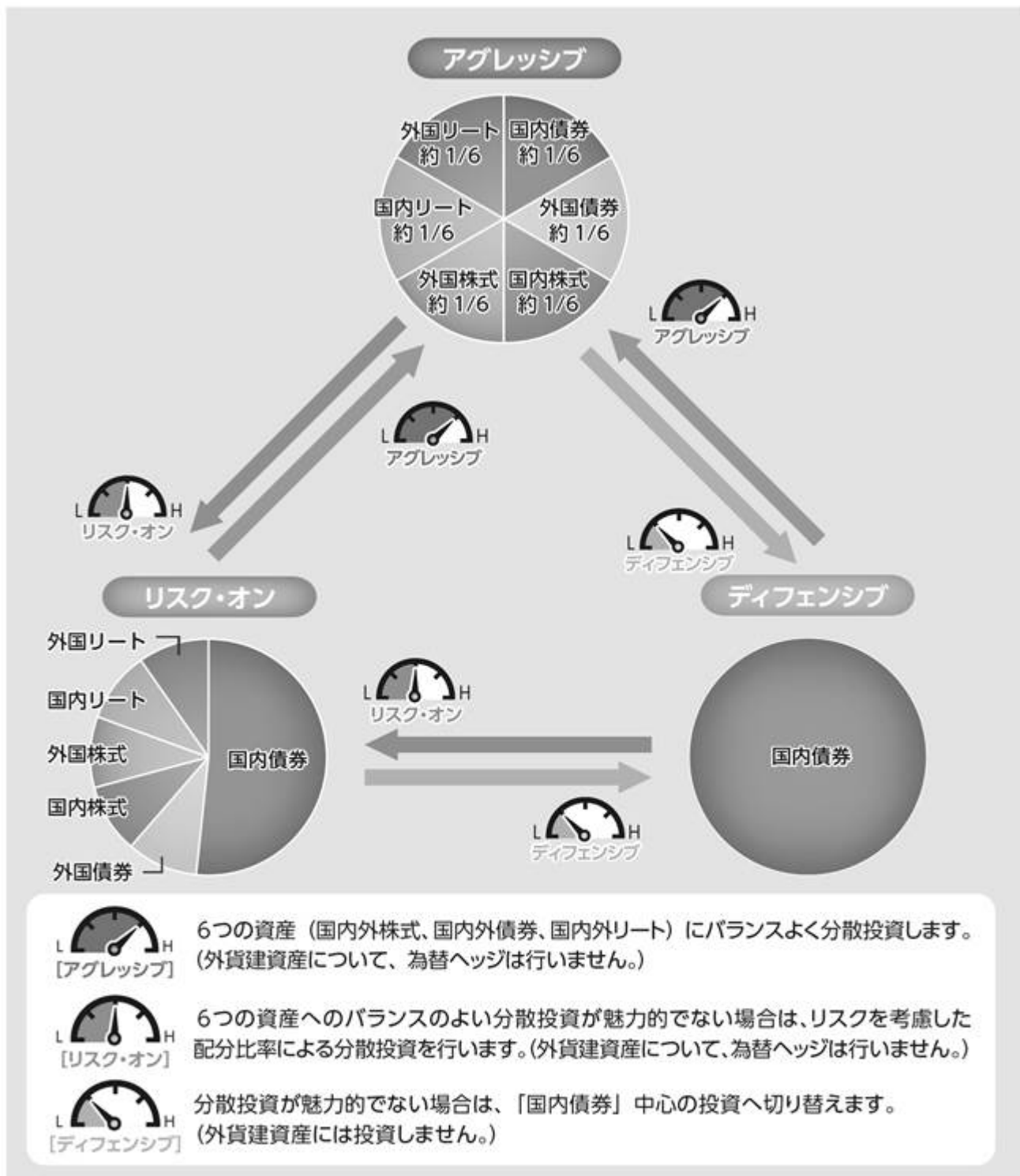
- ◆ リスクの異なる資産に分散投資を行うことによって、基準価額の変動を抑えつつ、収益の獲得を目指します。

### 分散投資の効果





### 特色3 市場環境によっては、リスクを抑えた資産別配分（アロケーション）に切り替えます。



※上記の図は、当ファンドの運用のイメージを説明するためのものであり、実際の配分比率とは異なります。配分比率は、あらかじめ定めているものではありません。

※上記の「アグレッシブ」、「リスク・オン」および「ディフェンシブ」は、当ファンドの運用のイメージを説明するための表現であり、具体的な投資戦略・運用方針を意味するものではありません。

※実際の資産別配分比率の変更は委託会社が決定し、当ファンド内でマザーファンドを換金および買い付けることにより行います。マザーファンドについては、後掲「ファンドの仕組み」をご参照ください。

※市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ■ 投資戦略

### 投資戦略のイメージ

#### 経済環境分析

投資先の金融市場に影響を与える世界経済の動向など、各資産の金融市場を取り巻く環境を分析・評価します。

#### 金融市場分析

経済環境分析の結果を踏まえて、投資先の金融市場の関連する各種指標（指数、インデックスなど）の動きを計量的に分析・評価します。

#### 資産別配分比率の決定

金融市場分析の結果を踏まえて、資産別配分比率を決定します。資産別配分比率の見直しは、月1回程度行います（将来変更される場合があります。）。決定した資産別配分比率に近づけるため、各マザーファンドの組入比率を調整します。常に全てのマザーファンドに投資を行うとは限りません。

**「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」**  
**(愛称:しんきんラップ(積極型))**

- 投資判断に使用する資産分散手法は、市場環境の変化に応じて、随時見直しを行います。
- 資産の一部を外貨建資産に投資する場合があります。原則として外国為替相場の影響を回避する取引（いわゆる為替ヘッジ）は行いません。

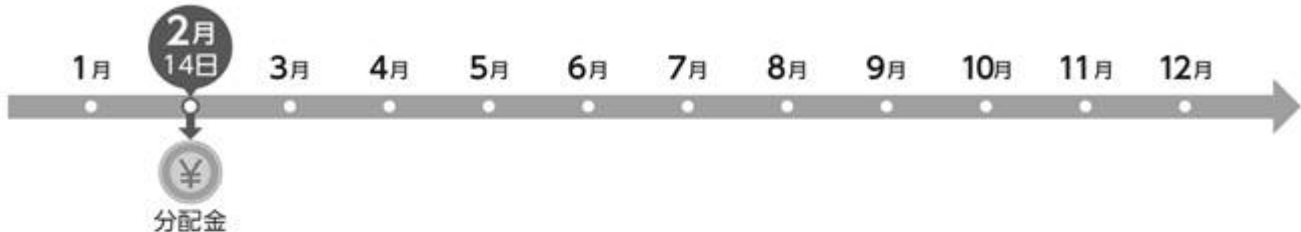
※市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ■ 収益分配について

年1回の決算時（2月14日（休業日の場合は翌営業日））に収益分配方針に従って分配を行います。

下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。分配金が支払われない場合もあります。

### 収益分配金のお支払いのイメージ



※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、購入時手数料は掛かりません。）

※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。

※分配金のお受け取りについては販売会社にお問い合わせください。

### 収益分配 方針

- 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は、分配を行わないこともあります。

## ■ 収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

### 投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないしすべてが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりりが小さかった場合も同様です。

## ■ 投資する各資産について ※常に全ての資産に投資するとは限りません。

### 株式



## 国内株式、外国株式（為替ヘッジなし）

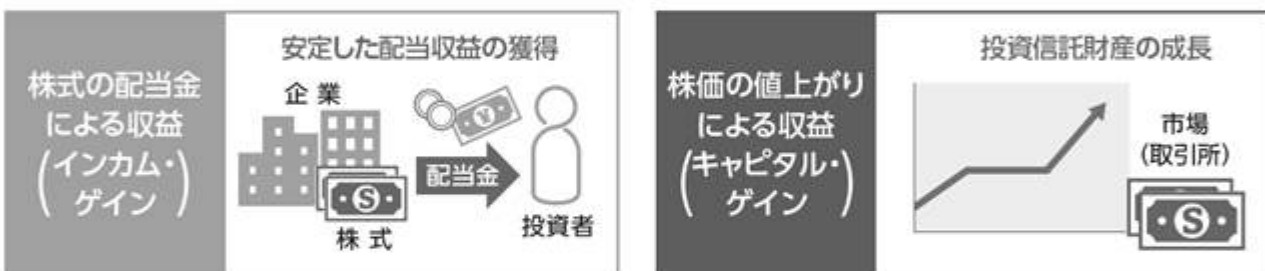
国内および外国の好配当株式を主要投資対象とします。

### ◎好配当株式のポイント

- 予想配当利回り※が市場平均を上回ると判断できる銘柄に着目することから、安定的な配当金による収益（インカム・ゲイン）を期待することができます。
- 企業業績や事業内容等を分析して投資を行い、中長期的な株価の上昇による収益（キャピタル・ゲイン）を狙います。

※「予想配当利回り」とは、株式の重要な投資尺度のひとつであり、「1株当たりの予想配当金」を「株価」で割って求められます。

### 株式投資の2大要素



### 株式の投資対象国・地域

北米地域	欧州・中東地域	アジア・オセアニア地域
アメリカ カナダ	オーストリア    フランス    イタリア    スペイン ベルギー    ドイツ    オランダ    スウェーデン デンマーク    アイルランド    ノルウェー    スイス フィンランド    イスラエル    ポルトガル    イギリス	香港 日本 シンガポール オーストラリア ニュージーランド

※ 2019年8月末現在の投資対象国・地域であり、実際の投資とは異なります。(組み入れていない場合もあります。)

※外国株式の投資対象国はMSCI-KOKUSAI(参考指標)の構成国です。

◆外国株式による運用は、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドが行います。

### ～シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて～

世界の投資対象市場を網羅するリサーチおよび資産運用能力を背景に、高品質な投資商品や金融サービスをお客様に提供する独立系グローバル資産運用会社「シュローダー・グループ」の英国法人です。同グループの運用資産残高は2018年12月末現在約57兆円となっています。

※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。

## ● 投資プロセス



## 国内株式（しんきん好配当利回り株マザーファンド）

## process 1 経済環境分析

経済動向など株式市場を取り巻く環境を多角的に分析します。

## process 2 組入銘柄の決定

予想配当利回りが東証第1部と東証第2部の平均値以上の銘柄だけを選定します。また、財務の健全性、業種分散などを踏まえ、全体のバランスを考慮し、実際に組み入れる銘柄を決定します。

## process 3 ポートフォリオのリスク分析

マザーファンドの基準価額の値動きやその要因等を管理・分析します。



## 外国株式（しんきん世界好配当利回り株マザーファンド）

## process 1 経済環境分析

経済動向など投資先の株式市場を取り巻く環境を多角的に分析します。

## process 2 組入銘柄の決定

世界をいくつかの地域に分け、地域ごとの平均を上回る配当利回りが期待できる銘柄を選定します。また、配当の質、時価総額、企業業績などを踏まえ、全体のバランスを考慮して実際に投資する銘柄を決定します。

## process 3 ポートフォリオのリスク分析

マザーファンドの基準価額の値動きやその要因等を管理・分析します。

## ● 「MSCI-KOKUSAI」について

MSCI-KOKUSAIインデックスはMSCIインデックスの一つです。MSCIインデックスは、MSCIインクが算出する世界的な株価指数の名称で、世界中の投資のプロが指標として活用しています。MSCIインデックスは市場の動向を表す指数として、また投資評価のベンチマークとして幅広く利用されています。ここに掲載される全ての「MSCI-KOKUSAI」の情報は、信頼の置ける情報源から得たものでありますが、その確実性および完結性をMSCIは何ら保証するものではありません。この情報はMSCIの営業秘密であり、またその著作権はMSCIに帰属しており、その許諾なしにコピーを含め電子的、機械的な一切の手段その他あらゆる形態を用い、またはあらゆる情報保存、検索システムを用いて出版物、資料、データ等の全部または一部を複製・頒布・使用等することは禁じられています。

## ■ 投資する各資産について ※常に全ての資産に投資するとは限りません。

### 債券

























































































## 国内債券、外国債券（為替ヘッジなし）

国内の公社債および外国の高格付債券を主要投資対象とします。

### ◎債券のポイント

- わが国を含む、世界各国の債券に投資することから、利子収入によるインカム・ゲインを期待することができます。
- 高い信用力の債券に投資を行うことによって、信用リスクを抑えた効果的な債券分散投資を追求します。

### 債券の投資対象国

日本	 日本	 アメリカ																																								
	※投資対象とする公社債は、組入れ時において信用格付業者等からBBB格相当以上の長期信用格付を取得しているものとします。	※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。																																								
ユーロ参加国	<table border="0"> <tr> <td>オーストリア</td><td>ベルギー</td><td>キプロス</td><td>エストニア</td><td>フィンランド</td><td>フランス</td><td>ドイツ</td><td>ギリシャ</td><td>アイルランド</td><td>イタリア</td> </tr> <tr> <td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td> </tr> <tr> <td>ラトビア</td><td>リトアニア</td><td>ルクセンブルク</td><td>マルタ</td><td>オランダ</td><td>ポルトガル</td><td>スロバキア</td><td>スロベニア</td><td>スペイン</td><td></td> </tr> <tr> <td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td> </tr> </table> <p>※欧州経済通貨同盟(EMU)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。EMUとは、統一通貨「ユーロ」を導入する欧州連合(EU)加盟国による共通の経済政策・通貨対策の実施を目指す同盟です。</p>		オーストリア	ベルギー	キプロス	エストニア	フィンランド	フランス	ドイツ	ギリシャ	アイルランド	イタリア											ラトビア	リトアニア	ルクセンブルク	マルタ	オランダ	ポルトガル	スロバキア	スロベニア	スペイン											
オーストリア	ベルギー	キプロス	エストニア	フィンランド	フランス	ドイツ	ギリシャ	アイルランド	イタリア																																	
																																										
ラトビア	リトアニア	ルクセンブルク	マルタ	オランダ	ポルトガル	スロバキア	スロベニア	スペイン																																		
																																										
その他	<table border="0"> <tr> <td>オーストラリア</td><td>カナダ</td><td>デンマーク</td><td>ニュージーランド</td><td>ノルウェー</td><td>シンガポール</td><td>スウェーデン</td><td>スイス</td><td>イギリス</td> </tr> <tr> <td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td> </tr> </table> <p>※日本、米国、EMU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、信用格付業者等からAA格以上の信用格付を取得しているものとします。上記以外の国に投資することがあります。</p>		オーストラリア	カナダ	デンマーク	ニュージーランド	ノルウェー	シンガポール	スウェーデン	スイス	イギリス																															
オーストラリア	カナダ	デンマーク	ニュージーランド	ノルウェー	シンガポール	スウェーデン	スイス	イギリス																																		
																																										

※2019年8月末現在の投資対象国であり、今後、変更される場合があります。実際の投資とは異なります。(組み入れていない場合もあります。)

### 信用格付のイメージ

信用格付業者		S&P	Moody's	R&I
信用格付	高い ↑ ↓ 低い	AAA	Aaa	AAA
		AA	Aa	AA
		A	A	A
		BBB	Baa	BBB
		BB	Ba	BB
		B	B	B
		CCC	Caa	CCC
		CC	Ca	CC
		C	C	C
		D		

(注) S&P：スタンダード&プアーズ  
Moody's：ムーディーズ  
R & I：株式会社格付投資情報センター

※市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



## 投資プロセス



## 国内債券（しんきん国内債券マザーファンドⅡ）

## process 1 経済環境分析

経済動向など債券市場を取り巻く環境を多角的に分析します。

## process 2 組入銘柄の決定

金利水準や方向性、償還期限ごとの金利の変化、信用リスクなどを踏まえて、実際に組み入れる銘柄を決定します。

## process 3 ポートフォリオのリスク分析

マザーファンドの基準価額の値動きやその要因等を管理・分析します。

外国債券（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）  
（しんきん高格付外国債券マザーファンド）

## process 1 経済環境分析

経済動向など投資先の債券市場を取り巻く環境を多角的に分析します。

## process 2 組入銘柄の決定

国別の金利水準や方向性、償還期限ごとの金利の変化、  
国別の金利環境などを踏まえて、実際に組み入れる銘柄を決定します。

## process 3 ポートフォリオのリスク分析

マザーファンドの基準価額の値動きやその要因等を管理・分析します。

## ■ 投資する各資産について ※常に全ての資産に投資するとは限りません。

### 不動産投資信託（リート）



#### 国内リート、外国リート（為替ヘッジなし）

国内および外国の上場不動産投資信託を主要投資対象とします。

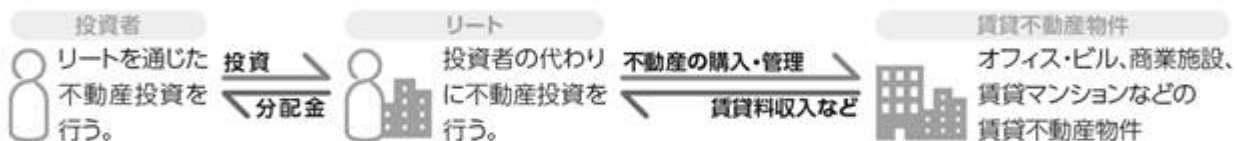
#### ◎不動産投資信託（リート）のポイント

- 間接的に不動産へ投資した効果が得られます。
- リートは、不動産の賃貸料収入などから、投資者に分配を行う仕組みになっています。そのため、不動産からの収益を分配金として受取ることが可能です。
- リートは、債券や株式と異なった値動きをする傾向があり、分散投資の対象として有効な資産の一つと言えます。
- わが国を含む世界各国のリート市場に分散投資が可能です。

#### 不動産投資 信託とは

- 不動産投資信託とは、「不動産を証券化した金融商品」で、「Real Estate Investment Trust」の頭文字を取ってリート（REIT）と呼ばれます。
- リートは、「投資者から集めた資金によって、不動産の購入・管理運営を行い、それによって得た賃貸料収入などから投資者へ分配金を支払う」という商品で、少額の資金で不動産に分散投資した効果を得ることができます。

#### <リーートの仕組み>



### リーートの投資対象国・地域

北米地域	欧州・中東地域	アジア・オセアニア地域
アメリカ カナダ	ベルギー              イタリア              イスラエル              フランス              オランダ スペイン              ドイツ              アイルランド              イギリス	香港              日本              シンガポール              韓国 オーストラリア              ニューージーランド

※ 2019年8月末現在の投資対象国・地域であり、実際の投資とは異なります。（組み入れていない場合もあります。）

※ 外国リーートの投資対象国はS&P先進国REIT指数構成国です。指数構成国であっても、対象銘柄がない場合があります。

◆ 外国不動産投資信託による運用は、ブラックロック・ジャパン株式会社が行います。

#### ～ブラックロック・ジャパンについて～

ブラックロック・ジャパン株式会社は、グローバルに資産運用ビジネスを展開するブラックロック・グループ（以下、「ブラックロック」といいます。）の一員です。ブラックロックは、世界約30か国に拠点を擁し、約737兆円（2019年6月末現在）を運用する世界有数の資産運用グループです。

※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。



## ● 投資プロセス



### 国内リート（しんきんJリートマザーファンドⅡ）

process

1

#### 経済環境分析

経済動向など J-REIT 市場を取り巻く環境を多角的に分析します。

process

2

#### 組入銘柄の決定

財務分析や流動性、価格の分析を踏まえ、実際に組み入れる銘柄を決定します。

process

3

#### ポートフォリオのリスク分析

マザーファンドの基準価額の値動きやその要因等を管理・分析します。



### 外国リート（しんきんグローバルリートマザーファンド）

process

1

#### ポートフォリオ構築

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

process

2

#### ポートフォリオのリスク分析

S&P先進国REIT指数の動きとマザーファンドの基準価額の値動きの乖離およびその要因等を管理・分析します。

#### ● 「S&P先進国REIT指数」について

「S&P先進国REIT指数」とは、Standard&Poor's Dow Jones Indices LLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（REIT）および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。当指数は、Standard&Poor's Dow Jones Indices LLCの商品であり、当ファンドに対して利用許諾が与えられています。Standard&Poor's®およびS&P®（以下「S&P」といいます。）は、Standard&Poor's Financial Services LLCの登録商標であり、S&Pは、当ファンドを推奨・支持・販売・促進等するものではありません。S&Pは、S&Pが公表する各指数またはそれに含まれるデータの正確性あるいは完全性を保証するものではなく、また、S&Pが公表する各指数またはそれに含まれるデータを利用した結果生じた事項に関して保証等の責任を負うものではありません。

## ■ 外国為替相場の影響について

当ファンドは、資産の一部を外貨建資産に投資する場合があります。

- 外国為替相場の変動の影響を受けますので、投資先の通貨に対して円安になると為替差益が期待できますが、一方で、投資先の通貨に対して円高になると為替損失を被る可能性があります。また、当ファンドでは原則として外国為替相場の影響を回避する取引（いわゆる為替ヘッジ）は行いません。

### 為替変動と外貨建資産価値のイメージ

円安になると外貨建資産の価値は  
円ベースで上昇します。

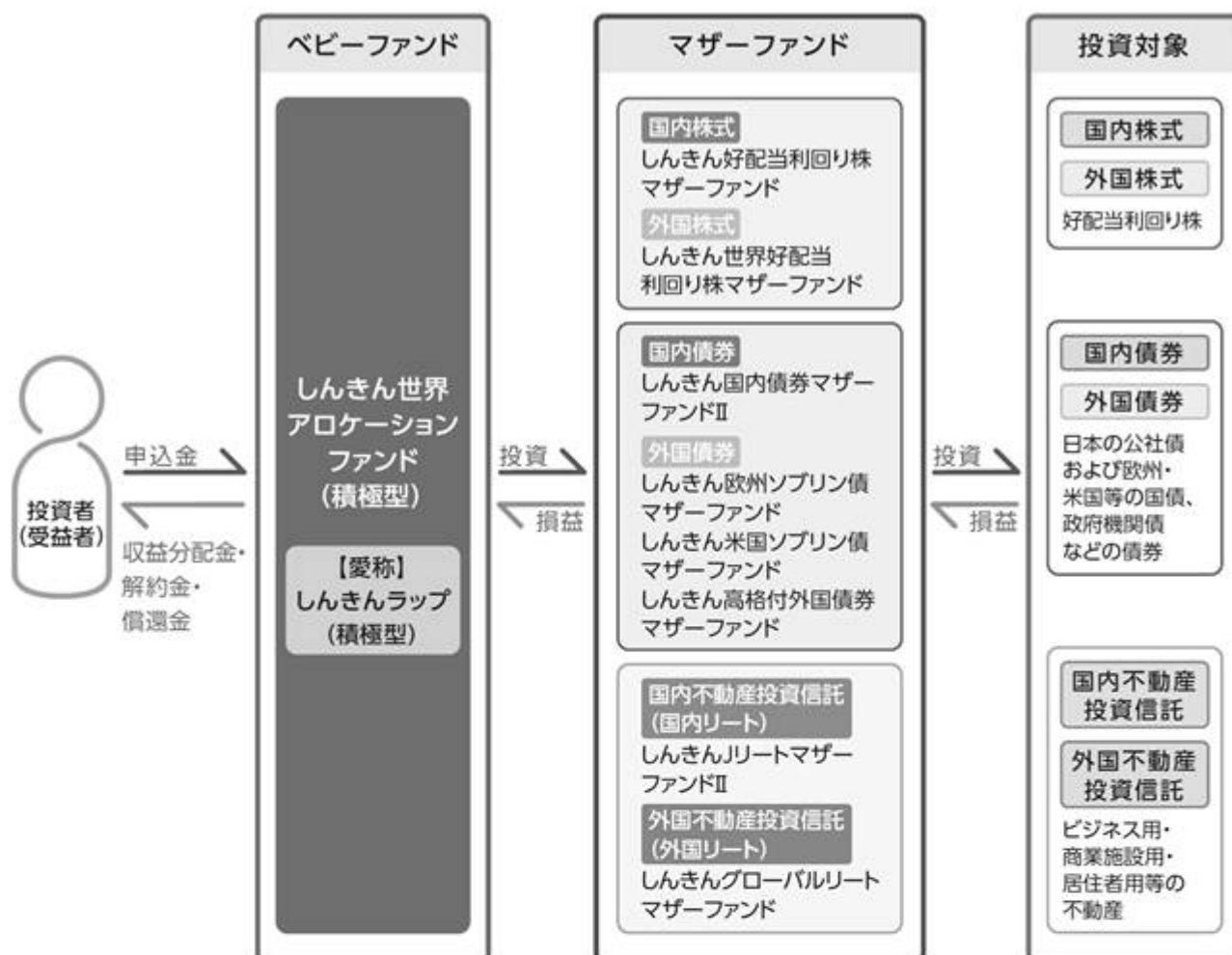


円高になると外貨建資産の価値は  
円ベースで下落します。



※上記は一般的な場合の説明であり、様々な条件により異なる場合があります。

## ■ ファンドの仕組み



投資者の資金は、しんきん世界アロケーションファンド（積極型）（ベビーファンド）にまとめられ、上記の各マザーファンドに投資されます。このように、実質的な運用をマザーファンドで行う方式を「ファミリーファンド方式」といいます。

※ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際して運用管理費用（信託報酬）等のコストは掛かりません。

※上記のマザーファンドは、ベビーファンドが投資対象とするマザーファンドです。一部のマザーファンドの配分比率をゼロとする場合があります。

※「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の運用指図に関する権限は、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。

※「しんきんグローバルリートマザーファンド」の運用指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。

※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。

## ■ 主な投資制限

国内外の株式、債券および不動産投資信託への投資は、マザーファンドを通じて行います。（しんきん世界アロケーションファンド（積極型）が直接株式に投資したり、外貨建資産に投資することはありません。）

#### 信託金の限度額

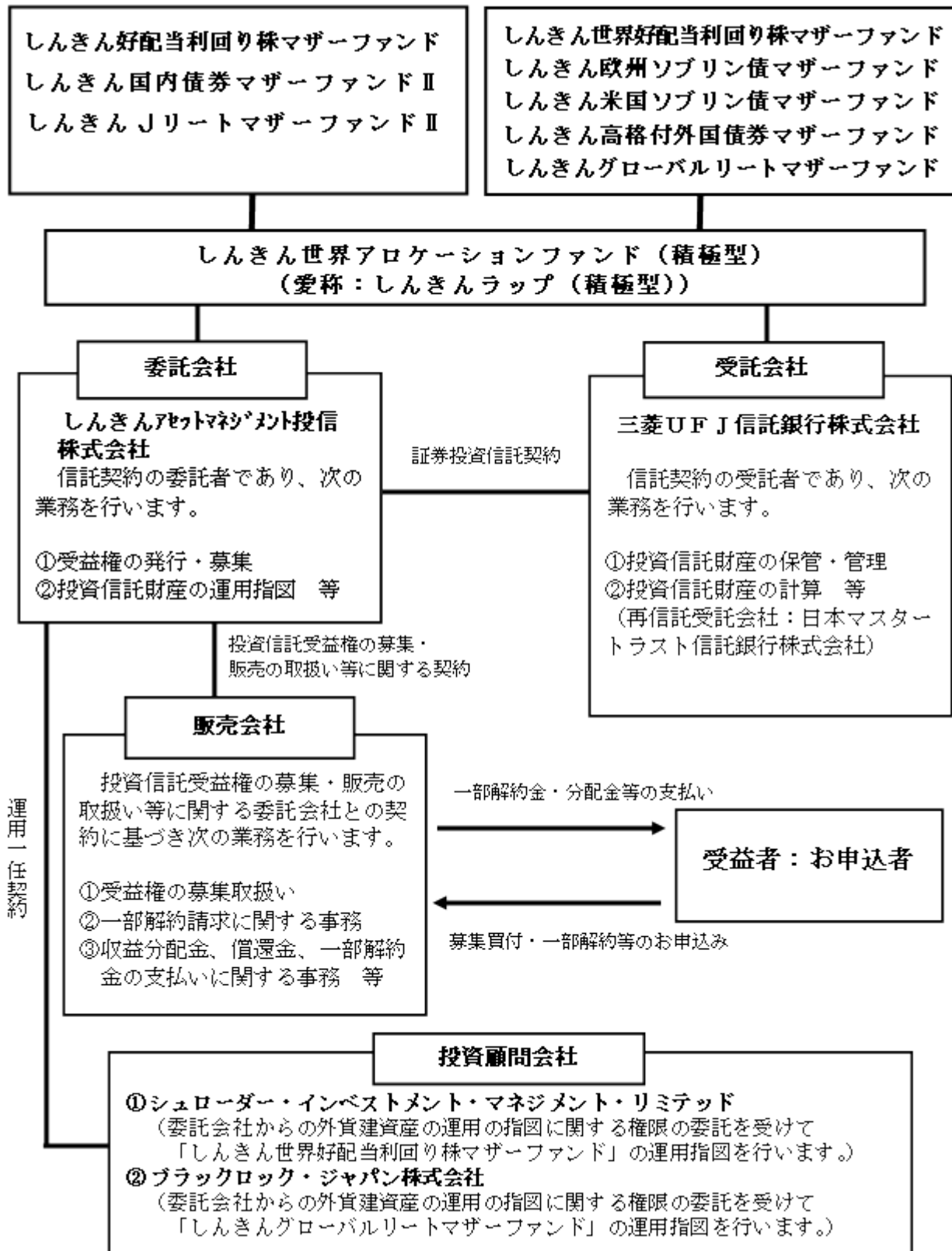
- ・ 2,000億円を限度額として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### （２）【ファンドの沿革】

2016年2月16日 信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

当ファンドの仕組みは、以下のとおりです。



上記のマザーファンドは、「しんきん世界アロケーションファンド（積極型）」が投資対象とするマザーファンドです。一部のマザーファンドの配分比率をゼロとする場合があります。

## &lt; 委託会社の概況 &gt;（本書提出日現在）

## 名称

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

## 本店の所在の場所

東京都中央区京橋三丁目 8 番 1 号

## 資本の額

200百万円

## 会社の沿革

1990年12月	全信連投資顧問株式会社として設立
1991年 3月	投資顧問業の登録
1992年 3月	投資一任契約に係る業務の認可
1998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
1998年12月	証券投資信託委託業の認可
2007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
2017年 8月	金融商品取引法に基づく第二種金融商品取引業の追加登録

## 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】

## 投資対象

しんきん好配当利回り株マザーファンド受益証券（国内株式）、しんきん世界好配当利回り株マザーファンド受益証券（外国株式）、しんきん国内債券マザーファンド 受益証券（国内債券）、しんきん欧州ソブリン債マザーファンド受益証券（外国債券）、しんきん米国ソブリン債マザーファンド受益証券（外国債券）、しんきん高格付外国債券マザーファンド受益証券（外国債券）、しんきんJリートマザーファンド 受益証券（国内不動産投資信託）およびしんきんグローバルリートマザーファンド受益証券（外国不動産投資信託）を主要投資対象とします。

（ ）内は投資対象資産を示します。

## 投資態度

- 1) 各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および不動産投資信託へ実質的な投資を行います。
- 2) 原則として、各マザーファンド受益証券への配分比率は、定性評価、定量評価等を勘案した資産分散手法により決定し、適宜見直しを行います。なお、一部のマザーファンド受益証券への配分比率をゼロとする場合があります。
- 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) 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ことがあります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

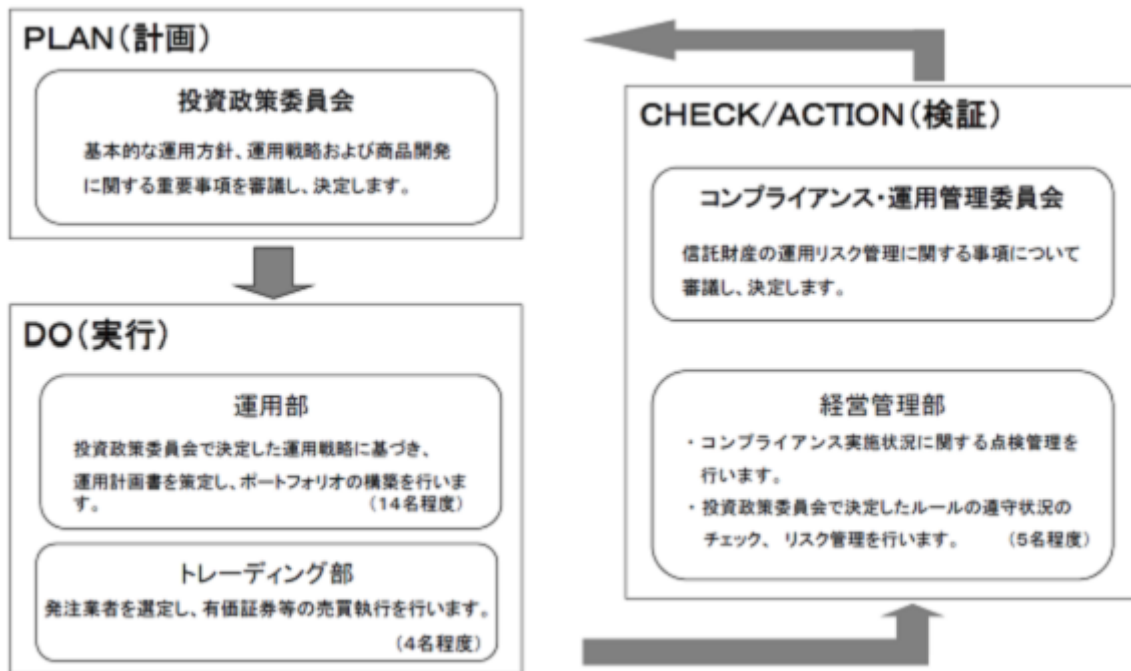
- 1) 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - イ．有価証券
  - ロ．約束手形
  - ハ．金銭債権
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ．為替手形

### 投資の対象とする有価証券の範囲等

- 1) 委託会社は、信託金を、しんきんアセットマネジメント投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「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」、「しんきんJリートマザーファンド」および「しんきんグローバルリートマザーファンド」の受益証券のほか、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見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。
  - イ．コマーシャル・ペーパー
  - ロ．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
  - ハ．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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の新株引受権証券を除きます。）なお、ハ．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。
- 2) 委託会社は、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見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行うことができます。
  - イ．預金
  - ロ．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。）
  - ハ．コール・ローン
  - ニ．手形割引市場において売買される手形
- 3) 1)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、主として上記2)のイ．からニ．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）【運用体制】

当社のファンドの運用体制は、以下のとおりです。



#### 投資プロセス

信金中央金庫グループおよ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。

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、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、今後変更となる場合があります。

### （４）【配分方針】

年1回の決算日に、原則として以下の方針に基づいて分配を行います。

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（評価益を含みません。）等の全額とします。

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には、分配を行わないこともあります。

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】

「しんきん世界アロケーションファンド（積極型）」の投資信託約款（以下「約款」といいます。）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。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への直接投資は行いません。



### 信用リスク集中回避のための投資制限

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い、当該比率以内になるよう調整を行うこととします。

### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、我が国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用および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。）の指図を行うことができます。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します。

- 1) 上記 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) 上記 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）親投資信託（マザーファンド）に関する情報

「しんきん好配当利回り株マザーファンド」の概要

## （１）投資方針

### 投資対象

我が国の金融商品取引所上場株式（これに準ずるものを含まず。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

- 1）主として予想配当利回りが市場平均を上回ると判断できる株式に投資し、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。
- 2）銘柄の選定にあたっては、企業業績、財務健全性、時価総額などを総合的に勘案して決定します。
- 3）株式等の組入れは、原則として高位を保ちます。
- 4）株式以外の資産の組入比率は、通常の場合50%以下とします。
- 5）投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引を行うことができます。
- 6）資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたときおよび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）投資対象

### 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19条、第20条および第21条に定めるものに限りません。）

3）金銭債権

4）約束手形

### 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（本邦通貨表示のものに限りません。）に投資することを指図します。

- 1）株券または新株引受権証書
- 2）国債証券
- 3）地方債証券
- 4）特別の法律により法人の発行する債券
- 5）社債券（新株引受権証券と社債券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。）
- 6）特定目的会社に係る特定社債券（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。）
- 7）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。 )および新株予約権証券
- 12) 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
- 13) 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、外国投資信託を除きます。)
- 14) 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、外国投資証券を除きます。)
- 15) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
- 16) 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、本邦通貨建のものとしします。)
- 17) 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。)
- 18) 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、第12号および第16号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第2号から第6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13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 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、信託金を前項1)から4)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

株式への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の転換社債および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。)への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

#### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん好配当利回り株マザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合の信託財産留保額はありませぬ。

## 「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

## 投資態度

- 1) 日本を除く世界各国の配当利回りの高い企業の株式へ分散投資を行うことにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。
- 2) 運用指図に関する権限は、シュロダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドに委託します。
- 3) 株式の銘柄選定にあたっては、銘柄毎の配当利回り・増配期待・流動性に着目しつつ、企業のファンダメンタル分析も勘案して行います。
- 4) 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。
- 5) 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 6) 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) 投資対象

## 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20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。)
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

## 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に投資することを指図します。

- 1) 株券または新株引受権証書
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 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。)
- 6) 特定目的会社に係る特定社債券(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。)
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- 8) 協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 9) 特定目的会社に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 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
- 13) 投資信託または外国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ます。）
- 14) 投資証券または外国投資証券（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ます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 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。）
- 20) 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
- 21) 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- 22) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書、第12号および第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6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13号の証券および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を上記に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記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

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合には、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合には、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債および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。)への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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。

#### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合、親投資信託の基準価額から、当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

## 「しんきん国内債券マザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

我が国の公社債を主要投資対象とします。

## 投資態度

- 1) 「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとします。
- 2) 投資対象とする公社債は、組入段階においていずれかの指定格付業者等から B B B 格相当以上の長期信用格付を得ている銘柄とします。
- 3) 国内企業およびそれに準じる発行体の発行するユーロ円建資産ならびに外国企業の発行する円建資産・ユーロ円建資産を組み入れることがあります。
- 4) 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、債券市場分析等を踏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。
- 5) 公社債の組入比率については原則として高位を保ちます。
- 6) 有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引（以下「先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- 7) 市況動向および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。

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

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

## (2) 投資対象

## 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とされる資産の種類は次に掲げるものとします。

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。）

- 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ません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

## 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（本邦通貨表示のものに限りません。）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) 特定目的会社に係る特定社債券(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本邦通貨建の証券または証書で、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スド・エンド型のもは除きます。)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本邦通貨建のものとしします。)
- 11) 外国法人が発行する本邦通貨建の譲渡性預金証書
- 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) 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。)

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

委託会社は、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により運用することを指図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

上記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

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債および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10%以下とします。

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。

外貨建資産への投資は行いません。

### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん国内債券マザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合、親投資信託の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

## 「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

## 投資対象

欧州経済通貨同盟（EMU）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。

## 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) FTSE 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。

## 「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

## 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。

## 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) FTSE 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。

上記「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」および「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」の主な投資戦略は、以下のとおりです。

## 金利リスクのコントロール

- 1) 金利水準の方向性について予想し、債券の「デュレーション」を長期化・短期化します。具体的には、マザーファンドのデュレーションをベンチマークとなるインデックスのデュレーションから±1年程度の範囲でコントロールします。
- 2) 「イールドカーブ」の変化に対する見通しを立て、相対的にパフォーマンスの良くなると予想した年限に資金配分します。

(注1) デュレーションとは、金利が変動した時に債券の価値が、どの程度変化するのかを表す指標です。

(注2) イールドカーブとは、同種類の債券の償還までの残存期間を横軸にとり、それに対応した利回りを縦軸にとった時に描かれる利回り曲線です。このイールドカーブが右上がりの場合を順イールド、右下がりの場合を逆イールドといいます。

国別配分(主として「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」について)

債券価格は、金利によって上下する性質があります。投資対象とするソブリン債等の金利環境は、国によって様々であるといえます。マザーファンドでは、相対的に金利低下が期待できる国への投資配分をベンチマーク比で多くすることによって、金利低下時の値上がり益を、より享受することを目指します。

(2) 投資対象(「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」および「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」に共通です。)

投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とされる資産の種類は、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。

3) 金銭債権

4) 約束手形

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) 特定目的会社に係る特定社債券(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本邦通貨建のものとしま。
- 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。
- 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、1)から5)までの証券および7)の証券または証書のうち1)から5)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、8)または9)の証券を以下「投資信託証券」といいま

す。

委託会社は、信託金を に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記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。

委託会社は、投資信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、投資信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- (3) 投資制限 「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」および「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」に共通です。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債および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。

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。

- (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」および「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合の信託財産留保額はありません。

「FTSE EMU国債インデックス」と「FTSE米国国債インデックス」は「FTSE世界国債インデックス」のサブ・インデックスです。

「FTSE世界国債インデックス」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営される債券インデックスで、1984年12月末を100とする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、指数化したものです。

上記の指数は、FTSE Fixed Income LLC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。

## 「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

## 投資対象

日本、米国、欧州経済通貨同盟（EMU）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。

## 投資態度

- 1) 投資対象とする公社債は、組入時において、信用格付業者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格以上の信用格付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、債券市場分析等を踏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

## 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ません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

## 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) 特定目的会社に係る特定社債券（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。

委託会社は、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により運用することを指図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

上記 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

株式への投資は行いません。

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。

同一銘柄の転換社債および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。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん高格付外国債券マザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合、親投資信託の基準価額から、当該基準価額に0.1%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

## 「しんきん」リートマザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

主として我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。

## 投資態度

- 1) 我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、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ます。
- 2) 運用にあたっては、東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数（配当込み）」をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果を目指して運用を行います。
- 3) 不動産投資信託証券の銘柄の選定にあたっては、主に次の項目に着目して行うことを基本とします。

## イ) 財務分析

不動産投資信託証券の財務内容を分析し、信用リスクが高いと判断される銘柄を除外します。

## ロ) 収益性分析

不動産投資信託証券の収益性および予想配当利回りの水準を分析します。

## ハ) 流動性・価格分析

不動産投資信託証券の流動性（時価総額・売買代金など）や価格水準の側面から分析します。

- 4) 不動産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。

東証REIT指数は、東京証券取引所に上場されている不動産投資信託（REIT）全銘柄を対象とした時価総額加重平均型の指数で、2003年3月31日の時価総額を基準として（株）東京証券取引所が算出・公表しています。

東証REIT指数は、銘柄数の増減など市況動向によらない時価総額の増減や増資などが発生する場合は、連続性を維持するため、基準時の時価総額が修正されます。

東証REIT指数（配当込み）の算出は、配当金落ち、有償減資の場合も基準時価総額の修正が行われます。

## (2) 投資対象

## 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とされる資産の種類は、次に掲げる特定資産（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

## 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、主として我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券のほか、次の有価証券（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) コマーシャル・ペーパー



2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨建の証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの

3) 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券(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の新株引受権証券を除きます。

なお、3)の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引(売戻し条件付の買い入れ)および債券貸借取引(現金担保付き債券借入れ)に限り行うことができるものとします。

4) 新投資口予約権証券(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ます。)

委託会社は、信託金を に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の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30%を超えないものとします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきん」リートマザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合、親投資信託の基準価額から、当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

## 「しんきんグローバルリートマザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

## 投資態度

- 1) 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 運用指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。
- 3) 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 4) 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。
- 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。

S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）は、スタンダード&プアーズ（以下「S & P」といいます。）が有するS & Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から不動産投資信託（REIT）および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数です。

## (2) 投資対象

## 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とされる資産の種類は、次に掲げる特定資産（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

## 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、主として日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）のほか、次の有価証券に投資することを指図します。

- 1) コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
- 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券
- 4) 投資証券もしくは投資法人証券または外国投資証券
- 5) 新投資口予約権証券（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ます。）

委託会社は、信託金を に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品により運用することを指図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

上記 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

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、当該不動産投資信託証券へ S & P 先進国 R E I T 指数(除く日本、ヘッジなし・円ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド(積極型)」が「しんきんグローバルリートマザーファンド」(親投資信託)の受益証券の一部解約を行う場合、親投資信託の基準価額から、当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額が信託財産留保額として控除されます。

### 3【投資リスク】

「しんきん世界アロケーションファンド（積極型）」（愛称：しんきんラップ（積極型））は、値動きのある有価証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、預貯金とは異なり、投資元本は保証されているものではありません。ファンドの運用による利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

#### （1）基準価額の変動要因

##### 価格変動リスク

有価証券の価格は、国内および国外の政治・経済情勢、発行体の業績、市場の需給等を反映して変動します。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。

##### 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します。また、償還までの期間が長い公社債等は、概して、短い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。

##### 不動産投資信託のリスク

不動産投資信託は、不動産を実質的な投資対象としているために、他の金融商品と異なり、火災・自然災害や不動産に係る法制度の変更などの影響を受けて投資先の不動産の価値が変動する場合があります。当ファンドが投資する不動産投資信託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。

##### 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になった場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 信用リスク

有価証券等の発行体が経営不安、倒産等に陥った場合、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有価証券および短期金融商品の価格は下落し、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。組入有価証券等の価格が下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

##### 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。当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。

##### 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、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。

上記の変動要因は主なもののみであり、上記に限定されるものではありません。

#### （2）その他の留意点

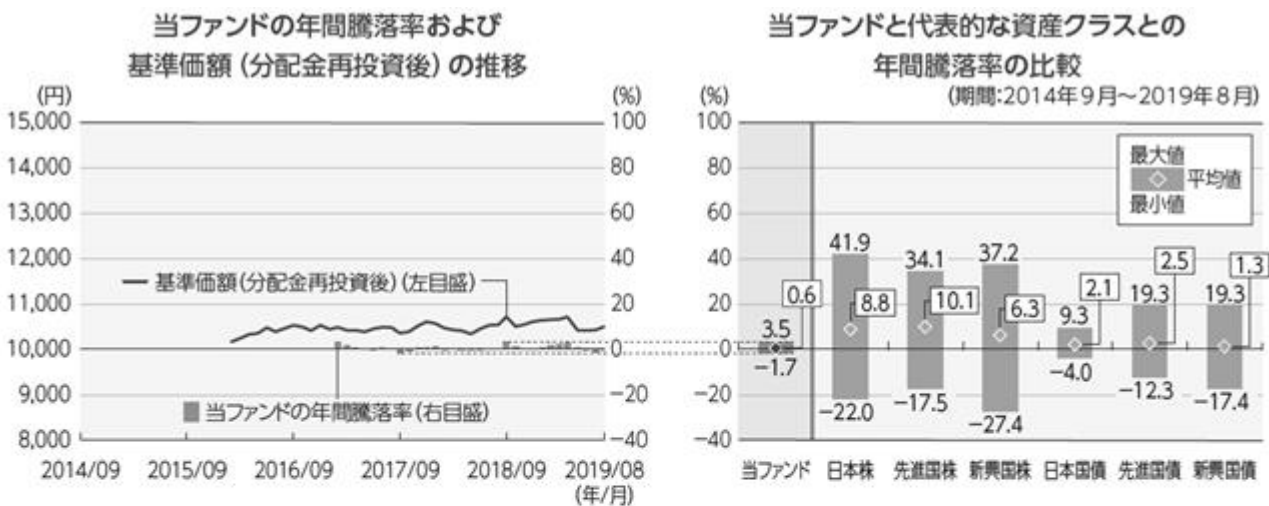
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（クーリング・オフ）の適用はありません。

### (3) リスクの管理体制

運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析および法令遵守の観点から運用状況を監視します。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としています。原則月1回開催するコンプライアンス・運用管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しています。

投資リスクに対する管理体制等は、今後変更となる場合があります。

## 参考情報



※当ファンドの年間騰落率は、2017年2月～2019年8月です。

※基準価額（分配金再投資後）は、2016年2月末～2019年8月末です。

※上記の左グラフは、各月末における当ファンドの直近1年間の騰落率および基準価額（分配金再投資後）の推移を表示したものです。

※基準価額（分配金再投資後）は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しています。しんきんアセットマネジメント投信（株）が公表している基準価額とは異なる場合があります。

※上記の右グラフは、当ファンドについては2017年2月から2019年8月、代表的な資産クラスについては2014年9月から2019年8月の5年間の年間騰落率の平均・最大・最小を表示したものです。当該グラフは、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

上記のグラフ・データは過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

資産クラス	指数名	詳細	権利の帰属先
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。	東京証券取引所
先進国株	MSCI-KOKUSAI インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・ マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。	野村證券株式会社
先進国債	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。	FTSE Fixed Income LLC
新興国債	JP モルガン・ガバメント・ ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・ グローバル・ディバースファイド (円ベース)	J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建国債を対象にした指数です。	J.P. Morgan Securities LLC

(注) 海外の指数は、為替ヘッジを行わない投資を想定して、円ベースとしています。

※権利の帰属先は、当該指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利を有します。

※騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しておりますが、同社はその内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害および一切の問題について、何らの責任も負いません。

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込手数料は、購入金額に応じて購入価額に1.65%（税抜1.5%）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。

（購入金額とは「買付申込日の翌営業日の基準価額×申込口数」をいいます。）

収益分配金の再投資に際しては、申込手数料は掛かりません。

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。）が課されません。

申込手数料は、販売会社によるファンドの募集・販売に関する取扱い事務および情報提供の対価です。

販売会社が定める申込手数料については、販売会社また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）  
< コールセンター > 0120-781812  
携帯電話・PHSからは 03-5524-8181（受付時間：営業日の9:00～17:00）  
< ホームページ > <http://www.skam.co.jp>

## (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0.3%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】

純資産総額に対して、年率1.155%（税抜1.05%）

1万口あたりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (保有日数 / 365)

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

※運用管理費用は、計算期間を通じて毎日計算され、毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期間末、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。

運用管理費用  
(信託報酬)

支払先	配分（税抜）および役務の内容	
委託会社	純資産総額に対して、 年率0.49%	ファンドの運用、受託会社への運用指図、法定書類の作成等の対価
販売会社	純資産総額に対して、 年率0.51%	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理および購入後の情報提供等の対価
受託会社	純資産総額に対して、 年率0.05%	運用財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

委託会社の運用管理費用（信託報酬）には、シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッドへ支払う投資顧問報酬（しんきん世界好配当利回り株マザーファンドの純資産総額に対して、年率0.50%（税抜）以内）およびブラックロック・ジャパン株式会社へ支払う投資顧問報酬（しんきんグローバルリートマザーファンドの純資産総額に対して、年率0.50%（税抜）以内）が含まれています。

「税抜」における「税」とは、消費税等相当額をいいます。

委託会社が受け取る信託報酬には、ファンド監査の費用が含まれます。

#### (4)【その他の手数料等】

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、資金の借入れ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。

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は、受益者の負担とし投資信託財産から支払われます。

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、売買委託手数料に係る消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は投資信託財産から支払われます。

当ファンドの手数料等の合計額については、投資者がファンドを保有される期間に応じて異なりますので、表示することができません。

#### (5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

##### 個別元本について

- 1) 受益者ごと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係る消費税等相当額は含まれません。）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は各販売会社ごとに、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、当該支店等ごとに個別元本の算出が行われる場合があります。

##### 収益分配金について

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「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごと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「元本払戻金（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「元本払戻金（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区分については、後記＜個別元本および収益分配金の区分の具体例＞をご参照ください。

##### 個人、法人別の課税上の取扱いについて

#### 1) 個人の受益者に対する課税

収益分配金に対する課税	収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
換金時および償還時	一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。



<p>損益通算について</p>	<p>一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能です。</p> <p>一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能です。</p> <p>特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。)の譲渡益および利子等も通算が可能です。</p>
-----------------	---

少額投資非課税制度「愛称:NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称:ジュニアNISA(ニーサ)」をご利用になれます。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## 2) 法人の受益者に対する課税

<p>収益分配時 ならびに 換金時および 償還時の差益 に対する課税</p>	<p>法人の受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。</p> <p>収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金には課税されません。</p> <p>益金不算入制度の適用はありません。</p>
--	---

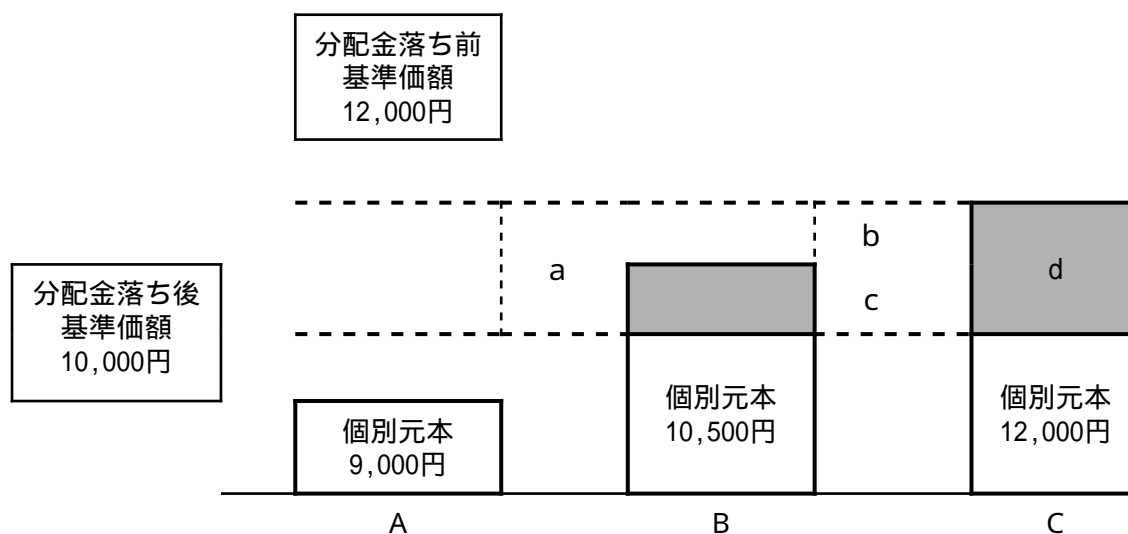
2020年1月1日以降の分配時において、外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

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。

税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## &lt; 個別元本および収益分配金の区分の具体例 &gt;

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、a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cの部分(500円)は「元本払戻金（特別分配金）」となり、収益分配金(2,000円)からc「元本払戻金（特別分配金）」(500円)を差引いた残りのb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) - 「元本払戻金（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、dの部分(2,000円)は「元本払戻金（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) - 「元本払戻金（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。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 5【運用状況】

以下は2019年8月30日現在の運用状況です。

投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価または評価金額の比率です。

投資比率の内訳と合計は、端数処理の関係で一致しない場合があります。

## (1)【投資状況】

しんきん世界アロケーションファンド(積極型)

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	8,874,582,096	97.78
現金・預金およびその他の資産(負債控除後)		201,517,292	2.22
合計(純資産総額)		9,076,099,388	100.00

## (2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

評価額上位銘柄(親投資信託受益証券)

国名 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	しんきん国内債券マザーファンド	3,737,454,424	1.3364	4,994,734,093	1.3644	5,099,382,816	56.18
日本	しんきんJリートマザーファンド	363,289,512	2.4112	876,000,000	2.5072	910,839,464	10.04
日本	しんきん世界好配当利回り株マザー ファンド	362,467,388	2.1463	778,000,000	2.0345	737,439,900	8.13
日本	しんきんグローバルリートマザーファ ンド	372,537,986	1.7769	662,000,000	1.8220	678,764,210	7.48
日本	しんきん好配当利回り株マザーファン ド	315,745,742	1.9255	608,000,000	1.9072	602,190,279	6.63
日本	しんきん米国ソブリン債マザーファン ド	209,608,607	1.6172	339,000,000	1.6470	345,225,375	3.80
日本	しんきん欧州ソブリン債マザーファン ド	214,109,771	1.5832	339,000,000	1.5972	341,976,126	3.77
日本	しんきん高格付外国債券マザーファン ド	130,113,036	1.2296	160,000,000	1.2202	158,763,926	1.75

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.78
合計	97.78

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【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】

【純資産の推移】

2019年8月末日、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産総額ならびに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計算期間末（2017年2月14日）	4,442,574,191	4,442,574,191	10,450	10,450
第2計算期間末（2018年2月14日）	7,920,398,968	7,920,398,968	10,413	10,413
第3計算期間末（2019年2月14日）	8,899,870,332	8,899,870,332	10,655	10,655
2018年8月末日	8,800,532,012		10,542	
9月末日	8,971,768,081		10,719	
10月末日	8,659,318,582		10,506	
11月末日	8,744,851,315		10,550	
12月末日	8,832,728,678		10,613	
2019年1月末日	8,889,710,290		10,644	
2月末日	8,892,050,420		10,658	
3月末日	8,945,599,154		10,663	
4月末日	8,771,874,458		10,717	
5月末日	8,680,938,124		10,423	
6月末日	8,857,754,661		10,421	
7月末日	8,949,869,975		10,426	
8月末日	9,076,099,388		10,502	

（注）基準価額は、受益権1口当りの純資産額を1万口単位で表示したものです。

#### 【分配の推移】

計算期間		1万口当たりの収益分配金（円）
第1期	2016年2月16日～2017年2月14日	0
第2期	2017年2月15日～2018年2月14日	0
第3期	2018年2月15日～2019年2月14日	0

#### 【収益率の推移】

計算期間		収益率（%）
第1期	2016年2月16日～2017年2月14日	4.50
第2期	2017年2月15日～2018年2月14日	0.35
第3期	2018年2月15日～2019年2月14日	2.32
第4期（中間）	2019年2月15日～2019年8月14日	2.06

（注）収益率とは計算期間末の基準価額（分配付きの額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ちの額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た額に100を乗じて得た数です。

#### （4）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定数量（口）	解約数量（口）
第1期	2016年2月16日～2017年2月14日	4,316,988,570	65,714,520
第2期	2017年2月15日～2018年2月14日	4,212,469,981	857,512,006
第3期	2018年2月15日～2019年2月14日	2,044,421,758	1,297,686,561

第4期(中間)	2019年 2月15日~2019年 8月14日	1,178,942,022	917,576,849
---------	-------------------------	---------------	-------------

(注) 設定数量には、当初募集期間中の設定口数を含みます。

以下、ご参考として「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「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」、「しんきんJリートマザーファンド」および「しんきんグローバルリートマザーファンド」の運用状況を掲載します。

< 参考 >

「しんきん好配当利回り株マザーファンド」

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	28,007,524,270	98.34
現金・預金およびその他の資産(負債控除後)		472,044,314	1.66
合計(純資産総額)		28,479,568,584	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

評価額上位30銘柄(国内株式)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	828,700	405.46	336,010,727	428.10	354,766,470	1.25
2	日本	株式	SUBARU	輸送用機器	124,100	2,672.66	331,678,312	2,846.00	353,188,600	1.24
3	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	18,500	15,700.74	290,463,700	19,005.00	351,592,500	1.23
4	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	79,700	4,516.72	359,982,760	4,369.00	348,209,300	1.22
5	日本	株式	スター精密	機械	235,300	1,601.57	376,850,360	1,461.00	343,773,300	1.21
6	日本	株式	LIXILグループ	金属製品	194,200	1,492.01	289,748,342	1,741.00	338,102,200	1.19
7	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	676,100	536.81	362,940,190	500.00	338,050,000	1.19
8	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	65,600	5,191.73	340,577,820	5,150.00	337,840,000	1.19
9	日本	株式	マクセルホールディングス	電気機器	232,000	1,557.69	361,384,272	1,436.00	333,152,000	1.17
10	日本	株式	野村不動産ホールディングス	不動産業	147,100	2,155.06	317,010,776	2,252.00	331,269,200	1.16
11	日本	株式	出光興産	石油・石炭製品	116,000	3,830.47	444,335,284	2,855.00	331,180,000	1.16
12	日本	株式	横浜ゴム	ゴム製品	162,000	2,042.65	330,910,300	2,043.00	330,966,000	1.16
13	日本	株式	マックス	機械	191,600	1,593.64	305,342,100	1,714.00	328,402,400	1.15
14	日本	株式	マンダム	化学	125,300	2,849.10	356,993,219	2,614.00	327,534,200	1.15
15	日本	株式	ユー・エス・エス	サービス業	162,800	2,026.26	329,876,400	2,008.00	326,902,400	1.15
16	日本	株式	アマダホールディングス	機械	293,000	1,100.64	322,488,600	1,107.00	324,351,000	1.14
17	日本	株式	大和証券グループ本社	証券、商品先物取引業	707,600	549.53	388,851,810	457.80	323,939,280	1.14
18	日本	株式	住友倉庫	倉庫・運輸関連業	229,400	1,409.97	323,448,200	1,405.00	322,307,000	1.13
19	日本	株式	トッパン・フォームズ	その他製品	339,300	958.77	325,312,400	947.00	321,317,100	1.13
20	日本	株式	積水ハウス	建設業	170,400	1,818.83	309,930,200	1,885.50	321,289,200	1.13
21	日本	株式	日本通運	陸運業	58,400	6,072.34	354,624,837	5,490.00	320,616,000	1.13
22	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	62,900	4,786.89	301,095,518	5,096.00	320,538,400	1.13
23	日本	株式	カシオ計算機	電気機器	216,000	1,440.75	311,202,740	1,483.00	320,328,000	1.12
24	日本	株式	太陽ホールディングス	化学	97,800	3,586.83	350,792,220	3,275.00	320,295,000	1.12
25	日本	株式	住友金属鉱山	非鉄金属	107,000	3,217.09	344,229,167	2,991.50	320,090,500	1.12
26	日本	株式	N T T コモ	情報・通信業	119,300	2,482.58	296,172,507	2,682.00	319,962,600	1.12

27	日本	株式	住友商事	卸売業	200,900	1,595.41	320,518,362	1,592.50	319,933,250	1.12
28	日本	株式	三和ホールディングス	金属製品	270,500	1,274.86	344,850,500	1,182.00	319,731,000	1.12
29	日本	株式	日本精工	機械	375,000	979.02	367,134,600	852.00	319,500,000	1.12
30	日本	株式	大林組	建設業	326,100	1,085.92	354,118,640	979.00	319,251,900	1.12

## 業種別投資比率

業種	投資比率(%)
水産・農林業	1.11
建設業	3.35
食料品	2.09
繊維製品	2.15
化学	6.66
医薬品	3.37
石油・石炭製品	2.25
ゴム製品	2.26
ガラス・土石製品	1.09
鉄鋼	1.09
非鉄金属	2.22
金属製品	2.31
機械	7.83
電気機器	9.91
輸送用機器	6.69
精密機器	1.02
その他製品	2.25
電気・ガス業	1.09
陸運業	2.23
空運業	1.07
倉庫・運輸関連業	1.13
情報・通信業	5.63
卸売業	7.68
小売業	3.36
銀行業	6.37
証券、商品先物取引業	2.38
保険業	3.25
不動産業	2.15
サービス業	4.36
合計(対純資産総額比)	98.34

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
該当事項はありません。

## &lt; 参考 &gt;

## 「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	5,329,617,273	28.47
株式	カナダ	4,057,706	0.02
株式	ドイツ	31,494,061	0.17
株式	イタリア	1,586,911,818	8.48
株式	フランス	2,077,844,186	11.10
株式	オランダ	179,431,314	0.96
株式	スペイン	539,801,333	2.88
株式	ベルギー	745,667,248	3.98
株式	イギリス	6,395,482,321	34.16
株式	オーストラリア	623,247,843	3.33
小計		17,513,555,103	93.55
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		1,207,899,364	6.45
合計（純資産総額）		18,721,454,467	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		96,688	0.00
為替予約取引	売建		96,777	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄（外国株式）

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロ ジー・ライフサイエンス	98,277	8,614.56	846,613,539	9,177.49	901,936,440	4.82
2	イギリス	株式	STANDARD CHARTERED PLC	銀行	1,075,238	869.89	935,344,431	805.31	865,902,924	4.63
3	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	170,610	4,955.85	845,517,742	4,989.78	851,306,400	4.55
4	イタリア	株式	ENI SPA	エネルギー	515,782	1,662.53	857,505,664	1,601.88	826,223,624	4.41
5	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	56,621	14,374.86	813,919,281	14,359.32	813,039,329	4.34
6	イギリス	株式	PEARSON PLC	メディア・娯楽	734,118	1,046.35	768,149,317	1,082.56	794,733,124	4.25
7	イギリス	株式	ANGLO AMERICAN PLC	素材	343,600	2,440.65	838,608,139	2,254.87	774,775,339	4.14
8	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,002,981	839.46	841,968,961	767.05	769,343,797	4.11
9	ベルギー	株式	AGEAS	保険	131,571	5,379.97	707,848,711	5,667.41	745,667,248	3.98
10	アメリカ	株式	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	保険	131,981	5,463.02	721,014,973	5,584.89	737,099,578	3.94
11	イギリス	株式	WM MORRISON SUPERMARKETS	食品・生活必需品小売り	2,957,486	267.04	789,769,880	238.41	705,113,993	3.77
12	アメリカ	株式	WESTERN UNION CO	ソフトウェア・サービス	292,216	2,099.12	613,398,206	2,354.89	688,138,056	3.68
13	イギリス	株式	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	銀行	2,870,156	284.97	817,916,352	237.89	682,804,257	3.65



14	オーストラリア	株式	SOUTH32 LTD	素材	3,387,942	227.98	772,385,396	183.96	623,247,843	3.33
15	アメリカ	株式	OMNICOM GROUP	メディア・娯楽	67,913	8,375.43	568,801,223	8,044.11	546,300,159	2.92
16	スペイン	株式	REPSOL SA	エネルギー	351,242	1,658.42	582,508,074	1,536.83	539,801,333	2.88
17	イギリス	株式	CENTRICA PLC	公益事業	6,080,551	110.72	673,280,003	88.57	538,563,158	2.88
18	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	99,328	5,633.86	559,600,364	5,032.36	499,854,671	2.67
19	イギリス	株式	TESCO PLC	食品・生活必需品小売り	1,538,099	305.58	470,017,259	283.73	436,419,964	2.33
20	イタリア	株式	INTESA SANPAOLOA	銀行	1,723,805	249.37	429,871,563	236.84	408,279,774	2.18
21	フランス	株式	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	メディア・娯楽	411,083	1,112.21	457,212,585	976.91	401,594,032	2.15
22	アメリカ	株式	HP INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	200,020	2,021.21	404,283,994	1,925.86	385,210,797	2.06
23	フランス	株式	BNP PARIBAS	銀行	76,021	5,227.06	397,366,513	4,802.24	365,071,448	1.95
24	イタリア	株式	UNICREDIT SPA	銀行	294,409	1,281.82	377,381,680	1,197.00	352,408,420	1.88
25	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	38,013	7,135.83	271,254,460	6,802.79	258,594,608	1.38
26	アメリカ	株式	BUCKLE INC/THE	小売	117,915	1,999.31	235,749,677	2,100.45	247,675,246	1.32
27	フランス	株式	COFACE SA	保険	196,084	1,058.67	207,588,249	1,244.52	244,031,519	1.30
28	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	109,062	2,003.56	218,512,901	2,216.74	241,763,179	1.29
29	イギリス	株式	WPP PLC	メディア・娯楽	164,481	1,229.45	202,221,748	1,260.48	207,326,590	1.11
30	イギリス	株式	ROYAL MAIL PLC	運輸	712,519	270.45	192,704,813	269.73	192,190,885	1.03

## 業種別投資比率

業種	投資比率（％）
エネルギー	7.30
素材	7.47
商業・専門サービス	0.88
運輸	1.03
自動車・自動車部品	0.17
メディア・娯楽	10.42
小売	2.29
食品・生活必需品小売り	6.10
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.11
銀行	21.99
各種金融	0.02
保険	9.31
ソフトウェア・サービス	8.02
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.03
公益事業	2.88
半導体・半導体製造装置	4.55
合計（対純資産総額比）	93.55

投資不動産物件  
該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	通貨	買建/ 売建	数量	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	908.56	96,777	96,688	0.00
為替予約取引	英ポンド	売建	822.73	96,777	96,777	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

&lt; 参考 &gt;

## 「しんきん国内債券マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	18,344,950,000	83.55
地方債証券	日本	1,418,324,000	6.46
特殊債券	日本	1,018,146,000	4.64
社債券	日本	1,015,013,000	4.62
現金・預金およびその他の資産(負債控除後)		160,771,221	0.73
合計(純資産総額)		21,957,204,221	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄（国内債券）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	800,000,000	102.12	816,984,000	103.87	831,032,000	0.1	2029/3/20	3.78
2	日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	800,000,000	102.64	821,128,000	102.46	819,736,000	1.3	2021/3/20	3.73
3	日本	国債証券	第160回利付国債(20年)	600,000,000	108.95	653,712,000	112.47	674,868,000	0.7	2037/3/20	3.07
4	日本	国債証券	第319回利付国債(10年)	600,000,000	103.30	619,836,000	103.25	619,512,000	1.1	2021/12/20	2.82
5	日本	国債証券	第168回利付国債(20年)	500,000,000	102.92	514,610,000	106.98	534,905,000	0.4	2039/3/20	2.44
6	日本	国債証券	第314回利付国債(10年)	500,000,000	102.28	511,428,000	102.15	510,785,000	1.1	2021/3/20	2.33
7	日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	500,000,000	102.11	510,550,000	101.92	509,610,000	1.2	2020/12/20	2.32
8	日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	450,000,000	105.14	473,134,500	108.96	490,360,500	0.5	2038/3/20	2.23
9	日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	400,000,000	102.35	409,428,000	103.96	415,852,000	0.1	2028/3/20	1.89
10	日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	400,000,000	102.25	409,014,000	103.96	415,848,000	0.1	2028/9/20	1.89
11	日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	400,000,000	102.82	411,280,000	102.69	410,764,000	1.2	2021/6/20	1.87
12	日本	国債証券	第316回利付国債(10年)	400,000,000	102.62	410,480,000	102.51	410,044,000	1.1	2021/6/20	1.87
13	日本	国債証券	第400回利付国債(2年)	400,000,000	100.55	402,200,000	100.65	402,636,000	0.1	2021/5/1	1.83
14	日本	特殊債券	第33回政府保証日本政策金融 公庫債券	400,000,000	100.27	401,100,000	100.21	400,840,000	0.15	2020/10/27	1.83
15	日本	国債証券	第60回利付国債(30年)	300,000,000	115.52	346,569,000	121.72	365,172,000	0.9	2048/9/20	1.66
16	日本	国債証券	第166回利付国債(20年)	300,000,000	108.77	326,310,000	112.79	338,391,000	0.7	2038/9/20	1.54
17	日本	国債証券	第116回利付国債(20年)	250,000,000	124.62	311,565,000	126.26	315,652,500	2.2	2030/3/20	1.44
18	日本	国債証券	第52回利付国債(20年)	300,000,000	105.25	315,762,000	104.95	314,865,000	2.1	2021/9/21	1.43
19	日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	300,000,000	102.21	306,630,000	103.92	311,775,000	0.1	2028/12/20	1.42
20	日本	国債証券	第140回利付国債(20年)	250,000,000	122.23	305,590,000	124.54	311,350,000	1.7	2032/9/20	1.42
21	日本	国債証券	第323回利付国債(10年)	300,000,000	103.37	310,116,000	103.42	310,284,000	0.9	2022/6/20	1.41
22	日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	300,000,000	103.06	309,204,000	103.14	309,438,000	0.8	2022/6/20	1.41
23	日本	国債証券	第148回利付国債(20年)	250,000,000	120.81	302,030,000	123.61	309,037,500	1.5	2034/3/20	1.41
24	日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	300,000,000	102.96	308,880,000	102.88	308,658,000	1.1	2021/9/20	1.41
25	日本	国債証券	第122回利付国債(20年)	250,000,000	120.96	302,418,000	122.80	307,015,000	1.8	2030/9/20	1.40
26	日本	国債証券	第150回利付国債(20年)	250,000,000	119.64	299,107,500	122.63	306,592,500	1.4	2034/9/20	1.40

27	日本	地方債証券	平成28年度第3回埼玉県公募 公債	300,000,000	100.34	301,038,000	100.30	300,906,000	0.08	2026/5/25	1.37
28	日本	国債証券	第56回利付国債(30年)	250,000,000	112.44	281,110,000	118.45	296,130,000	0.8	2047/9/20	1.35
29	日本	国債証券	第37回利付国債(30年)	200,000,000	136.13	272,269,000	141.51	283,020,000	1.9	2042/9/20	1.29
30	日本	国債証券	第40回利付国債(30年)	200,000,000	135.00	270,004,000	140.58	281,168,000	1.8	2043/9/20	1.28

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	83.55
地方債証券	6.46
特殊債券	4.64
社債券	4.62
合計	99.27

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

&lt; 参考 &gt;

## 「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ドイツ	2,052,206,857	16.60
国債証券	フランス	4,224,469,128	34.17
国債証券	オランダ	823,634,084	6.66
国債証券	スペイン	3,323,960,310	26.89
国債証券	ベルギー	1,239,095,599	10.02
国債証券	オーストリア	531,524,094	4.30
小計		12,194,890,072	98.64
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		167,823,435	1.36
合計（純資産総額）		12,362,713,507	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄（外国債券）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	フランス	国債証券	FRTR 5.750 10/25/32	2,700,000	19,264.26	520,135,158	21,202.80	572,475,803	5.75	2032/10/25	4.63
2	フランス	国債証券	FRTR 4.000 10/25/38	2,700,000	17,675.58	477,240,673	20,699.35	558,882,480	4	2038/10/25	4.52
3	スペイン	国債証券	SPGB 2.350 07/30/33	3,400,000	12,592.29	428,137,911	14,920.18	507,286,433	2.35	2033/7/30	4.10
4	ベルギー	国債証券	BGB 5.000 03/28/35	2,400,000	18,482.12	443,570,967	20,989.89	503,757,533	5	2035/3/28	4.07
5	ドイツ	国債証券	DBR 4.000 01/04/37	2,000,000	19,414.71	388,294,278	21,300.91	426,018,219	4	2037/1/4	3.45
6	フランス	国債証券	FRTR 2.750 10/25/27	2,700,000	14,232.48	384,277,213	15,021.35	405,576,477	2.75	2027/10/25	3.28
7	スペイン	国債証券	SPGB 4.200 01/31/37	2,100,000	17,014.02	357,294,421	18,972.54	398,423,397	4.2	2037/1/31	3.22
8	スペイン	国債証券	SPGB 3.800 04/30/24	2,700,000	13,803.88	372,704,774	14,089.72	380,422,478	3.8	2024/4/30	3.08
9	スペイン	国債証券	SPGB 1.950 04/30/26	2,600,000	12,898.11	335,350,896	13,472.16	350,276,261	1.95	2026/4/30	2.83
10	フランス	国債証券	FRTR 2.500 05/25/30	2,100,000	14,089.72	295,884,149	15,425.99	323,945,962	2.5	2030/5/25	2.62
11	ドイツ	国債証券	DBR 4.750 07/04/34	1,500,000	19,527.05	292,905,758	21,426.89	321,403,390	4.75	2034/7/4	2.60
12	スペイン	国債証券	SPGB 1.500 04/30/27	2,400,000	12,218.88	293,253,355	13,207.49	316,979,914	1.5	2027/4/30	2.56
13	スペイン	国債証券	SPGB 0.450 10/31/22	2,600,000	12,021.81	312,567,259	12,117.06	315,043,723	0.45	2022/10/31	2.55

14	フランス	国債証券	FRTR 2.250 10/25/22	2,400,000	12,850.83	308,419,978	12,928.71	310,289,119	2.25	2022/10/25	2.51
15	スペイン	国債証券	SPGB 1.950 07/30/30	2,200,000	12,338.21	271,440,636	14,046.19	309,016,363	1.95	2030/7/30	2.50
16	フランス	国債証券	FRTR 5.500 04/25/29	1,600,000	17,572.74	281,163,931	18,678.46	298,855,483	5.5	2029/4/25	2.42
17	オランダ	国債証券	NETHER 2.500 01/15/33	1,800,000	14,919.01	268,542,233	16,468.20	296,427,600	2.5	2033/1/15	2.40
18	フランス	国債証券	FRTR 1.250 05/25/34	2,000,000	12,228.79	244,575,825	14,142.65	282,853,098	1.25	2034/5/25	2.29
19	フランス	国債証券	FRTR 4.250 10/25/23	1,900,000	14,250.45	270,758,734	14,287.92	271,470,631	4.25	2023/10/25	2.20
20	フランス	国債証券	FRTR 0.500 05/25/26	2,000,000	12,580.99	251,619,980	12,666.98	253,339,731	0.5	2026/5/25	2.05
21	フランス	国債証券	FRTR 3.750 04/25/21	2,000,000	12,771.08	255,421,782	12,658.63	253,172,696	3.75	2021/4/25	2.05
22	フランス	国債証券	FRTR 0.500 05/25/25	2,000,000	12,092.36	241,847,280	12,586.99	251,739,963	0.5	2025/5/25	2.04
23	オースト リア	国債証券	RAGB 2.400 05/23/34	1,500,000	14,415.55	216,233,348	16,328.22	244,923,305	2.4	2034/5/23	1.98
24	ドイツ	国債証券	DBR 0.500 02/15/26	1,900,000	12,346.09	234,575,746	12,855.42	244,253,166	0.5	2026/2/15	1.98
25	スペイン	国債証券	SPGB 0.750 07/30/21	2,000,000	12,020.60	240,412,194	12,058.36	241,167,379	0.75	2021/7/30	1.95
26	フランス	国債証券	FRTR 3.250 05/25/45	1,100,000	19,333.17	212,664,924	20,568.78	226,256,600	3.25	2045/5/25	1.83
27	フランス	国債証券	FRTR 2.250 05/25/24	1,600,000	13,228.66	211,658,717	13,475.69	215,611,085	2.25	2024/5/25	1.74
28	ドイツ	国債証券	DBR 4.750 07/04/28	1,200,000	17,007.65	204,091,814	17,733.07	212,796,905	4.75	2028/7/4	1.72
29	スペイン	国債証券	SPGB 2.150 10/31/25	1,500,000	12,828.72	192,430,918	13,439.22	201,588,413	2.15	2025/10/31	1.63
30	スペイン	国債証券	SPGB 0.600 10/31/29	1,600,000	12,225.40	195,606,456	12,357.03	197,712,504	0.6	2029/10/31	1.60

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.64
合計	98.64

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

&lt; 参考 &gt;

## 「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」

## (1) 投資状況

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	12,092,530,253	95.75
特殊債券	国際機関	382,792,899	3.03
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		154,383,283	1.22
合計（純資産総額）		12,629,706,435	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄（外国債券）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 08/15/22	5,200,000	10,343.92	537,884,160	10,697.56	556,273,461	1.625	2022/8/15	4.40
2	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.625 11/15/20	5,000,000	10,665.12	533,256,479	10,764.10	538,205,203	2.625	2020/11/15	4.26
3	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.750 05/15/22	4,800,000	10,411.45	499,749,855	10,724.18	514,760,715	1.75	2022/5/15	4.08
4	アメリカ	国債証券	T-NOTE 3.625 02/15/21	4,700,000	10,874.03	511,079,528	10,947.91	514,551,955	3.625	2021/2/15	4.07
5	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.625 02/15/44	3,500,000	11,834.76	414,216,732	14,139.21	494,872,656	3.625	2044/2/15	3.92
6	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 02/15/24	4,400,000	10,784.06	474,498,874	11,244.83	494,772,850	2.75	2024/2/15	3.92
7	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 11/15/23	4,400,000	10,779.90	474,315,898	11,209.90	493,235,834	2.75	2023/11/15	3.91
8	アメリカ	国債証券	T-BOND 4.375 05/15/40	3,000,000	14,678.58	440,357,651	15,325.24	459,757,491	4.375	2040/5/15	3.64
9	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.125 02/15/42	3,500,000	10,954.56	383,409,870	13,022.22	455,777,718	3.125	2042/2/15	3.61
10	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.125 05/15/48	3,400,000	10,917.89	371,208,420	13,329.95	453,218,518	3.125	2048/5/15	3.59
11	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.625 08/15/20	4,000,000	10,661.80	426,472,108	10,729.17	429,166,875	2.625	2020/8/15	3.40
12	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 11/15/22	3,900,000	10,312.48	402,186,750	10,703.38	417,432,156	1.625	2022/11/15	3.31
13	アメリカ	国債証券	T-BOND 2.500 05/15/46	3,500,000	9,662.07	338,172,686	11,811.23	413,393,330	2.5	2046/5/15	3.27
14	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.875 05/31/25	3,600,000	11,036.76	397,323,691	11,477.71	413,197,875	2.875	2025/5/31	3.27
15	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 08/15/25	3,600,000	10,524.75	378,891,140	10,978.68	395,232,750	2	2025/8/15	3.13
16	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.125 08/15/21	3,500,000	10,655.63	372,947,379	10,761.60	376,656,314	2.125	2021/8/15	2.98

17	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 05/15/26	3,500,000	9,983.12	349,409,207	10,748.30	376,190,551	1.625	2026/5/15	2.98
18	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 02/15/23	3,400,000	10,458.03	355,573,073	10,841.45	368,609,434	2	2023/2/15	2.92
19	アメリカ	国債証券	T-BOND 5.250 02/15/29	2,600,000	13,046.34	339,204,848	14,160.84	368,181,929	5.25	2029/2/15	2.92
20	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.750 05/15/23	3,200,000	10,336.60	330,771,220	10,767.43	344,557,790	1.75	2023/5/15	2.73
21	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.375 06/30/23	3,200,000	10,163.60	325,235,300	10,618.55	339,793,706	1.375	2023/6/30	2.69
22	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 02/15/28	2,800,000	10,722.90	300,241,319	11,700.61	327,617,342	2.75	2028/2/15	2.59
23	アメリカ	国債証券	T-NOTE 3.125 05/15/21	2,900,000	10,917.55	316,609,130	10,917.14	316,597,069	3.125	2021/5/15	2.51
24	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.375 08/15/24	2,700,000	10,576.96	285,578,120	11,120.07	300,242,151	2.375	2024/8/15	2.38
25	アメリカ	国債証券	T-BOND 4.750 02/15/37	1,900,000	13,635.68	259,077,995	15,557.29	295,588,685	4.75	2037/2/15	2.34
26	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.875 04/30/22	2,300,000	10,453.04	240,419,949	10,753.29	247,325,710	1.875	2022/4/30	1.96
27	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 02/15/22	2,200,000	10,504.40	231,096,980	10,779.07	237,139,650	2	2022/2/15	1.88
28	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.625 02/15/29	2,000,000	10,621.88	212,437,604	11,679.82	233,596,529	2.625	2029/2/15	1.85
29	アメリカ	国債証券	T-BOND 8.125 05/15/21	1,900,000	11,960.11	227,242,197	11,812.06	224,429,324	8.125	2021/5/15	1.78
30	国際機関	特殊債券	IADB 2.125 01/15/25	2,000,000	10,297.87	205,957,516	10,957.92	219,158,556	2.125	2025/1/15	1.74

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	95.75
特殊債券	3.03
合計	98.78

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。



## &lt; 参考 &gt;

## 「しんきん高格付外国債券マザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	カナダ	467,101,622	21.00
国債証券	イギリス	539,808,561	24.27
国債証券	ノルウェー	521,622,061	23.45
国債証券	オーストラリア	538,936,986	24.23
小計		2,067,469,230	92.96
特殊債券	カナダ	83,537,906	3.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		73,095,963	3.29
合計（純資産総額）		2,224,103,099	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位銘柄（外国債券）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	ノルウェー	国債 証券	NGB 3.000 03/14/24	35,700,000	1,265.54	451,797,832	1,266.49	452,138,572	3	2024/3/14	20.33
2	オーストラ リア	国債 証券	ACGB 2.750 04/21/24	4,800,000	7,705.98	369,887,072	7,828.70	375,777,820	2.75	2024/4/21	16.90
3	イギリス	国債 証券	UKT 5.000 03/07/25	2,100,000	16,229.41	340,817,714	16,326.71	342,860,952	5	2025/3/7	15.42
4	カナダ	国債 証券	CAN 2.250 06/01/25	2,900,000	8,431.43	244,511,742	8,486.21	246,100,163	2.25	2025/6/1	11.07
5	カナダ	国債 証券	CAN 1.500 06/01/26	2,700,000	8,035.03	216,945,890	8,185.23	221,001,459	1.5	2026/6/1	9.94
6	イギリス	国債 証券	UKT 1.500 07/22/26	1,400,000	13,849.95	193,899,351	14,067.68	196,947,609	1.5	2026/7/22	8.86
7	オーストラ リア	国債 証券	ACGB 3.250 04/21/25	2,000,000	8,141.72	162,834,479	8,157.95	163,159,166	3.25	2025/4/21	7.34
8	カナダ	特殊 債券	CANHOU 2.550 12/15/23	1,000,000	8,293.54	82,935,479	8,353.79	83,537,906	2.55	2023/12/15	3.76
9	ノルウェー	国債 証券	NGB 1.500 02/19/26	5,800,000	1,181.86	68,548,055	1,197.99	69,483,489	1.5	2026/2/19	3.12

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	92.96
特殊債券	3.76
合計	96.71

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## &lt;参考&gt;

## 「しんきんJリートマザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	6,068,753,350	98.18
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		112,284,919	1.82
合計（純資産総額）		6,181,038,269	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄（国内不動産投資信託）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	596	765,685	456,348,277	780,000	464,880,000	7.52
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	618	675,066	417,191,220	707,000	436,926,000	7.07
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	1,795	171,939	308,630,666	185,500	332,972,500	5.39
4	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	883	325,184	287,137,798	342,000	301,986,000	4.89
5	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,284	206,030	264,542,751	224,100	287,744,400	4.66
6	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	917	250,390	229,608,491	287,800	263,912,600	4.27
7	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	373	618,115	230,557,047	667,000	248,791,000	4.03
8	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,518	138,428	210,134,235	149,500	226,941,000	3.67
9	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,525	82,320	207,858,404	89,500	225,987,500	3.66
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	1,057	181,756	192,116,546	199,200	210,554,400	3.41
11	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	603	316,625	190,925,110	335,000	202,005,000	3.27
12	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,351	132,828	179,451,886	145,400	196,435,400	3.18
13	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	2,992	61,828	184,991,320	63,400	189,692,800	3.07
14	日本	投資証券	G L P 投資法人	1,436	121,734	174,810,339	131,000	188,116,000	3.04
15	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	364	484,871	176,493,240	485,000	176,540,000	2.86
16	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	179	759,148	135,887,545	813,000	145,527,000	2.35
17	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	847	157,961	133,793,026	164,700	139,500,900	2.26
18	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	497	260,817	129,626,403	280,400	139,358,800	2.25
19	日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,447	18,651	120,242,997	19,550	126,038,850	2.04
20	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	467	255,094	119,129,341	269,800	125,996,600	2.04
21	日本	投資証券	アクティブア・プロパティーズ投資法人	234	488,463	114,300,349	517,000	120,978,000	1.96
22	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	133	782,414	104,061,088	829,000	110,257,000	1.78

23	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	247	390,339	96,413,890	441,500	109,050,500	1.76
24	日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人	954	107,911	102,947,275	111,100	105,989,400	1.71
25	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	468	186,608	87,332,586	188,000	87,984,000	1.42
26	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	516	161,366	83,264,876	167,400	86,378,400	1.40
27	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	389	218,992	85,188,074	212,600	82,701,400	1.34
28	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	386	191,936	74,087,500	202,900	78,319,400	1.27
29	日本	投資証券	プレミアム投資法人	521	139,191	72,518,828	148,900	77,576,900	1.26
30	日本	投資証券	タカラレーベン不動産投資法人	493	129,389	63,789,165	118,900	58,617,700	0.95

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.18
合計	98.18

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

&lt; 参考 &gt;

## 「しんきんグローバルリートマザーファンド」

## (1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	3,866,454,371	73.57
投資証券	カナダ	102,955,065	1.96
投資証券	ドイツ	14,239,397	0.27
投資証券	イタリア	1,156,691	0.02
投資証券	フランス	190,329,152	3.62
投資証券	オランダ	12,969,029	0.25
投資証券	スペイン	35,802,852	0.68
投資証券	ベルギー	53,733,385	1.02
投資証券	アイルランド	13,679,086	0.26
投資証券	イギリス	245,321,808	4.67
投資証券	オーストラリア	359,520,893	6.84
投資証券	ニュージーランド	25,180,121	0.48
投資証券	香港	114,589,015	2.18
投資証券	シンガポール	198,148,702	3.77
投資証券	韓国	411,565	0.01
投資証券	イスラエル	4,595,201	0.09
小計		5,239,086,333	99.69
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		16,154,712	0.31
合計（純資産総額）		5,255,241,045	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 評価額上位30銘柄(外国不動産投資信託)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	24,815	8,399.18	208,425,723	8,912.83	221,171,906	4.21
2	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,157	16,957.09	206,147,436	15,779.50	191,831,396	3.65
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,908	25,972.12	153,443,338	27,918.07	164,939,960	3.14
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	15,943	8,889.33	141,722,678	9,547.33	152,213,127	2.90
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	14,592	8,345.30	121,774,681	8,971.38	130,910,438	2.49
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,492	21,942.51	120,508,274	22,566.32	123,934,263	2.36
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	14,557	7,055.34	102,704,693	7,837.58	114,091,728	2.17
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,209	12,542.56	102,961,913	13,158.45	108,017,765	2.06
9	香港	投資証券	LINK REIT	83,000	1,291.71	107,212,332	1,213.83	100,748,429	1.92
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	12,412	7,549.13	93,699,826	7,870.58	97,689,736	1.86
11	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,581	31,841.26	82,182,301	34,232.21	88,353,342	1.68
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	6,068	13,931.26	84,534,911	13,636.46	82,746,048	1.57
13	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,430	15,382.19	83,525,323	14,350.86	77,925,170	1.48

14	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,459	15,650.06	69,783,656	15,902.99	70,911,454	1.35
15	アメリカ	投資証券	HCP INC	18,772	3,399.02	63,806,543	3,699.48	69,446,732	1.32
16	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	62,941	1,055.31	66,422,677	1,037.19	65,282,040	1.24
17	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,005	11,881.69	59,467,877	12,904.01	64,584,603	1.23
18	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	6,692	8,950.07	59,893,906	9,495.16	63,541,660	1.21
19	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	4,477	12,585.92	56,347,185	13,509.77	60,483,258	1.15
20	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	209,099	283.76	59,334,052	286.32	59,869,226	1.14
21	アメリカ	投資証券	UDR INC	11,140	4,869.81	54,249,771	5,120.72	57,044,888	1.09
22	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	3,542	13,966.05	49,467,750	15,734.78	55,732,619	1.06
23	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,532	13,203.96	46,636,403	14,409.36	50,893,863	0.97
24	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	16,494	2,888.16	47,637,445	3,079.88	50,799,669	0.97
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	14,116	3,385.30	47,786,911	3,545.11	50,042,886	0.95
26	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	29,097	1,879.16	54,678,051	1,701.23	49,500,713	0.94
27	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	6,563	7,014.21	46,034,298	6,859.21	45,017,046	0.86
28	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,797	11,057.52	41,985,413	11,529.61	43,777,960	0.83
29	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	6,817	6,836.87	46,606,978	6,416.34	43,740,218	0.83
30	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	42,968	943.25	40,529,931	1,006.31	43,239,420	0.82

## 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.69
合計	99.69

## 業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件  
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの  
該当事項はありません。

（参考情報）運用実績

データは2019年8月30日現在です。

※下記のグラフ・データは過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

※端数処理の都合上、各欄の合計が合計欄と一致しない場合や、比率の合計が100にならない場合があります。

## ● 基準価額・純資産の推移



### ■ 基準価額・純資産総額

基準価額	10,502円
純資産総額	9,076百万円

### ■ 分配の推移 (税引前)

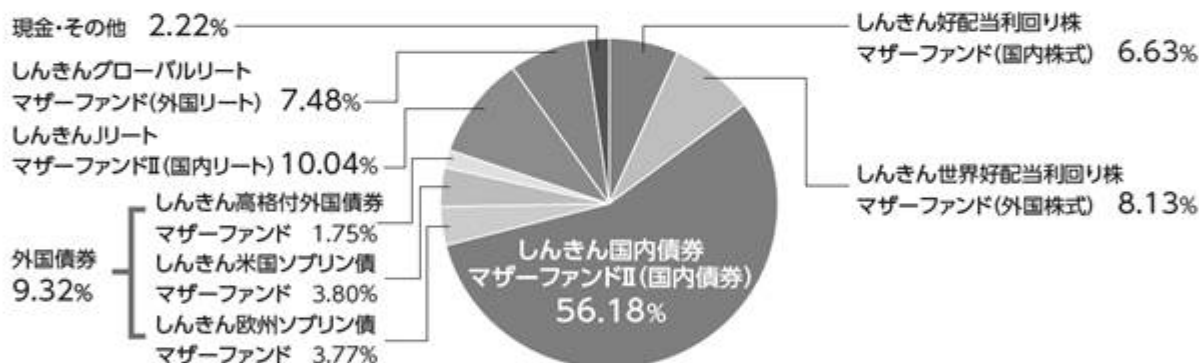
決算期	分配金
2019年 2月	0円
2018年 2月	0円
2017年 2月	0円
-	-
-	-
設定来累計	0円

※基準価額および分配金は1万口当たりです。

※基準価額(分配金再投資後)は決算日の翌営業日に分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

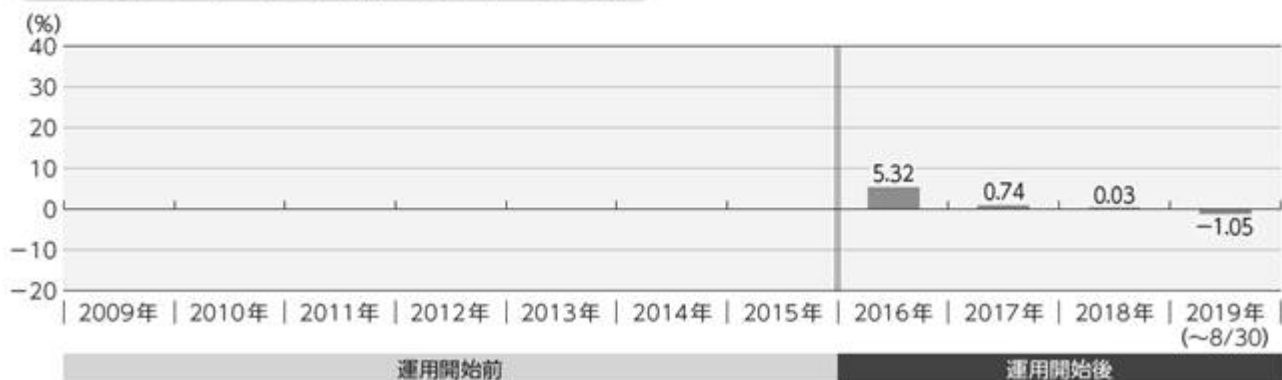
## ● 主要な資産の状況

### ■ 資産別投資比率



※投資比率は、しんきん世界アロケーションファンド(積極型)の純資産総額に対する比率です。

## ● 年間収益率の推移 (期間:2009年～2019年)



※当ファンドはベンチマークを設定していないため、設定日以前の収益率の推移は表示していません。

※2016年2月16日(設定日)から同年最終営業日までの当ファンドの実績収益率を表示しています。

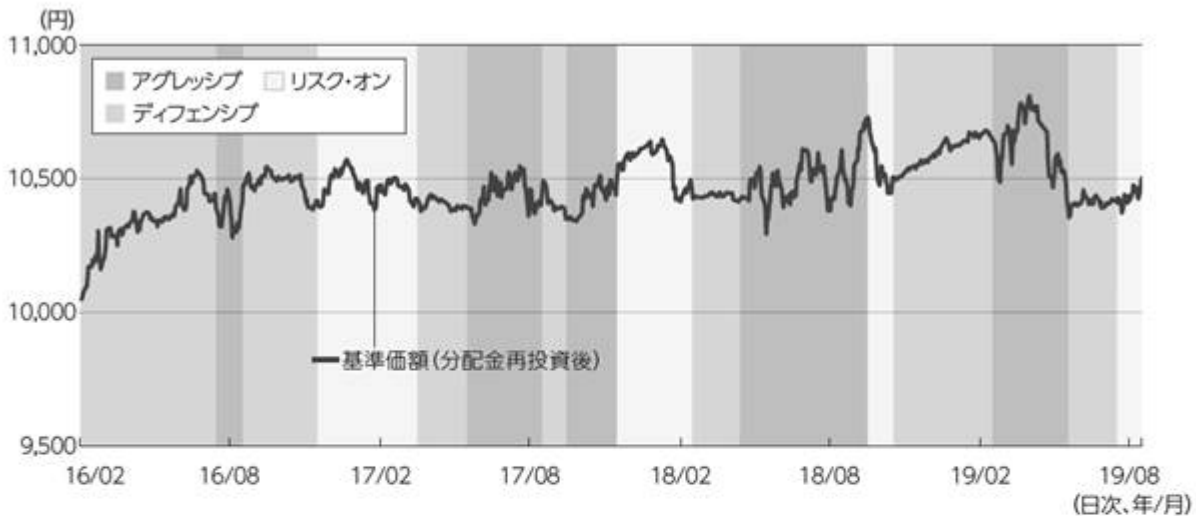
※上記の収益率は決算時の分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

※最新の運用実績はしんきんアセットマネジメント投信(株)のホームページで運用レポートとしてお知らせしています。

## 追加的記載事項

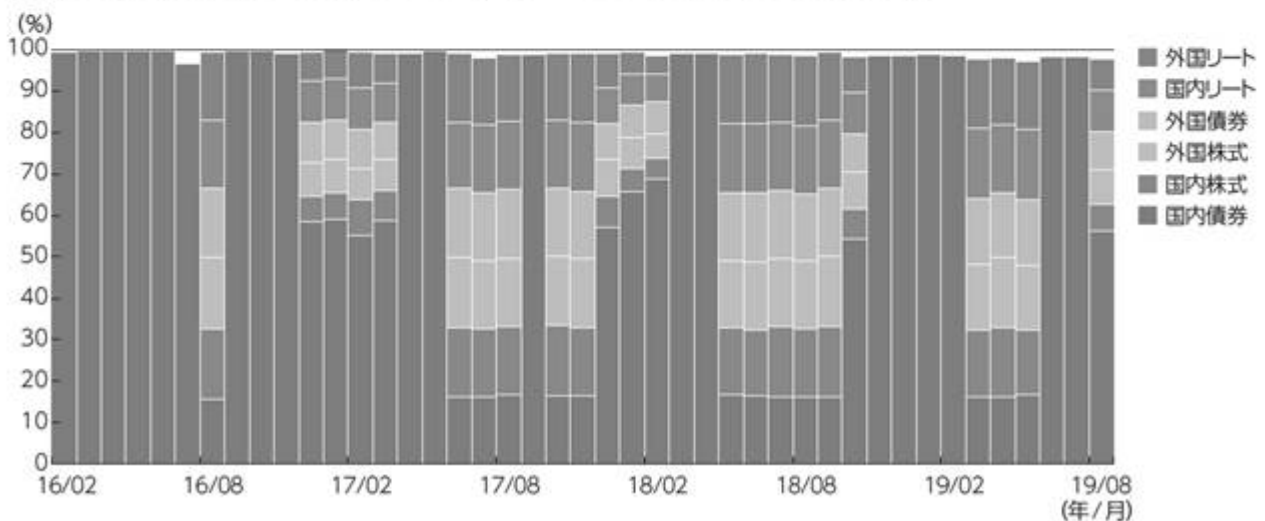
データは2019年8月30日現在です。

### ■ 基準価額と資産別配分（アロケーション）の変遷



※上記の「アグレッシブ（6つの資産にバランスよく分散投資）」、「リスク・オン（6つの資産にリスクを考慮した分散投資）」および「ディフェンシブ（国内債券中心）」は、当ファンドの運用のイメージを説明するための表現であり、具体的な投資戦略・運用方針を意味するものではありません。

### ■ 設定来の資産別投資比率の推移（2016年2月～2019年8月まで。各月末基準）



※各月末時点におけるマザーファンドの組入割合。(外国債券は3ファンドの合計)

## 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの状況は以下のとおりです。

※一部のマザーファンドの投資比率をゼロとする場合があります。

### ■各マザーファンドの組入上位10銘柄

※投資比率は各マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

	国内株式			外国株式			
	しんきん好配当利回り株マザーファンド			しんきん世界好配当利回り株マザーファンド			
	銘柄名	業種	投資比率	銘柄名	国・地域	業種	投資比率
1	野村ホールディングス	証券、 商品先物取引業	1.25%	SANOFI	フランス	医薬品・バイオ テクノロジー・ ライフサイエンス	4.82%
2	SUBARU	輸送用機器	1.24%	STANDARD CHARTERED PLC	イギリス	銀行	4.63%
3	東京エレクトロン	電気機器	1.23%	INTEL CORP	アメリカ	半導体・ 半導体製造装置	4.55%
4	大塚ホールディングス	医薬品	1.22%	ENI SPA	イタリア	エネルギー	4.41%
5	スター精密	機械	1.21%	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	ソフトウェア・ サービス	4.34%
6	LIXILグループ	金属製品	1.19%	PEARSON PLC	イギリス	メディア・娯楽	4.25%
7	ヤマダ電機	小売業	1.19%	ANGLO AMERICAN PLC	イギリス	素材	4.14%
8	トレンドマイクロ	情報・通信業	1.19%	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	銀行	4.11%
9	マクセルホールディングス	電気機器	1.17%	AGEAS	ベルギー	保険	3.98%
10	野村不動産 ホールディングス	不動産業	1.16%	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	アメリカ	保険	3.94%

	国内債券				外国債券			
	しんきん国内債券マザーファンドII				しんきん欧州ソブリン債マザーファンド			
	銘柄名	利率	満期日	投資 比率	銘柄名	利率	満期日	投資 比率
1	第354回利付国債(10年)	0.1%	2029/03/20	3.78%	フランス国債	5.75%	2032/10/25	4.63%
2	第313回利付国債(10年)	1.3%	2021/03/20	3.73%	フランス国債	4.00%	2038/10/25	4.52%
3	第160回利付国債(20年)	0.7%	2037/03/20	3.07%	スペイン国債	2.35%	2033/07/30	4.10%
4	第319回利付国債(10年)	1.1%	2021/12/20	2.82%	ベルギー国債	5.00%	2035/03/28	4.07%
5	第168回利付国債(20年)	0.4%	2039/03/20	2.44%	ドイツ国債	4.00%	2037/01/04	3.45%
6	第314回利付国債(10年)	1.1%	2021/03/20	2.33%	フランス国債	2.75%	2027/10/25	3.28%
7	第312回利付国債(10年)	1.2%	2020/12/20	2.32%	スペイン国債	4.20%	2037/01/31	3.22%
8	第164回利付国債(20年)	0.5%	2038/03/20	2.23%	スペイン国債	3.80%	2024/04/30	3.08%
9	第350回利付国債(10年)	0.1%	2028/03/20	1.89%	スペイン国債	1.95%	2026/04/30	2.83%
10	第352回利付国債(10年)	0.1%	2028/09/20	1.89%	フランス国債	2.50%	2030/05/25	2.62%



外国債券								
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			
	銘柄名	利率	満期日	投資比率	銘柄名	利率	満期日	投資比率
1	アメリカ国債	1.625%	2022/08/15	4.40%	ノルウェー国債	3.00%	2024/03/14	20.33%
2	アメリカ国債	2.625%	2020/11/15	4.26%	オーストラリア国債	2.75%	2024/04/21	16.90%
3	アメリカ国債	1.750%	2022/05/15	4.08%	イギリス国債	5.00%	2025/03/07	15.42%
4	アメリカ国債	3.625%	2021/02/15	4.07%	カナダ国債	2.25%	2025/06/01	11.07%
5	アメリカ国債	3.625%	2044/02/15	3.92%	カナダ国債	1.50%	2026/06/01	9.94%
6	アメリカ国債	2.750%	2024/02/15	3.92%	イギリス国債	1.50%	2026/07/22	8.86%
7	アメリカ国債	2.750%	2023/11/15	3.91%	オーストラリア国債	3.25%	2025/04/21	7.34%
8	アメリカ国債	4.375%	2040/05/15	3.64%	カナダ政府機関債	2.55%	2023/12/15	3.76%
9	アメリカ国債	3.125%	2042/02/15	3.61%	ノルウェー国債	1.50%	2026/02/19	3.12%
10	アメリカ国債	3.125%	2048/05/15	3.59%				

国内不動産投資信託			外国不動産投資信託		
しんきんJリートマザーファンドII			しんきんグローバルリートマザーファンド		
	銘柄名	投資比率	銘柄名	国・地域	投資比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.52%	PROLOGIS INC	アメリカ	4.21%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	7.07%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.65%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.39%	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.14%
4	アドバンス・レジデンス投資法人	4.89%	WELLTOWER INC	アメリカ	2.90%
5	オリックス不動産投資法人	4.66%	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.49%
6	日本プロロジスリート投資法人	4.27%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.36%
7	日本アコモデーションファンド投資法人	4.03%	VENTAS INC	アメリカ	2.17%
8	産業ファンド投資法人	3.67%	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.06%
9	積水ハウス・リート投資法人	3.66%	LINK REIT	香港	1.92%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	3.41%	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.86%

## 第2【管理及び運営】

### 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、販売会社が定める単位です。
- (4) 申込みに係る受益権の価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、1.65%（税抜1.5%）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時までに受け付けた取得の申込みを、当日の申込受付分として取り扱います。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け付けません。ただし、「自動けいぞく投資約款」に従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係る追加信託の申込みに限ってこれを受け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、取得申込みの受け付けを中止することができます。取得申込みの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振替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、振替法の規定に従い、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、委託会社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）

<コールセンター> 0120-781812

携帯電話・PHSからは 03-5524-8181（受付時間：営業日の9:00～17:00）

<ホームページ> <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時までに受け付けた換金（解約）の申込みを、当日の申込受付分として取り扱います。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）の申込みを受け付けません。
- (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0.3%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 第1 ファンドの状況」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) 一部解約金に係る収益調整金（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。
- (11) 換金の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、振替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が行われます。

（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。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の計算方法

- ・基準価額は、委託会社によって毎営業日算出されます。
- ・基準価額とは、投資信託財産に属する資産を法令および一般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。
- ・基準価額(受益権1口当りの純資産額を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。

##### ファンドの主要な投資対象資産の評価方法

- ・「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「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」、「しんきんJリートマザーファンド」および「しんきんグローバルリートマザーファンド」の受益証券は、原則として計算日の基準価額で評価します。
- ・外貨建資産の円換算については、原則として我が国における当日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、我が国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

## (2)【保管】

該当事項はありません。

## (3)【信託期間】

信託期間は2028年2月14日までとします。ただし、後記「(5)その他」の「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。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

## (4)【計算期間】

この信託の計算期間は、原則として毎年2月15日から翌年2月14日までとします。

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、該当日の翌営業日とし、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、約款に定める信託期間の終了日とします。

## (5)【その他】

ファンドの繰上償還条項

- 1) 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、信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が3億口を下回ることとなった場合、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。
- 2) 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。
- 3) 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投資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、この信託契約に係る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。
- 4) 第2項の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

- 5) 第2項から前項までの規定は、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全ての受益者が書面また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。また、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、第2項から前項までの手続きを行うことが困難な場合も同じとします。
- 6) 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、その命令に従い、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- 7) 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委託会社に引き継ぐことを命じたときは、約款の変更の書面決議で否決された場合を除き、当該委託会社と受託会社との間において存続します。
- 8) 受託会社は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。

#### 約款の変更

- 1) 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。
- 2) 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、前項の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「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。
- 3) 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見なします。
- 4) 2)の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- 5) 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。
- 6) 2)から5)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、この約款に係るすべての受益者が書面また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。
- 7) 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にあつても、当該併合に係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。

### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

### 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か月前までに当事者のいずれからとも、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。

### 投資顧問会社との契約更改等

委託会社と投資顧問会社との間で締結される運用一任契約の有効期間は、信託の終了日までとしますが、契約期間中でも3か月前までに書面をもって解約の予告をすることにより契約を解約することができます。契約の変更等を行った場合には、運用報告書、有価証券報告書等においてお知らせします。

### 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に基づき、毎計算期間の末日（原則2月14日）および償還日を基準に交付運用報告書を作成し、投資信託財産に係る知られたる受益者に、販売会社を通じて交付します。

### 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。

## 4【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

収益分配金は、毎計算期間終了日後1か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（当該収益分配金に係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係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係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ます。）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係る受益権の取得の申込みに応じるものとし、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。

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係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。

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

受益者は、ファンドに係る償還金を持分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1か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て扱います。)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き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、振替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。

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。

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、前記「第2 管理及び運営」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係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3【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)並びに同規則第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)に基づいて作成しております。  
なお、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. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成30年2月15日から平成31年2月14日まで)の財務諸表について、PwCあらた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】

## 【しんきん世界アロケーションファンド（積極型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前期 (平成30年2月14日現在)	当期 (平成31年2月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	173,713,735	200,769,536
親投資信託受益証券	7,802,033,408	8,759,642,532
流動資産合計	7,975,747,143	8,960,412,068
資産合計	7,975,747,143	8,960,412,068
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	12,764,147	10,326,052
未払受託者報酬	2,027,774	2,390,816
未払委託者報酬	40,555,478	47,816,298
未払利息	423	495
その他未払費用	353	8,075
流動負債合計	55,348,175	60,541,736
負債合計	55,348,175	60,541,736
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1, 2 7,606,232,025	1, 2 8,352,967,222
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	314,166,943	546,903,110
（分配準備積立金）	77,804,925	192,376,979
元本等合計	7,920,398,968	8,899,870,332
純資産合計	7,920,398,968	8,899,870,332
負債純資産合計	7,975,747,143	8,960,412,068

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前期 (自 平成29年 2月15日 至 平成30年 2月14日)	当期 (自 平成30年 2月15日 至 平成31年 2月14日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	44,442,306	295,360,642
<b>営業収益合計</b>	<b>44,442,306</b>	<b>295,360,642</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	62,881	94,778
受託者報酬	3,496,822	4,612,486
委託者報酬	1 69,936,375	1 92,249,658
その他費用	3,259	42,635
<b>営業費用合計</b>	<b>73,499,337</b>	<b>96,999,557</b>
営業利益又は営業損失( )	29,057,031	198,361,085
経常利益又は経常損失( )	29,057,031	198,361,085
当期純利益又は当期純損失( )	29,057,031	198,361,085
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	3,583,377	16,497,822
期首剰余金又は期首欠損金( )	191,300,141	314,166,943
剰余金増加額又は欠損金減少額	192,829,439	104,449,240
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	192,829,439	104,449,240
剰余金減少額又は欠損金増加額	37,322,229	53,576,336
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	37,322,229	53,576,336
分配金	2 -	2 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	314,166,943	546,903,110

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

区分	前期 (平成30年2月14日現在)	当期 (平成31年2月14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 4,251,274,050円 期中追加設定元本額 4,212,469,981円 期中一部解約元本額 857,512,006円	期首元本額 7,606,232,025円 期中追加設定元本額 2,044,421,758円 期中一部解約元本額 1,297,686,561円
2 計算期間末日における受益権の総数	7,606,232,025口	8,352,967,222口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自平成29年2月15日 至平成30年2月14日)	当期 (自平成30年2月15日 至平成31年2月14日)
<p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。 「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。</p>	<p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>同左</p>
<p>2 分配金の計算過程</p> <p>A 費用控除後の配当等収益額 34,361,859円</p> <p>B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額 0円</p> <p>C 収益調整金額 236,362,018円</p> <p>D 分配準備積立金額 43,443,066円</p> <p>E 当ファンドの分配対象収益額 314,166,943円</p> <p>F 当ファンドの期末残存口数 7,606,232,025口</p> <p>G 10,000口当たり収益分配対象額 413円</p> <p>H 10,000口当たり分配金額 0円</p> <p>I 収益分配金金額 0円</p>	<p>2 分配金の計算過程</p> <p>A 費用控除後の配当等収益額 113,073,305円</p> <p>B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券等損益額 11,611,420円</p> <p>C 収益調整金額 354,526,131円</p> <p>D 分配準備積立金額 67,692,254円</p> <p>E 当ファンドの分配対象収益額 546,903,110円</p> <p>F 当ファンドの期末残存口数 8,352,967,222口</p> <p>G 10,000口当たり収益分配対象額 654円</p> <p>H 10,000口当たり分配金額 0円</p> <p>I 収益分配金金額 0円</p>

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

区分	前期 (自 平成29年 2月15日 至 平成30年 2月14日)	当期 (自 平成30年 2月15日 至 平成31年 2月14日)
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を、信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析及び法令遵守の観点から運用状況を監視しております。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としております。原則月1回開催するコンプライアンス・運用管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しております。	同左

## 2．金融商品の時価等に関する事項

区分	前期 (平成30年 2月14日現在)	当期 (平成31年 2月14日現在)
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

	前期 (平成30年2月14日現在)	当期 (平成31年2月14日現在)
種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	47,513,229円	161,257,054円
合計	47,513,229円	161,257,054円

## (デリバティブ取引等に関する注記)

前期 (平成30年2月14日現在)	当期 (平成31年2月14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)

前期 (自平成29年2月15日 至平成30年2月14日)	当期 (自平成30年2月15日 至平成31年2月14日)
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

前期 (平成30年2月14日現在)	当期 (平成31年2月14日現在)
1口当たり純資産額 1.0413円 (1万口当たり純資産額 10,413円)	1口当たり純資産額 1.0655円 (1万口当たり純資産額 10,655円)

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	しんきん国内債券マザーファンド	6,636,092,828	8,759,642,532	
親投資信託受益証券 合計		6,636,092,828	8,759,642,532	
合計		6,636,092,828	8,759,642,532	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
注記表(デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。

## （参考情報）

当ファンドは、「しんきん国内債券マザーファンド」受益証券を主要な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あります。

なお、同親投資信託の状況は次のとおりであります。

「しんきん国内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あります。

## 財務諸表

## しんきん国内債券マザーファンド

## （1）貸借対照表

区分		平成30年2月14日現在	平成31年2月14日現在
科目	注記番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		260,164,147	152,698,438
国債証券		25,569,150,700	34,988,252,500
地方債証券		1,037,119,000	1,662,267,000
特殊債券		420,469,000	1,142,223,000
社債券		503,207,000	908,078,000
未収利息		35,783,933	70,238,259
前払費用		7,994,509	30,808,173
流動資産合計		27,833,888,289	38,954,565,370
資産合計		27,833,888,289	38,954,565,370
負債の部			
流動負債			
未払解約金		-	100,000,000
未払利息		634	376
その他未払費用		717	5,229
流動負債合計		1,351	100,005,605
負債合計		1,351	100,005,605
純資産の部			
元本等			
元本	1, 2	21,421,912,245	29,436,175,876
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		6,411,974,693	9,418,383,889
元本等合計		27,833,886,938	38,854,559,765
純資産合計		27,833,886,938	38,854,559,765
負債純資産合計		27,833,888,289	38,954,565,370

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。
-----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区分	平成30年2月14日現在	平成31年2月14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 11,571,639,845円	期首元本額 21,421,912,245円
	期中追加設定元本額 30,952,740,049円	期中追加設定元本額 34,952,993,604円
	期中一部解約元本額 21,102,467,649円	期中一部解約元本額 26,938,729,973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） 1,911,385,961円 しんきん世界アロケーションファンド 12,575,647,485円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 4,204,325,589円 しんきん国内債券スペシャル（適格機関投資家限定） 1,153,733,568円 SKAM世界アロケーション安定型（年金）（適格機関投資家限定） 1,576,819,642円 合計 21,421,912,245円	しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,877,480,341円 しんきん世界アロケーションファンド 17,517,077,121円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 6,636,092,828円 しんきん国内債券スペシャル（適格機関投資家限定） 1,149,900,975円 SKAM世界アロケーション安定型（年金）（適格機関投資家限定） 2,255,624,611円 合計 29,436,175,876円
2 本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日における受益権の総数	21,421,912,245口	29,436,175,876口



## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年 2月15日 至 平成30年 2月14日	自 平成30年 2月15日 至 平成31年 2月14日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を、信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2．金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析及び法令遵守の観点から運用状況を監視しております。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としております。原則月1回開催するコンプライアンス・運用管理委員会への報告を通じて、運用部門にファンドのリスクとリターンの計測・分析結果等がフィードバックされ、適切なリスクの管理体制を構築しております。	同左

## 2．金融商品の時価等に関する事項

区分	平成30年 2月14日現在	平成31年 2月14日現在
1．貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

（有価証券に関する注記）  
売買目的有価証券

	平成30年2月14日現在	平成31年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	5,727,400円	314,058,500円
地方債証券	3,902,000円	10,313,000円
特殊債券	1,596,000円	1,881,000円
社債券	2,651,000円	756,000円
合計	13,876,400円	325,496,500円

（注）当期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までの期間に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

平成30年2月14日現在	平成31年2月14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29年2月15日 至 平成30年2月14日	自 平成30年2月15日 至 平成31年2月14日
該当事項はありません。	同左

（1口当たり情報）

平成30年2月14日現在	平成31年2月14日現在
1口当たり純資産額 1.2993円 (1万口当たり純資産額 12,993円)	1口当たり純資産額 1.3200円 (1万口当たり純資産額 13,200円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第385回利付国債(2年)	100,000,000	100,290,000	
国債証券	第386回利付国債(2年)	400,000,000	401,208,000	
国債証券	第395回利付国債(2年)	700,000,000	703,395,000	
国債証券	第123回利付国債(5年)	400,000,000	401,220,000	
国債証券	第127回利付国債(5年)	400,000,000	402,264,000	
国債証券	第129回利付国債(5年)	500,000,000	503,515,000	
国債証券	第130回利付国債(5年)	100,000,000	100,771,000	
国債証券	第131回利付国債(5年)	300,000,000	302,514,000	
国債証券	第132回利付国債(5年)	200,000,000	201,814,000	
国債証券	第134回利付国債(5年)	200,000,000	202,128,000	
国債証券	第306回利付国債(10年)	700,000,000	712,040,000	
国債証券	第307回利付国債(10年)	700,000,000	711,277,000	
国債証券	第308回利付国債(10年)	700,000,000	713,888,000	
国債証券	第309回利付国債(10年)	700,000,000	712,005,000	
国債証券	第312回利付国債(10年)	700,000,000	717,731,000	
国債証券	第314回利付国債(10年)	700,000,000	718,648,000	
国債証券	第316回利付国債(10年)	700,000,000	720,902,000	
国債証券	第317回利付国債(10年)	700,000,000	723,163,000	
国債証券	第318回利付国債(10年)	700,000,000	721,343,000	
国債証券	第320回利付国債(10年)	200,000,000	206,686,000	
国債証券	第323回利付国債(10年)	600,000,000	621,576,000	
国債証券	第324回利付国債(10年)	500,000,000	516,300,000	
国債証券	第326回利付国債(10年)	200,000,000	206,732,000	
国債証券	第333回利付国債(10年)	400,000,000	415,812,000	
国債証券	第339回利付国債(10年)	100,000,000	103,621,000	
国債証券	第341回利付国債(10年)	100,000,000	103,218,000	
国債証券	第342回利付国債(10年)	200,000,000	203,802,000	
国債証券	第343回利付国債(10年)	200,000,000	203,862,000	
国債証券	第345回利付国債(10年)	100,000,000	101,903,000	
国債証券	第346回利付国債(10年)	100,000,000	101,880,000	
国債証券	第348回利付国債(10年)	300,000,000	305,199,000	
国債証券	第349回利付国債(10年)	500,000,000	508,240,000	
国債証券	第350回利付国債(10年)	600,000,000	609,048,000	
国債証券	第351回利付国債(10年)	600,000,000	608,442,000	
国債証券	第352回利付国債(10年)	600,000,000	607,500,000	
国債証券	第17回利付国債(30年)	300,000,000	399,210,000	
国債証券	第22回利付国債(30年)	100,000,000	136,208,000	

国債証券	第25回利付国債(30年)	500,000,000	668,235,000	
国債証券	第31回利付国債(30年)	200,000,000	268,496,000	
国債証券	第33回利付国債(30年)	300,000,000	393,456,000	
国債証券	第35回利付国債(30年)	300,000,000	395,772,000	
国債証券	第37回利付国債(30年)	200,000,000	261,298,000	
国債証券	第38回利付国債(30年)	100,000,000	128,781,000	
国債証券	第40回利付国債(30年)	200,000,000	258,072,000	
国債証券	第43回利付国債(30年)	400,000,000	508,532,000	
国債証券	第47回利付国債(30年)	400,000,000	501,248,000	
国債証券	第49回利付国債(30年)	100,000,000	120,587,000	
国債証券	第50回利付国債(30年)	100,000,000	105,645,000	
国債証券	第51回利付国債(30年)	100,000,000	92,953,000	
国債証券	第52回利付国債(30年)	100,000,000	97,864,000	
国債証券	第53回利付国債(30年)	100,000,000	100,359,000	
国債証券	第55回利付国債(30年)	500,000,000	526,775,000	
国債証券	第57回利付国債(30年)	200,000,000	210,352,000	
国債証券	第59回利付国債(30年)	300,000,000	307,101,000	
国債証券	第60回利付国債(30年)	300,000,000	323,022,000	
国債証券	第61回利付国債(30年)	150,000,000	153,214,500	
国債証券	第52回利付国債(20年)	700,000,000	741,447,000	
国債証券	第61回利付国債(20年)	700,000,000	733,579,000	
国債証券	第62回利付国債(20年)	700,000,000	729,540,000	
国債証券	第65回利付国債(20年)	200,000,000	220,166,000	
国債証券	第99回利付国債(20年)	600,000,000	716,496,000	
国債証券	第101回利付国債(20年)	600,000,000	734,910,000	
国債証券	第104回利付国債(20年)	600,000,000	720,744,000	
国債証券	第105回利付国債(20年)	600,000,000	722,970,000	
国債証券	第114回利付国債(20年)	400,000,000	489,492,000	
国債証券	第120回利付国債(20年)	100,000,000	117,481,000	
国債証券	第122回利付国債(20年)	100,000,000	120,035,000	
国債証券	第124回利付国債(20年)	400,000,000	490,680,000	
国債証券	第125回利付国債(20年)	100,000,000	125,386,000	
国債証券	第131回利付国債(20年)	100,000,000	119,826,000	
国債証券	第133回利付国債(20年)	500,000,000	606,630,000	
国債証券	第135回利付国債(20年)	100,000,000	120,285,000	
国債証券	第137回利付国債(20年)	100,000,000	120,432,000	
国債証券	第140回利付国債(20年)	100,000,000	120,650,000	
国債証券	第142回利付国債(20年)	500,000,000	611,055,000	
国債証券	第144回利付国債(20年)	200,000,000	236,602,000	
国債証券	第146回利付国債(20年)	600,000,000	728,658,000	
国債証券	第147回利付国債(20年)	150,000,000	180,273,000	
国債証券	第148回利付国債(20年)	400,000,000	475,472,000	
国債証券	第151回利付国債(20年)	400,000,000	457,912,000	

国債証券	第152回利付国債(20年)	200,000,000	229,034,000	
国債証券	第155回利付国債(20年)	600,000,000	667,872,000	
国債証券	第156回利付国債(20年)	200,000,000	202,592,000	
国債証券	第158回利付国債(20年)	200,000,000	205,482,000	
国債証券	第159回利付国債(20年)	100,000,000	104,286,000	
国債証券	第160回利付国債(20年)	600,000,000	635,724,000	
国債証券	第161回利付国債(20年)	200,000,000	208,080,000	
国債証券	第162回利付国債(20年)	100,000,000	103,911,000	
国債証券	第163回利付国債(20年)	600,000,000	622,662,000	
国債証券	第166回利付国債(20年)	300,000,000	315,492,000	
国債証券	第167回利付国債(20年)	100,000,000	101,279,000	
国債証券 合計		32,000,000,000	34,988,252,500	
地方債証券	第8回東京都公募公債(7年)	100,000,000	100,801,000	
地方債証券	第24回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,936,000	
地方債証券	第719回東京都公募公債	100,000,000	103,456,000	
地方債証券	第729回東京都公募公債	100,000,000	103,459,000	
地方債証券	平成23年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	120,887,000	
地方債証券	平成29年度第16回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,250,000	
地方債証券	平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	103,154,000	
地方債証券	平成28年度第3回埼玉県公募公債	300,000,000	301,524,000	
地方債証券	平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,214,000	
地方債証券	第496回名古屋市公募公債(10年)	200,000,000	200,880,000	
地方債証券	平成28年度第4回福井県公募公債	200,000,000	202,706,000	
地方債証券 合計		1,600,000,000	1,662,267,000	
特殊債券	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	211,680,000	
特殊債券	第75回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,360,000	
特殊債券	第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	202,906,000	
特殊債券	第28回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,700,000	
特殊債券	第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	103,253,000	
特殊債券	第33回政府保証日本政策金融公庫債券	400,000,000	401,324,000	
特殊債券 合計		1,100,000,000	1,142,223,000	
社債券	第13回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,325,000	
社債券	第6回ヒューリック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,560,000	
社債券	第14回株式会社オリエンタルランド無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,123,000	
社債券	第53回日本電気株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	99,886,000	
社債券	第15回株式会社デンソー無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,000,000	
社債券	第51回三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	100,000,000	100,194,000	

社債券	第23回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,334,000	
社債券	第100回住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	200,000,000	205,656,000	
社債券 合計		900,000,000	908,078,000	
合計		35,600,000,000	38,700,820,500	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
注記表(デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。

## 【中間財務諸表】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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）に基づいて作成しております。

なお、中間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. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2019年2月15日から2019年8月14日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

しんきん世界アロケーションファンド（積極型）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前計算期間末 (2019年2月14日現在)	当中間計算期間末 (2019年8月14日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	200,769,536	226,389,436
親投資信託受益証券	8,759,642,532	8,813,554,620
流動資産合計	8,960,412,068	9,039,944,056
資産合計	8,960,412,068	9,039,944,056
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	10,326,052	256,080
未払受託者報酬	2,390,816	2,370,322
未払委託者報酬	47,816,298	47,406,435
未払利息	495	651
その他未払費用	8,075	8,572
流動負債合計	60,541,736	50,042,060
負債合計	60,541,736	50,042,060
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1, 2 8,352,967,222	1, 2 8,614,332,395
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	546,903,110	375,569,601
（分配準備積立金）	192,376,979	174,484,569
元本等合計	8,899,870,332	8,989,901,996
純資産合計	8,899,870,332	8,989,901,996
負債純資産合計	8,960,412,068	9,039,944,056



## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前中間計算期間 (自 2018年 2月15日 至 2018年 8月14日)	当中間計算期間 (自 2019年 2月15日 至 2019年 8月14日)
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	36,208,300	130,222,646
<b>営業収益合計</b>	<b>36,208,300</b>	<b>130,222,646</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	41,160	77,333
受託者報酬	2,221,670	2,370,322
委託者報酬	1 44,433,360	1 47,406,435
その他費用	11,795	25,096
<b>営業費用合計</b>	<b>46,707,985</b>	<b>49,879,186</b>
営業利益又は営業損失( )	10,499,685	180,101,832
経常利益又は経常損失( )	10,499,685	180,101,832
中間純利益又は中間純損失( )	10,499,685	180,101,832
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	3,192,996	2,157,705
期首剰余金又は期首欠損金( )	314,166,943	546,903,110
剰余金増加額又は欠損金減少額	53,096,582	64,383,331
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	53,096,582	64,383,331
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,647,047	57,772,713
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	19,647,047	57,772,713
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	333,923,797	375,569,601

## (3)【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
-----------------	---

## (中間貸借対照表に関する注記)

区分	前計算期間末 (2019年2月14日現在)	当中間計算期間末 (2019年8月14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 7,606,232,025円 期中追加設定元本額 2,044,421,758円 期中一部解約元本額 1,297,686,561円	期首元本額 8,352,967,222円 期中追加設定元本額 1,178,942,022円 期中一部解約元本額 917,576,849円
2 中間計算期間末における受益権の総数	8,352,967,222口	8,614,332,395口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 (自 2018年2月15日 至 2018年8月14日)	当中間計算期間 (自 2019年2月15日 至 2019年8月14日)
<p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。</p> <p>「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。</p>	<p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>同左</p>

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	前計算期間末 (2019年2月14日現在)	当中間計算期間末 (2019年8月14日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (デリバティブ取引等に関する注記)

前計算期間末 (2019年2月14日現在)	当中間計算期間末 (2019年8月14日現在)
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

前計算期間末 (2019年2月14日現在)	当中間計算期間末 (2019年8月14日現在)
1口当たり純資産額 1.0655円 (1万口当たり純資産額 10,655円)	1口当たり純資産額 1.0436円 (1万口当たり純資産額 10,436円)

## （参考情報）

当ファンドは、「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「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」、「しんきんJリートマザーファンド」及び「しんきんグローバルリートマザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間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あります。

なお、同親投資信託の状況は次のとおりであります。

「しんきん好配当利回り株マザーファンド」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あります。

## 財務諸表

## しんきん好配当利回り株マザーファンド

## （1）貸借対照表

区分		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		200,241,965	311,399,990
株式		25,390,680,460	27,615,225,750
未収配当金		68,099,200	107,629,900
流動資産合計		25,659,021,625	28,034,255,640
資産合計		25,659,021,625	28,034,255,640
負債の部			
流動負債			
未払金			154,218,900
未払利息		493	895
その他未払費用		9,647	17,930
流動負債合計		10,140	154,237,725
負債合計		10,140	154,237,725
純資産の部			
元本等			
元本	1, 2	12,526,373,571	14,802,639,233
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		13,132,637,914	13,077,378,682
元本等合計		25,659,011,485	27,880,017,915
純資産合計		25,659,011,485	27,880,017,915
負債純資産合計		25,659,021,625	28,034,255,640

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
-----------------	--

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	期首元本額
	11,027,422,283円	12,526,373,571円
元本の内訳	期中追加設定元本額	期中追加設定元本額
	4,463,308,706円	4,005,092,153円
	期中一部解約元本額	期中一部解約元本額
	2,964,357,418円	1,728,826,491円
	しんきん3資産ファンド(毎月決算型)	しんきん3資産ファンド(毎月決算型)
	9,054,724,600円	10,120,915,084円
	しんきん好配当利回り株ファンド(3ヵ月決算型)	しんきん好配当利回り株ファンド(3ヵ月決算型)
	1,648,216,579円	1,702,139,234円
	しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型)	しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型)
	1,245,518,434円	1,413,403,224円
	_____	しんきん世界アロケーションファンド
	_____	766,514,334円
	_____	しんきん世界アロケーションファンド(積極型)
	_____	315,745,742円
	しんきん好配当利回り株スペシャル(適格機関投資家限定)	しんきん好配当利回り株スペシャル(適格機関投資家限定)
	577,913,958円	375,965,653円
	_____	S K A M世界アロケーション安定型(年金)(適格機関投資家限定)
	_____	107,955,962円
	合計 12,526,373,571円	合計 14,802,639,233円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	12,526,373,571口	14,802,639,233口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （デリバティブ取引等に関する注記）

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありませぬ。	同左

## （1口当たり情報）

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 2.0484円 (1万口当たり純資産額 20,484円)	1口当たり純資産額 1.8834円 (1万口当たり純資産額 18,834円)

「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」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あります。

## 財務諸表

## しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記 番号	金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>			
流動資産			
預金		679,690,518	871,578,579
コール・ローン		201,628,912	473,566,002
株式		15,553,459,611	17,377,494,514
派生商品評価勘定			1,868
未収入金			111,195
未収配当金		10,550,573	32,382,621
流動資産合計		16,445,329,614	18,755,134,779
資産合計		16,445,329,614	18,755,134,779
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定			111,828
未払金			47,176,752
未払利息		497	1,362
その他未払費用		8,373	16,848
流動負債合計		8,870	47,306,790
負債合計		8,870	47,306,790
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1, 2	7,472,421,419	9,134,832,011
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		8,972,899,325	9,572,995,978
元本等合計		16,445,320,744	18,707,827,989
純資産合計		16,445,320,744	18,707,827,989
負債純資産合計		16,445,329,614	18,755,134,779

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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における開示対象ファンドの中間計算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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	<p>期首元本額 6,480,030,762円</p> <p>期中追加設定元本額 3,716,830,054円</p> <p>期中一部解約元本額 2,724,439,397円</p>	<p>期首元本額 7,472,421,419円</p> <p>期中追加設定元本額 3,414,050,811円</p> <p>期中一部解約元本額 1,751,640,219円</p>
元本の内訳	<p>しんきん世界好配当利回り株ファンド（毎月決算型） 6,261,804,139円</p> <p>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,178,809,895円</p> <p>_____</p> <p>_____</p> <p>しんきん世界好配当利回り株ファンド（1年決算型） 31,807,385円</p> <p>_____</p>	<p>しんきん世界好配当利回り株ファンド（毎月決算型） 6,375,123,244円</p> <p>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,312,215,618円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 882,407,753円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 362,467,388円</p> <p>しんきん世界好配当利回り株ファンド（1年決算型） 79,462,957円</p> <p>S K A M世界アロケーション安定型（年金）（適格機関投資家限定） 123,155,051円</p>
	合計 7,472,421,419円	合計 9,134,832,011円



2 本報告書における開示 対象ファンドの中間計 算期間末日における受 益権の総数	7,472,421,419口	9,134,832,011口
---	----------------	----------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時 価及びその差額	時価で計上しているため、その差 額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に 関する注記）に記載しておりま す。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品は、短期間で 決済され、時価は帳簿価額と近 似していることから、当該金融 商品の帳簿価額を時価としてお ります。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する 注記）に記載しております。  (3)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関 する事項についての補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に 基づく価額のほか、市場価格がない 場合には合理的に算定された価額が 含まれております。当該価額の算定 においては一定の前提条件等を採用 しているため、異なる前提条件等 によった場合、当該価額が異なるこ ともあります。	金融商品の時価には、市場価格に 基づく価額のほか、市場価格がない 場合には合理的に算定された価額が 含まれております。当該価額の算定 においては一定の前提条件等を採用 しているため、異なる前提条件等 によった場合、当該価額が異なるこ ともあります。また、デリバティブ取 引に関する契約額等はあくまでもデ リバティブ取引における名目的な契 約額であり、当該金額自体がデリバ ティブ取引のリスクの大きさを示す ものではありません。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## (通貨関連)

2019年 2月14日現在
該当事項はありません。

2019年 8月14日現在					
区分	種類	契約額（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	296,464,846		296,353,018	111,828
	米ドル	276,588,000		276,510,000	78,000
	英ポンド	19,876,846		19,843,018	33,828
	売建	19,876,846		19,874,978	1,868
	米ドル	19,876,846		19,874,978	1,868
合計		316,341,692		316,227,996	109,960

## (注) 時価の算定方法

- 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末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。  
同中間計算期間末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。  
同中間計算期間末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。  
・同中間計算期間末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最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。  
・同中間計算期間末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。
- 同中間計算期間末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、同中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 換算において円未満の端数は切捨てております。

## (1口当たり情報)

2019年 2月14日現在	2019年 8月14日現在
1口当たり純資産額 2.2008円 (1万口当たり純資産額 22,008円)	1口当たり純資産額 2.0480円 (1万口当たり純資産額 20,480円)

「しんきん国内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あります。

## 財務諸表

## しんきん国内債券マザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		152,698,438	95,689,675
国債証券		34,988,252,500	18,258,101,000
地方債証券		1,662,267,000	1,417,564,000
特殊債券		1,142,223,000	1,018,211,000
社債券		908,078,000	1,016,665,000
未収利息		70,238,259	39,048,723
前払費用		30,808,173	18,443,118
流動資産合計		38,954,565,370	21,863,722,516
資産合計		38,954,565,370	21,863,722,516
<b>負債の部</b>			
流動負債			
未払解約金		100,000,000	
未払利息		376	275
その他未払費用		5,229	14,924
流動負債合計		100,005,605	15,199
負債合計		100,005,605	15,199
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1, 2	29,436,175,876	16,092,834,539
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		9,418,383,889	5,770,872,778
元本等合計		38,854,559,765	21,863,707,317
純資産合計		38,854,559,765	21,863,707,317
負債純資産合計		38,954,565,370	21,863,722,516

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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。
-----------------	--

## ( 貸借対照表に関する注記 )

区分	2019年 2月14日現在	2019年 8月14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 21,421,912,245円 期中追加設定元本額 34,952,993,604円 期中一部解約元本額 26,938,729,973円	期首元本額 29,436,175,876円 期中追加設定元本額 13,450,800,172円 期中一部解約元本額 26,794,141,509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） 1,877,480,341円 しんきん世界アロケーションファンド 17,517,077,121円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 6,636,092,828円 しんきん国内債券スペシャル（適格機関投資家限定） 1,149,900,975円 S K A M世界アロケーション安定型（年金）（適格機関投資家限定） 2,255,624,611円  合計 29,436,175,876円	しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,946,645,671円 しんきん世界アロケーションファンド 9,163,616,145円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 3,737,454,424円  S K A M世界アロケーション安定型（年金）（適格機関投資家限定） 1,245,118,299円  合計 16,092,834,539円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	29,436,175,876口	16,092,834,539口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （デリバティブ取引等に関する注記）

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありません。	同左

## （1口当たり情報）

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 1.3200円 (1万口当たり純資産額 13,200円)	1口当たり純資産額 1.3586円 (1万口当たり純資産額 13,586円)

「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あります。

## 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		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
<b>資産の部</b>			
流動資産			
預金		5,295,510	25,391,350
コール・ローン		18,382,236	31,689,557
国債証券		10,212,649,125	12,230,451,247
未収利息		125,931,872	84,306,552
前払費用		9,588,946	17,603,252
流動資産合計		10,371,847,689	12,389,441,958
資産合計		10,371,847,689	12,389,441,958
<b>負債の部</b>			
流動負債			
未払利息		45	91
その他未払費用		2,361	2,493
流動負債合計		2,406	2,584
負債合計		2,406	2,584
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1, 2	6,656,337,456	7,740,148,214
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,715,507,827	4,649,291,160
元本等合計		10,371,845,283	12,389,439,374
純資産合計		10,371,845,283	12,389,439,374
負債純資産合計		10,371,847,689	12,389,441,958

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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における開示対象ファンドの中間計算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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	<p>期首元本額 6,787,000,288円</p> <p>期中追加設定元本額 1,834,969,719円</p> <p>期中一部解約元本額 1,965,632,551円</p>	<p>期首元本額 6,656,337,456円</p> <p>期中追加設定元本額 2,099,223,079円</p> <p>期中一部解約元本額 1,015,412,321円</p>

元本の内訳	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 217,965,915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 203,639,536円 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,710,151,558円 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 524,580,447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 204,475,600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 194,197,362円 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,982,474,101円 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 553,253,660円 しんきん世界アロケーションファンド 516,642,456円 しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 214,109,771円 S K A M世界アロケーション安定型(年金)(適格機関投資家限定) 74,995,264円
	合計 6,656,337,456円	合計 7,740,148,214円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	6,656,337,456口	7,740,148,214口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左



3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

## (デリバティブ取引等に関する注記)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 1,5582円 (1万口当たり純資産額 15,582円)	1口当たり純資産額 1,6007円 (1万口当たり純資産額 16,007円)

「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あります。

## 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		2019年2月14日現在	2019年8月14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		1,311,396	614,224
コール・ローン		20,940,572	23,965,291
国債証券		9,986,655,839	11,969,680,664
特殊債券		370,229,280	379,788,766
未収利息		108,359,744	107,039,667
前払費用		870,863	11,974,122
流動資産合計		10,488,367,694	12,493,062,734
資産合計		10,488,367,694	12,493,062,734
負債の部			
流動負債			
未払解約金			4,000,000
未払利息		51	68
その他未払費用		2,326	2,641
流動負債合計		2,377	4,002,709
負債合計		2,377	4,002,709
純資産の部			
元本等			
元本	1, 2	6,621,964,854	7,668,214,697
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		3,866,400,463	4,820,845,328
元本等合計		10,488,365,317	12,489,060,025
純資産合計		10,488,365,317	12,489,060,025
負債純資産合計		10,488,367,694	12,493,062,734

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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における開示対象ファンドの中間計算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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	<p>期首元本額 7,048,202,022円</p> <p>期中追加設定元本額 1,804,457,441円</p> <p>期中一部解約元本額 2,230,694,609円</p>	<p>期首元本額 6,621,964,854円</p> <p>期中追加設定元本額 2,053,470,286円</p> <p>期中一部解約元本額 1,007,220,443円</p>

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 247,516,245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 203,031,802円 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,646,611,249円 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 524,805,558円    合計 6,621,964,854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 238,136,172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 189,962,358円 しんきん3資産ファンド(毎月決算型) 5,904,542,707円 しんきんグローバル6資産ファンド(毎月決算型) 546,764,951円 しんきん世界アロケーションファンド 505,781,241円 しんきん世界アロケーションファンド(積極型) 209,608,607円 S K A M世界アロケーション安定型(年金)(適格機関投資家限定) 73,418,661円    合計 7,668,214,697円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	6,621,964,854口	7,668,214,697口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

## (デリバティブ取引等に関する注記)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 1,5839円 (1万口当たり純資産額 15,839円)	1口当たり純資産額 1,6287円 (1万口当たり純資産額 16,287円)

「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あります。

## 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		2019年2月14日現在	2019年8月14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		47,223,411	47,801,174
コール・ローン		4,205,296	4,890,325
国債証券		1,463,891,134	2,079,088,682
特殊債券		85,058,795	83,869,052
未収利息		16,686,453	11,488,450
前払費用		3,503,679	6,984,102
流動資産合計		1,620,568,768	2,234,121,785
資産合計		1,620,568,768	2,234,121,785
負債の部			
流動負債			
未払利息		10	14
その他未払費用		213	1,083
流動負債合計		223	1,097
負債合計		223	1,097
純資産の部			
元本等			
元本	1, 2	1,278,192,390	1,822,782,534
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		342,376,155	411,338,154
元本等合計		1,620,568,545	2,234,120,688
純資産合計		1,620,568,545	2,234,120,688
負債純資産合計		1,620,568,768	2,234,121,785

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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における開示対象ファンドの中間計算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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	<p>期首元本額 1,658,704,743円</p> <p>期中追加設定元本額 721,495,891円</p> <p>期中一部解約元本額 1,102,008,244円</p>	<p>期首元本額 1,278,192,390円</p> <p>期中追加設定元本額 1,127,228,189円</p> <p>期中一部解約元本額 582,638,045円</p>
元本の内訳	<p>しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 644,188,798円</p> <hr/> <p>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) 634,003,592円</p> <hr/> <p>合計 1,278,192,390円</p>	<p>しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 710,974,110円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 308,205,254円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド (積極型) 130,113,036円</p> <p>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) 625,258,858円</p> <p>S K A M世界アロケーション安定型 (年金)(適格機関投資家限定) 48,231,276円</p> <hr/> <p>合計 1,822,782,534円</p>

2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	1,278,192,390口	1,822,782,534口
---------------------------------------	----------------	----------------

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありませぬ。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (デリバティブ取引等に関する注記)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありませぬ。	同左

## (1口当たり情報)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 1.2679円 (1万口当たり純資産額 12,679円)	1口当たり純資産額 1.2257円 (1万口当たり純資産額 12,257円)



「しんきん」リートマザーファンド」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あります。

## 財務諸表

## しんきん」リートマザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,059,361	65,378,804
投資証券		2,553,882,600	5,923,791,140
未収配当金		28,157,633	25,685,916
流動資産合計		2,586,099,594	6,014,855,860
資産合計		2,586,099,594	6,014,855,860
負債の部			
流動負債			
未払利息		10	188
その他未払費用		993	5,638
流動負債合計		1,003	5,826
負債合計		1,003	5,826
純資産の部			
元本等			
元本	1, 2	1,203,021,071	2,465,298,154
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,383,077,520	3,549,551,880
元本等合計		2,586,098,591	6,014,850,034
純資産合計		2,586,098,591	6,014,850,034
負債純資産合計		2,586,099,594	6,014,855,860

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
-----------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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 2,587,474,292円 期中追加設定元本額 2,203,930,453円 期中一部解約元本額 3,588,383,674円	期首元本額 1,203,021,071円 期中追加設定元本額 3,244,652,467円 期中一部解約元本額 1,982,375,384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) 1,203,021,071円    合計 1,203,021,071円	しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 1,093,411,619円 しんきん世界アロケーションファンド 885,414,507円 しんきん世界アロケーションファンド (積極型) 363,289,512円 SKAM世界アロケーション安定型 (年金)(適格機関投資家限定) 123,182,516円 合計 2,465,298,154円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	1,203,021,071口	2,465,298,154口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同左

## (デリバティブ取引等に関する注記)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
<p>1口当たり純資産額 2,1497円</p> <p>(1万口当たり純資産額 21,497円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2,4398円</p> <p>(1万口当たり純資産額 24,398円)</p>

「しんきんグローバルリートマザーファンド」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あります。

## 財務諸表

## しんきんグローバルリートマザーファンド

## (1) 貸借対照表

区分		2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）	金額（円）
<b>資産の部</b>			
流動資産			
預金		1,582,143	2,858,001
コール・ローン		2,184,008	327,994
投資証券		2,608,243,960	5,170,546,625
未収入金		93,238	326,375
未収配当金		6,844,100	5,982,280
流動資産合計		2,618,947,449	5,180,041,275
資産合計		2,618,947,449	5,180,041,275
<b>負債の部</b>			
流動負債			
未払金			1,309,327
未払利息		5	
その他未払費用		16	3,396
流動負債合計		21	1,312,723
負債合計		21	1,312,723
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1, 2	1,479,859,049	2,884,310,373
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		1,139,088,379	2,294,418,179
元本等合計		2,618,947,428	5,178,728,552
純資産合計		2,618,947,428	5,178,728,552
負債純資産合計		2,618,947,449	5,180,041,275

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 移動平均法に基づき、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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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における開示対象ファンドの中間計算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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14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	<p>期首元本額 2,451,920,803円 期中追加設定元本額 2,602,482,767円 期中一部解約元本額 3,574,544,521円</p>	<p>期首元本額 1,479,859,049円 期中追加設定元本額 3,636,396,252円 期中一部解約元本額 2,231,944,928円</p>
元本の内訳	<p>しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 1,479,859,049円</p> <hr/> <hr/> <hr/> <p>合計 1,479,859,049円</p>	<p>しんきんグローバル6資産ファンド (毎月決算型) 1,479,859,049円 しんきん世界アロケーションファンド 904,895,892円 しんきん世界アロケーションファンド (積極型) 372,537,986円 S K A M世界アロケーション安定型 (年金)(適格機関投資家限定) 127,017,446円</p> <p>合計 2,884,310,373円</p>
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数	1,479,859,049口	2,884,310,373口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (デリバティブ取引等に関する注記)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
該当事項はありません。	同左

## (1口当たり情報)

2019年2月14日現在	2019年8月14日現在
1口当たり純資産額 1.7697円 (1万口当たり純資産額 17,697円)	1口当たり純資産額 1.7955円 (1万口当たり純資産額 17,955円)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】（2019年8月30日現在）

## しんきん世界アロケーションファンド(積極型)

資産総額	9,090,925,379 円
負債総額	14,825,991 円
純資産総額（ ）	9,076,099,388 円
発行済数量	8,642,567,362 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0502 円

（参考）「しんきん世界アロケーションファンド（積極型）」が投資対象とする「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「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」、「しんきんJリートマザーファンド」および「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産額計算書は、以下のとおりです。

## しんきん好配当利回り株マザーファンド

資産総額	28,479,578,000 円
負債総額	9,416 円
純資産総額（ ）	28,479,568,584 円
発行済数量	14,932,464,431 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9072 円

## しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

資産総額	18,723,534,679 円
負債総額	2,080,212 円
純資産総額（ ）	18,721,454,467 円
発行済数量	9,202,124,764 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0345 円

## しんきん国内債券マザーファンド

資産総額	21,957,204,800 円
負債総額	579 円
純資産総額（ ）	21,957,204,221 円
発行済数量	16,092,834,539 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3644 円



## しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

資産総額	12,362,715,496 円
負債総額	1,989 円
純資産総額( )	12,362,713,507 円
発行済数量	7,740,148,214 口
1口当たり純資産額( / )	1.5972 円

## しんきん米国ソブリン債マザーファンド

資産総額	12,629,708,337 円
負債総額	1,902 円
純資産総額( )	12,629,706,435 円
発行済数量	7,668,214,697 口
1口当たり純資産額( / )	1.6470 円

## しんきん高格付外国債券マザーファンド

資産総額	2,224,103,947 円
負債総額	848 円
純資産総額( )	2,224,103,099 円
発行済数量	1,822,782,534 口
1口当たり純資産額( / )	1.2202 円

## しんきんJリートマザーファンド

資産総額	6,181,043,187 円
負債総額	4,918 円
純資産総額( )	6,181,038,269 円
発行済数量	2,465,298,154 口
1口当たり純資産額( / )	2.5072 円

## しんきんグローバルリートマザーファンド

資産総額	5,255,244,413 円
負債総額	3,368 円
純資産総額( )	5,255,241,045 円
発行済数量	2,884,310,373 口
1口当たり純資産額( / )	1.8220 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

## (2) 受益者名簿

該当事項はありません。

## (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (4) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとしします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとしします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に振替法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとしします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## (5) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

## (6) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、振替法の定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

## (7) 償還金

償還金は、償還日において振替機関の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払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します。）に支払います。

## (8) 質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 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)

発行可能株式総数 16,000株

発行済株式総数 4,000株

最近5年間における主な資本の額の増減はありません。

##### (2) 当社の機構

###### 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年以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、補充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、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めます。

###### 投資運用の意思決定機構

###### 商品企画体制

###### ・投資政策委員会

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。

###### 運用体制

###### ・投資政策委員会

当委員会において、経済環境、資産別市場見通しならびに投資環境等を検討し、基本的な運用方針、運用戦略について協議し、委員長がこれを決定します。また、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、方策を審議、決定するとともに、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。経営管理部は、各ファンドの運用成績、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。

###### ・コンプライアンス・運用管理委員会

当委員会において、事務局である経営管理部は、前1か月間の運用状況のモニタリングを行い、リスクとリターンの計測・分析結果および法令・諸規則や運用に関する諸決定事項の遵守状況等の報告を行います。また、トレーディング部は、取引先リスク等の報告を行います。

### コンプライアンス管理体制

取締役会の下で法令等遵守に関する問題を一元管理するため、以下のとおりコンプライアンス管理体制を敷いています。

- ・コンプライアンス・運用管理委員会を設置し、コンプライアンスに関する事項全般について審議します。
- ・コンプライアンスに関する事項を統括する部門として、コンプライアンス担当部門を設置するとともに、コンプライアンス関連部門を設置します。
- ・コンプライアンス統括責任者を社長、コンプライアンス管理責任者を経営管理部長とし、コンプライアンス責任者を各部門長とします。また、各部門におけるコンプライアンスの推進および徹底を実践するため、各部門にコンプライアンス担当者を配置します。
- ・全部門から独立した内部監査部門を設置し、コンプライアンス管理の適切性・有効性を検証・評価します。

上記の内容は、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の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当社は、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」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部および投資助言業務を行います。

当社の運用する証券投資信託は、2019年8月30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	70	880,365
単位型公社債投資信託	6	28,691
単位型株式投資信託	35	106,484
合計	111	1,015,541

（注）純資産総額は百万円未満を切り捨てています。

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 . 当社の財務諸表は、「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）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2 . 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3 . 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。  
なお、EY新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日をもって新日本有限責任監査法人から名称変更しております。

## 1 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

科 目	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日現在)		当事業年度 (2019年3月31日現在)	
		金 額		金 額	
(資産の部)		千円	千円	千円	千円
流動資産					
現金・預金	*2		4,235,835		5,096,449
前払費用			15,065		22,449
未収委託者報酬			496,814		534,748
未収運用受託報酬	*2		21,912		13,102
未収収益			49		49
その他の流動資産			466		1,313
流動資産計			4,770,143		5,668,112
固定資産					
有形固定資産	*1		94,224		90,589
建物		73,046		71,717	
器具備品		21,178		18,871	
無形固定資産			44,161		26,964
ソフトウェア		42,657		25,565	
電話加入権		959		959	
その他		543		439	
投資その他の資産			37,557		46,552
投資有価証券		-		2,018	
長期前払費用		2,489		4,870	
繰延税金資産		35,068		39,662	
固定資産計			175,943		164,106
資産合計			4,946,087		5,832,218

科 目	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日現在)		当事業年度 (2019年3月31日現在)	
		金 額	金 額	金 額	金 額
(負債の部)		千円	千円	千円	千円
流動負債					
未払金			347,332		382,042
未払手数料	*2	302,565		319,565	
その他未払金		44,767		62,477	
未払法人税等			189,582		206,238
未払消費税等			30,210		38,518
未払事業所税			1,946		2,007
賞与引当金			70,520		71,011
その他の流動負債			3,302		3,620
流動負債計			642,896		703,438
固定負債					
退職給付引当金			103,292		102,601
役員退職慰労引当金			11,768		18,487
固定負債計			115,061		121,089
負債合計			757,957		824,528
(純資産の部)		千円	千円	千円	千円
株主資本			4,188,129		5,007,677
資本金			200,000		200,000
利益剰余金			3,988,129		4,807,677
利益準備金		2,000		2,000	
その他利益剰余金		3,986,129		4,805,677	
別途積立金		3,080,000		3,830,000	
繰越利益剰余金		906,129		975,677	
評価・換算差額等			-		13
その他有価証券評価差額金		-		13	
純資産合計			4,188,129		5,007,690
負債・純資産合計			4,946,087		5,832,218

## ( 2 ) 【損益計算書】

科 目	注記 番号	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
		金 額		金 額	
		千円	千円	千円	千円
営業収益					
委託者報酬			4,886,524		5,202,260
運用受託報酬	*1		189,616		192,056
営業収益計			5,076,140		5,394,317
営業費用					
支払手数料	*1		2,401,911		2,566,470
広告宣伝費			30,312		32,074
調査費			511,262		555,537
調査研究費		350,062		375,631	
委託調査費		161,199		179,906	
営業雑経費			65,254		68,770
印刷費		57,929		61,381	
郵便料		195		99	
電信電話料		2,321		2,404	
協会費		4,808		4,885	
営業費用計			3,008,740		3,222,852
一般管理費					
給料			553,435		578,701
役員報酬		41,999		41,693	
給料・手当		366,711		385,731	
賞与		64,202		67,757	
法定福利費		72,291		75,923	
福利厚生費		4,086		4,080	
その他給料		4,142		3,513	
賞与引当金繰入			70,520		71,011
退職給付費用			58,150		64,269
役員退職慰労引当金繰入			5,580		6,718
交際費			4,202		3,260
旅費交通費			7,630		9,400
租税公課			23,615		25,155
不動産賃借料			62,842		62,753
固定資産減価償却費			45,198		33,479
諸経費			139,011		135,925
一般管理費計			970,187		990,674
営業利益			1,097,212		1,180,790
営業外収益					
受取利息	*1		127		136
その他営業外収益			300		280
営業外収益計			428		416
営業外費用					



雑損失			401		904
その他営業外費用			39		-
営業外費用計			440		904
経常利益			1,097,199		1,180,302

科 目	注記 番号	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
		金 額		金 額	
		千円	千円	千円	千円
税引前当期純利益			1,097,199		1,180,302
法人税、住民税および事業税			341,439		365,355
法人税等調整額			1,859		4,600
当期純利益			757,619		819,547

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	利益剰余金				株主資本 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		
当期首残高	200,000	2,000	2,350,000	878,510	3,230,510	3,430,510
当期変動額						
新株の発行						
剰余金の配当						
別途積立金の積立			730,000	730,000		
別途積立金の取崩						
当期純利益				757,619	757,619	757,619
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計			730,000	27,619	757,619	757,619
当期末残高	200,000	2,000	3,080,000	906,129	3,988,129	4,188,129

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高			3,430,510
当期変動額			
新株の発行			
剰余金の配当			
別途積立金の積立			
別途積立金の取崩			
当期純利益			757,619
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）			
当期変動額合計			757,619
当期末残高			4,188,129

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	利益剰余金			利益 剰余金 合計	
		利益 準備金	その他利益剰余金			
			別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	200,000	2,000	3,080,000	906,129	3,988,129	4,188,129
当期変動額						
新株の発行						
剰余金の配当						
別途積立金の積立			750,000	750,000		
別途積立金の取崩						
当期純利益				819,547	819,547	819,547
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計			750,000	69,547	819,547	819,547
当期末残高	200,000	2,000	3,830,000	975,677	4,807,677	5,007,677

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高			4,188,129
当期変動額			
新株の発行			
剰余金の配当			
別途積立金の積立			
別途積立金の取崩			
当期純利益			819,547
株主資本以外の項目の当期 変動額（純額）	13	13	13
当期変動額合計	13	13	819,560
当期末残高	13	13	5,007,690

## 重要な会計方針

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日								
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの：投資信託は、期末前1か月の市場価格の平均に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)</p>								
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>(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。</p> <table border="0"> <tr> <td>建 物</td> <td>3年</td> <td>～</td> <td>50年</td> </tr> <tr> <td>器 具 備 品</td> <td>3年</td> <td>～</td> <td>20年</td> </tr> </table> <p>(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。</p>	建 物	3年	～	50年	器 具 備 品	3年	～	20年
建 物	3年	～	50年						
器 具 備 品	3年	～	20年						
3. 引当金の計上基準	<p>(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。</p> <p>(2)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。</p> <p>(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」に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。</p>								
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。 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。</p>								

## (表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」35,068千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」に含めて表示しております。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## \* 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
建 物	64,186千円	63,831千円
器具備品	37,859千円	40,573千円

## \* 2 関係会社項目

関係会社に対する資産およ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。

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
普通預金	3,142,308千円	3,907,610千円
定期預金	1,000,000千円	1,000,000千円
未収運用受託報酬	5,559千円	5,548千円
未払手数料	142,775千円	166,032千円

## (損益計算書関係)

## \* 1 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。

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
運用受託報酬	160,021千円	171,273千円
受取利息	126千円	134千円
支払手数料	1,926,104千円	2,086,194千円

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1. 発行済株式および総数に関する事項

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式および総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

当社は、資産運用については短期的な預金等に限定しております。また、投機的な取引は行なわない方針であります。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	4,235,835	4,235,835	
(2)未収委託者報酬	496,814	496,814	
(3)未収運用受託報酬	21,912	21,912	
資産計	4,754,562	4,754,562	
(4)未払手数料	302,565	302,565	
(5)その他未払金	44,767	44,767	
(6)未払法人税等	189,582	189,582	
(7)未払消費税等	30,210	30,210	
(8)未払事業所税	1,946	1,946	
負債計	569,072	569,072	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未払手数料、(5)その他未払金、(6)未払法人税等、(7)未払消費税等、(8)未払事業所税

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (注2) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	1年以内	1年超
(1)預金	4,235,530	4,235,530	
(2)未収委託者報酬	496,814	496,814	
(3)未収運用受託報酬	21,912	21,912	
合計	4,754,257	4,754,257	



当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

資産運用については短期的な預金等に限定しており、投機的な取引は行なわない方針であります。

当社は投資運用業を営んでおり、投資家のニーズに対応した投資信託を適時適切に設定することを目的として、当社が運用を行う投資信託を直接保有しております。

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

投資有価証券は、投資信託であり、市場価格の変動リスクに晒されております。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

投資信託については、時価の動向を定期的に把握して経営に報告しております。

また、投資信託に係るリスクに関しては、取締役会において1銘柄当たりの取得金額および取得金額の合計額に係る上限金額を設定しており、リスクは極めて限定的であると認識しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価およびこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	5,096,449	5,096,449	
(2)未収委託者報酬	534,748	534,748	
(3)未収運用受託報酬	13,102	13,102	
(4)投資有価証券	2,018	2,018	
資産計	5,646,318	5,646,318	
(5)未払手数料	319,565	319,565	
(6)その他未払金	62,477	62,477	
(7)未払法人税等	206,238	206,238	
(8)未払消費税等	38,518	38,518	
(9)未払事業所税	2,007	2,007	
負債計	628,807	628,807	

(注1) 金融商品の時価の算定方法

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(5)未払手数料、(6)その他未払金、(7)未払法人税等、(8)未払消費税等、(9)未払事業所税

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

### (4) 投資有価証券

投資信託は、基準価額によっております。

(注2) 金銭債権および満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	1年以内	1年超
(1) 預金	5,096,091	5,096,091	
(2) 未収委託者報酬	534,748	534,748	
(3) 未収運用受託報酬	13,102	13,102	
合計	5,643,942	5,643,942	

## （有価証券関係）

## 1．その他有価証券

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	1,032	1,000	32
小計	1,032	1,000	32
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	986	1,000	13
小計	986	1,000	13
合計	2,018	2,000	18

## 2．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

## （退職給付関係）

## 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。当社が有する退職一時金制度については、簡便法により退職給付引当金および退職給付費用を計算しております。

また、当社が加入する厚生年金基金制度は、複数事業主制度の厚生年金基金制度であり、当社の拠出に対応する年金資産の額を合理的に計算することができないため、当該年金制度への拠出額を退職給付費用として計上しております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
	千円	千円
退職給付引当金の期首残高	100,631	103,292
退職給付費用	12,149	14,918
退職給付の支払額	9,488	15,609
制度への拠出額		
退職給付引当金の期末残高	103,292	102,601

## (2) 退職給付債務および年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金および前払年金費用の調整表

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
	千円	千円
非積立金型制度の退職給付債務	103,292	102,601
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	103,292	102,601
退職給付引当金	103,292	102,601
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	103,292	102,601

## (3) 退職給付費用

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
	千円	千円
簡便法で計算した退職給付費用	12,149	14,918

## 3. 複数事業主制度

確定拠出制度と同様に会計処理する、複数事業主制度の厚生年金基金制度への要拠出額は、前事業年度 37,464千円、当事業年度 39,525千円であります。

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
(1) 直近の積立状況に関する事項	(2017年3月31日現在)	(2018年3月31日現在)
	千円	千円
年金資産の額	1,634,392,721	1,669,710,596
年金財政計算上の数理債務の額と最低責任準備金の額との合計額(注)	1,793,308,599	1,806,457,984
差引額	158,915,877	136,747,387
(2) 掛金に占める当社の拠出割合	(2017年3月分)	(2018年3月分)
	0.0582%	0.0676%

(3) 補足説明	<p>上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高214,616,190千円および年金財政計算上の別途積立金55,700,312千円であります。</p> <p>本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。</p>	<p>上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高197,854,570千円および年金財政計算上の別途積立金61,107,182千円であります。</p> <p>本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。</p>
----------	--	--

## ( 税効果会計関係 )

## 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

	前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
繰延税金資産	千円	千円
賞与引当金繰入限度超過額	21,593	21,743
役員退職慰労引当金	3,603	5,660
退職給付引当金繰入限度超過額	31,628	31,416
未払事業税	9,726	10,663
未払事業所税	595	614
その他	3,152	3,174
繰延税金資産 小計	70,299	73,273
評価性引当額	35,231	33,605
繰延税金資産 合計	35,068	39,668
繰延税金負債	千円	千円
その他有価証券評価差額金		5
繰延税金負債 合計		5
繰延税金資産の純額	35,068	39,662

## 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。

## （セグメント情報等）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## （3）主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	160,021

なお、営業収益の金額は、運用受託報酬について表示しております。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2．関連情報

## （1）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## （2）地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称または氏名	営業収益
信金中央金庫	171,273

なお、営業収益の金額は、運用受託報酬について表示しております。



## ( 関連当事者情報 )

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## ( 1 ) 親会社および法人主要株主等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	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	690,998 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  運用受託報酬  出向者 人件費  事務所 賃借料	1,926,104 千円  160,021 千円  144,916 千円  49,958 千円	未払 手数料	142,775 千円

## ( 2 ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	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	442,952 千円	未払 手数料	92,165 千円

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 取引条件およ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。

また、上記の他預金取引がありますが、取引条件が一般の取引と同等であることが明白な取引であるため記載しておりません。

## 2. 親会社に関する注記

親会社情報

信金中央金庫(東京証券取引所に上場)

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

### (1) 親会社および法人主要株主等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	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	690,998百万円	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 運用受託報酬 出向者人件費 事務所賃借料	2,086,194千円 171,273千円 111,204千円 49,958千円	未払手数料	166,032千円

### (2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	住所	資本金または出資金	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	445,847千円	未払手数料	90,195千円

(注) 1. 記載金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

#### 2. 取引条件およ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。

また、上記の他預金取引がありますが、取引条件が一般の取引と同等であることが明白な取引であるため記載しておりません。

## 2. 親会社に関する注記

親会社情報

信金中央金庫（東京証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
1株当たり純資産額	1,047,032円43銭	1,251,922円67銭
1株当たり当期純利益金額	189,404円77銭	204,886円98銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、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、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
当期純利益金額	757,619千円	819,547千円
普通株主に帰属しない金額	千円	千円
普通株式に係る当期純利益金額	757,619千円	819,547千円
期中平均株式数	4,000 株	4,000 株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 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) 自己またはその取締役も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、もしくは取引の公正を害し、また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、もしくは取引の公正を害し、また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) 通常の見積り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。）または子法人等（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また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また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、運用財産の額も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また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、もしくは取引の公正を害し、また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) 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。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およ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、資本金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)（販売会社）
  - (2) 資本の額（出資の総額） 690,998百万円（2019年3月末現在）
  - (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および業務機能の補完を図っています。
- 2 - (1) 名称  
三菱UFJ信託銀行株式会社(受託会社)
  - (2) 資本の額 324,279百万円（2019年3月末現在）
  - (3) 事業の内容  
銀行業および信託業務を営んでいます。

#### <再信託受託会社の概要>

- ・名称  
日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・資本の額 10,000百万円（2019年3月末現在）
- ・事業の内容  
銀行業および信託業務を営んでいます。

#### (参考) マザーファンドの投資顧問会社の概要

しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

- ・名称  
シュローダー・インベストメント・マネジメント・リミテッド
- ・事業の内容  
シュローダー・グループの英国における資産運用部門として1985年に設立されました。英国において、内外の有価証券等に係る投資顧問業務、投資信託業務およびその他の関連する業務を行っております。

しんきんグローバルリートマザーファンド

- ・名称  
ブラックロック・ジャパン株式会社
- ・事業の内容  
ブラックロック・ジャパン株式会社は、グローバルに資産運用ビジネスを展開するブラックロック・グループ（以下、「ブラックロック」といいます。）の一員です。ブラックロック・ジャパン株式会社は、ブラックロックグループの日本における運用拠点です。

### 2【関係業務の概要】

- (1) 信金中央金庫（販売会社）  
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) 三菱UFJ信託銀行株式会社（受託会社）  
投資信託財産の保管・管理業務を行い、分配金、解約金および償還金の委託会社への交付等を行います。

### 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【その他】

#### 1 目論見書の表紙および裏表紙の記載等について

- (1) 使用開始日を記載します。
- (2) 当ファンドのロゴ・マークを記載することがあります。
- (3) ファンドの形態等を記載することがあります。
- (4) 「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (5) 販売会社の名称、ロゴマークを記載することがあります。
- (6) 委託会社の名称、ロゴマーク、問い合わせ先を記載することがあります。
- (7) 受託会社の名称を記載することがあります。
- (8) 目論見書の表紙に図案を採用することがあります。
- (9) 請求目論見書は委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできる旨、また約款は請求目論見書に添付されている旨を記載することがあります。（交付目論見書の場合）
- (10) 金融商品取引法に定める目論見書である旨を記載することがあります。
- (11) 金融商品取引法の規定に基づき、投資者の請求により交付される目論見書（請求目論見書）である旨を記載することがあります。（請求目論見書の場合）
- (12) 当ファンドの手續・手数料等の概要を記載することがあります。
- (13) 当ファンドの購入にあたっては、交付目論見書を十分に読むべきである旨を記載することがあります。

#### 2 目論見書の表紙裏の記載について

次の事項を記載することがあります。

- (1) 当ファンドに関して、委託会社が有価証券届出書を監督官庁に提出している旨。
- (2) 当ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、法令に基づき事前に受益者の意向を確認する手続きを行う旨。
- (3) 当ファンドの信託財産は、受託会社により分別管理されている旨。
- (4) 請求目論見書は、販売会社に対して投資者の請求があった場合に交付される旨。また、販売会社に請求目論見書を請求した場合は、当該請求を行った旨を投資者が記録しておくべきである旨。（交付目論見書の場合）
- (5) 当ファンドの商品分類および属性区分、また、これらの詳細な情報を一般社団法人投資信託協会のホームページで確認できる旨。
- (6) 委託会社の情報
- (7) 当ファンドについて略称を用いることがある旨。

#### 3 本有価証券届出書の本文「第一部 証券情報」および「第二部 ファンド情報」の記載内容について、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

#### 4 請求目論見書に投資信託約款の全文を記載します。

#### 5 目論見書は電子媒体等により作成されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2019年6月12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

### EY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 南波 秀哉 印

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小松崎 謙 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2018年4月1日から2019年3月31日までの第29期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 監査意見

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2019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。

#### 利害関係

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

- 
- (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. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成31年3月27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

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

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世界アロケーションファンド（積極型）の平成30年2月15日から平成31年2月14日までの計算期間の財務諸表、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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、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財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

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、しんきん世界アロケーションファンド（積極型）の平成31年2月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算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。

### 利害関係

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. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の中間監査報告書

2019年9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

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

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世界アロケーションファンド（積極型）の2019年2月15日から2019年8月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、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中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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、我が国において一般に公正妥当と認められ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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間監査意見

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、しんきん世界アロケーションファンド（積極型）の2019年8月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月15日から2019年8月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。