

【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】	2020年5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】

① 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。）

② 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】

① 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。）

② 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。

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

※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】

- ① 販売会社が定める単位
- ② 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】

2020年5月9日から2020年11月13日まで

（申込期間は、上記期間満了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】

- ① 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。

- ② 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。
- 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。
- ④ 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。
- ⑤ 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。
- ⑥ 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】

① 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。

② ファンドの基本的性格

当ファンドは、以下の「商品分類」および「属性区分」に該当します。

1) 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型 投 信	国 内	株 式
	海 外	債 券
追 加 型 投 信	内 外	不動産投信
		その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分表

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

(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。

③ 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。

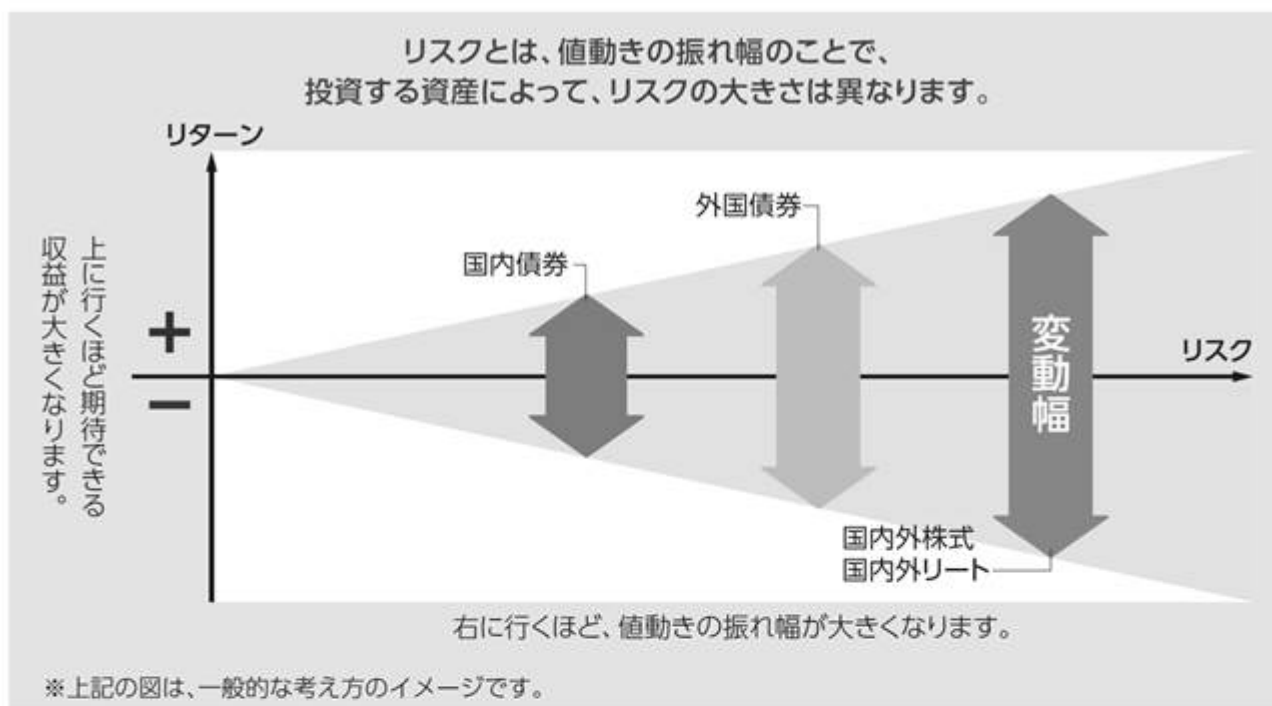
※常に全ての投資対象に投資を行うとは限りません。

- ◆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。



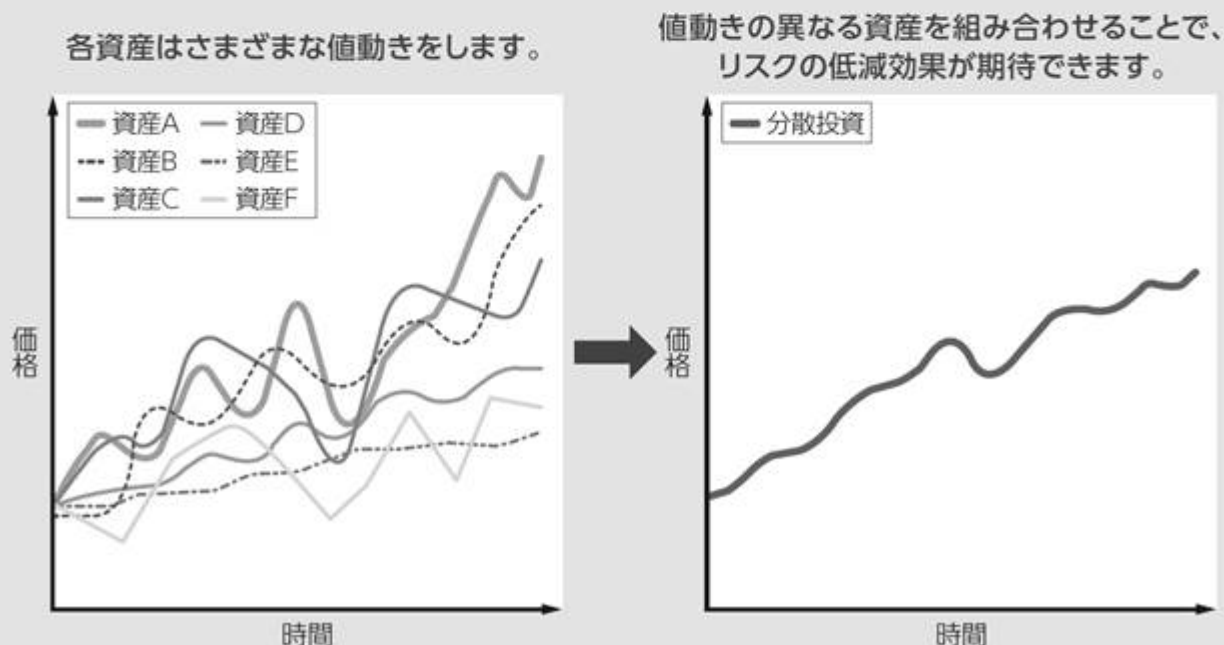
特色2 分散投資を通じてリスクを抑えた運用が期待できます。

◆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。

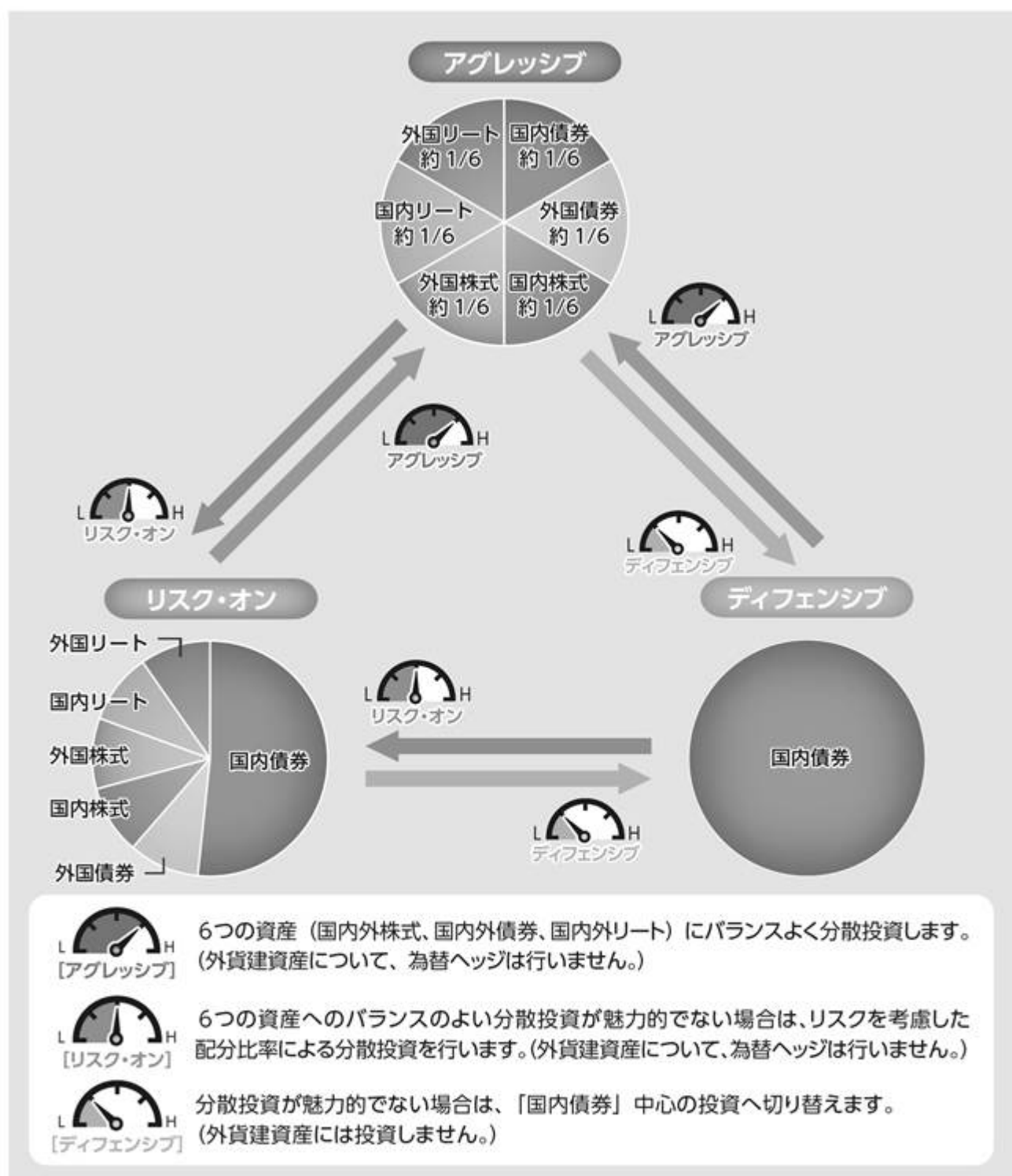
分散投資の効果



※上記の図は、一般的な考え方のイメージです。当ファンドの将来の運用成果等を示唆、約束するものではありません。

※各資産の配分比率によっては、リスクの大きな資産の影響を強く受けることがあります。

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  ベルギー  デンマーク  フィンランド	 フランス  ドイツ  アイルランド  イスラエル	 イタリア  オランダ  ノルウェー  ポルトガル	 スペイン  スウェーデン  スイス  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

※ 2020年2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。）

※外国株式の主な投資対象国は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。

※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 ※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。									
	🇺🇸 アメリカ ※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。									
EURO参加国	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 ※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。									
	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 ※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。									

※ 2020年2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。

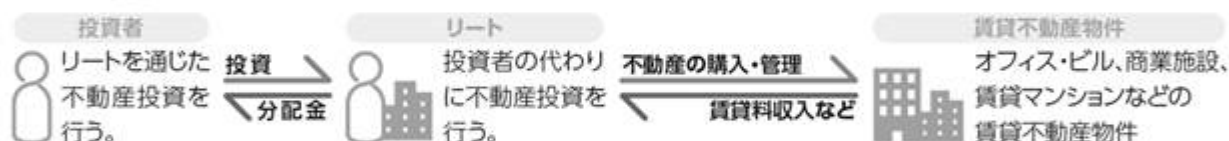
◎不動産投資信託（リート）のポイント

- 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 ニュージーランド

※ 2020年2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807兆円（2019年12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。

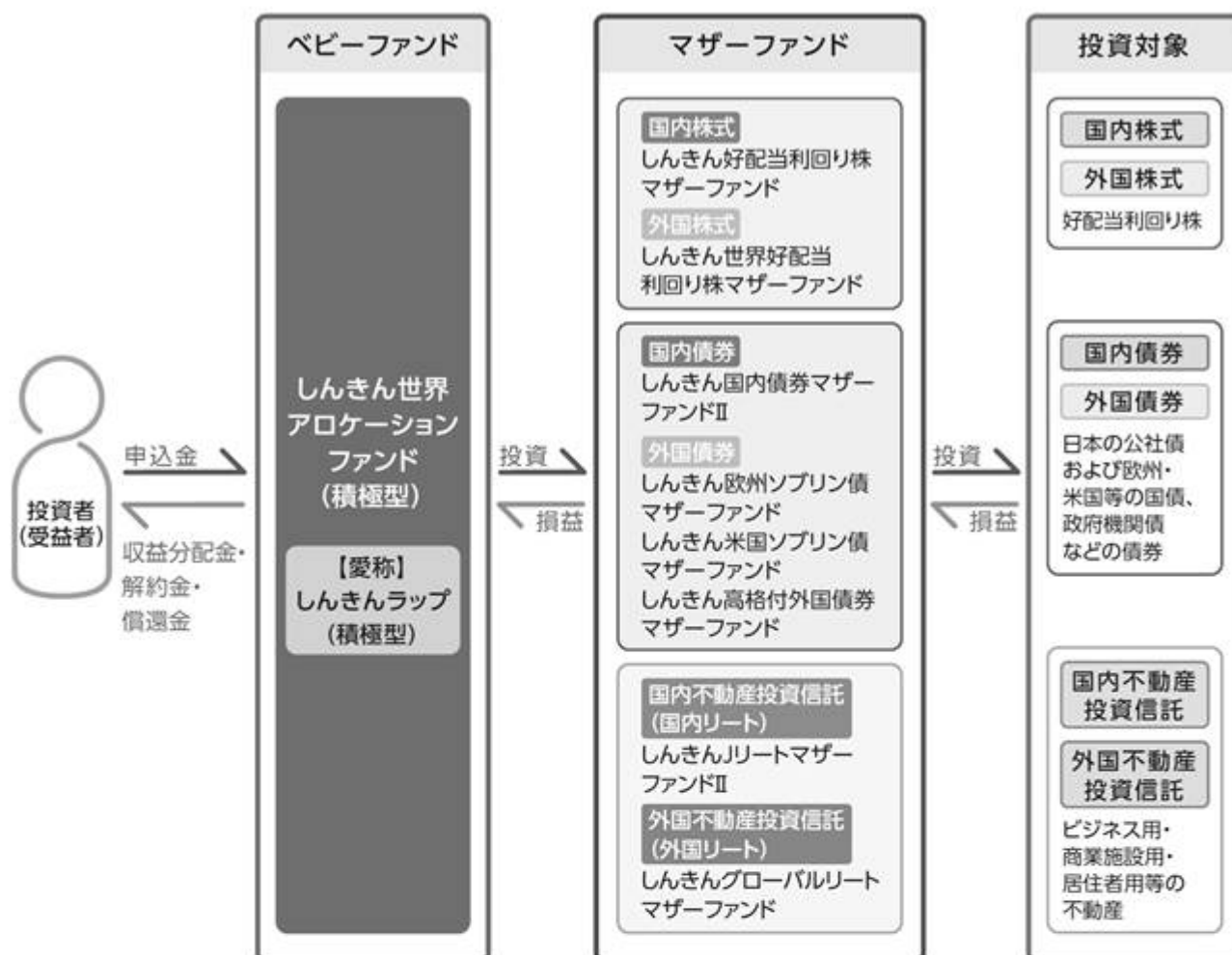


円高になると外貨建資産の価値は
円ベースで下落します。



※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。）

④ 信託金の限度額

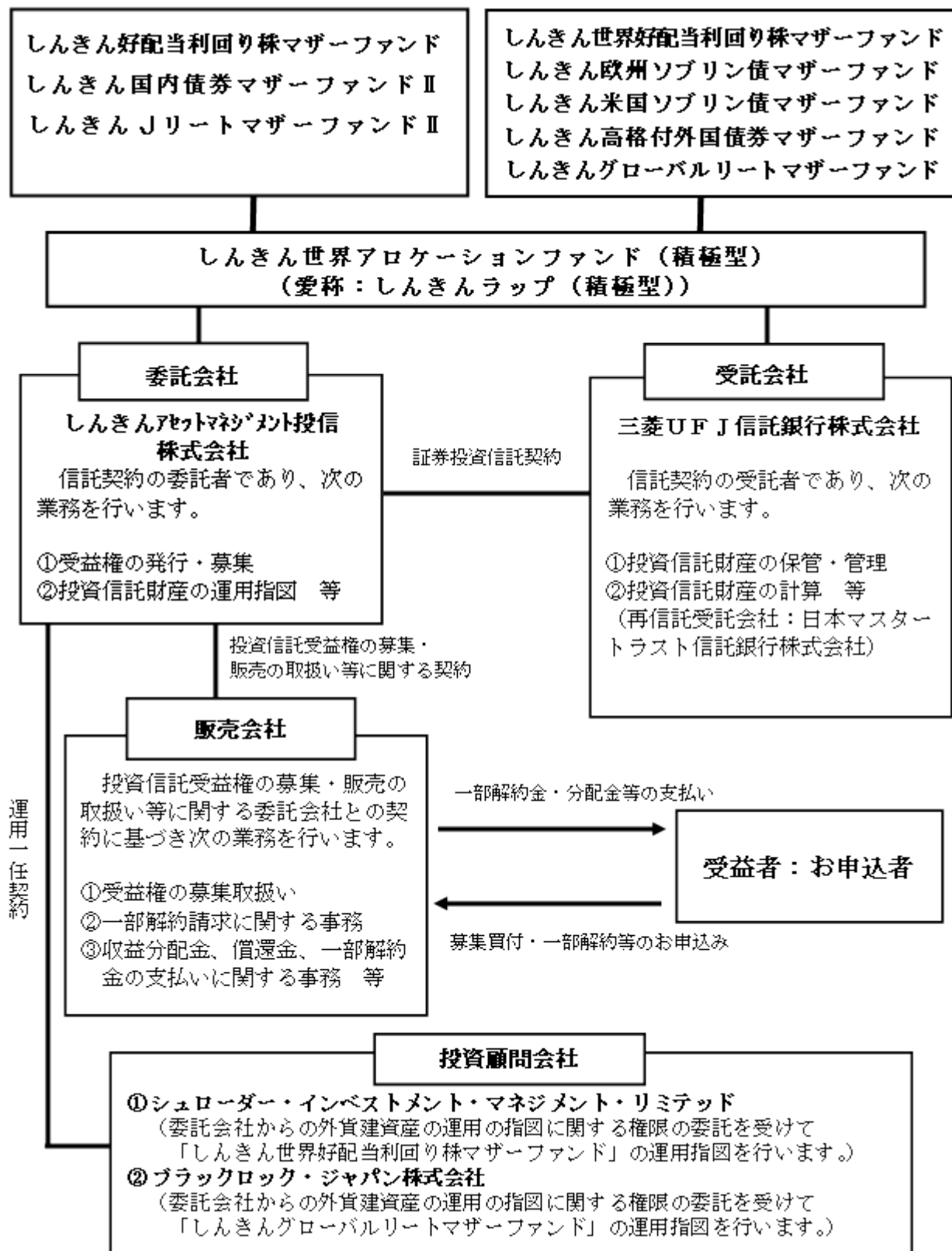
- ・ 2,000億円を限度額として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

（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。

＜委託会社の概況＞（本書提出日現在）

① 名称

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

② 本店の所在の場所

東京都中央区京橋三丁目8番1号

③ 資本の額

200百万円

④ 会社の沿革

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

⑤ 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
信金中央金庫	東京都中央区八重洲一丁目3番7号	4,000株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

① 投資対象

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Ⅱ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Ⅱ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。

② 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】

① 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

② 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Ⅱ」、「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Ⅱ」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ます。

２）委託会社は、信託金を、上記１）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。）

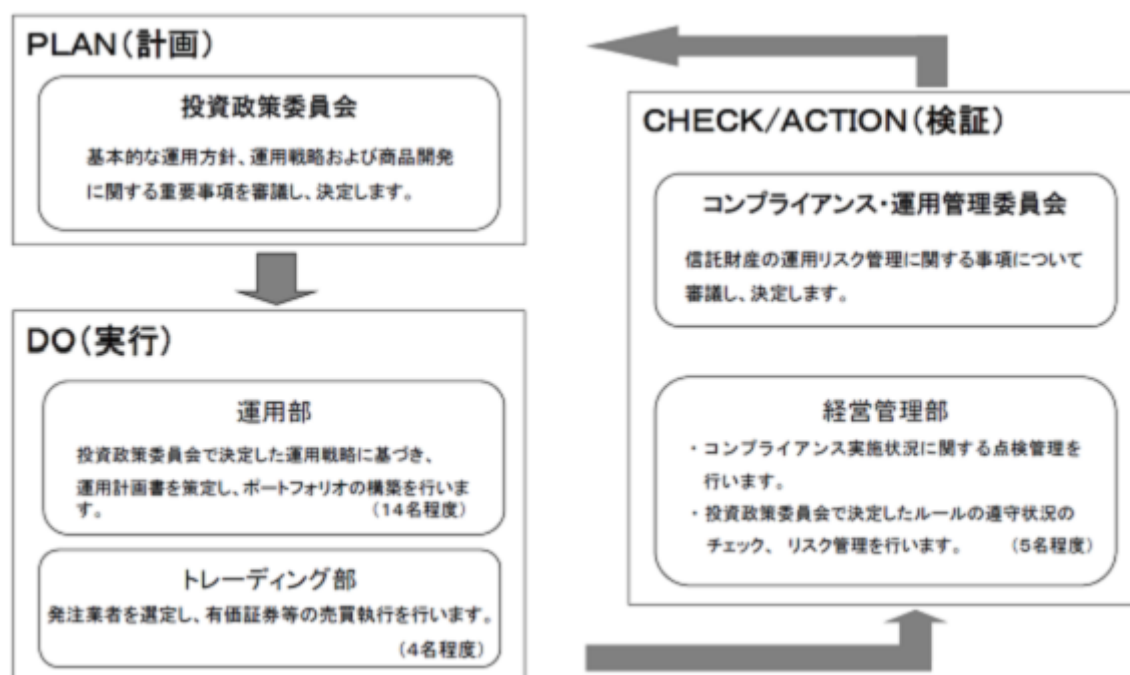
ハ．コール・ローン

ニ．手形割引市場において売買される手形

３）上記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》

- ① 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。
- ② 投資政策委員会においては、ファンダメンタルズ分析、市場分析を踏まえて基本的な投資方針を策定します。また、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）【分配方針】

年1回の決算日に、原則として以下の方針に基づいて分配を行います。

- ① 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 分配金額は、委託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。
- ③ 留保益は、投資信託約款の運用の「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

（５）【投資制限】

「しんきん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。

- ① 株式への直接投資は行いません。
- ② 外貨建資産への直接投資は行いません。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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ます。

1) 上記⑤の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

イ) 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による、受取りの確定している資金の額の範囲内。

ロ) 一部解約金支払日の前営業日において確定した、当該支払日における当該支払資金の不足額の範囲内。

ハ) 借入指図を行う日における、投資信託財産の純資産総額の10%以内。

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

3) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

（参考）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

① 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みます。）を主要投資対象とします。

② 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

① 投資の対象とする資産

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

- 1）有価証券
- 2）デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条および第21条に定めるものに限ります。）
- 3）金銭債権
- 4）約束手形

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（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）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します。）
 - 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します。）
 - 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。
- ③ 委託会社は、信託金を②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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
- ④ 上記②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

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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。
- ⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、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。

- ⑥ 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。
- ⑦ 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ん。

「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

① 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。

② 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。
- 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

① 投資の対象とする資産

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

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第20条、第21条および第22条に定めるものに限りします。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券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。

③ 委託会社は、信託金を上記②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

④ 上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前項1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（3）投資制限

① 株式への投資割合には、制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

③ 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。

④ 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。

⑤ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合には、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。

⑥ 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。

- ⑦ 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Ⅱ」の概要

（１）投資方針

① 投資対象

我が国の公社債を主要投資対象とします。

② 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ＢＢＢ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

① 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象と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。）
- ３）金銭債権
- ４）約束手形

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（本邦通貨表示のものに限りま。）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ーズド・エンド型のものは除きます。）のうち公社債に投資する投資証券
- 10) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるもので、第1号から第5号までの証券の性質を有する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。

- ③ 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

- ④ 上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前項1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 投資制限

- ① 株式への投資は行いません。
- ② 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。
- ③ 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 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Ⅱ」（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

① 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。

② 投資態度

- 1）主としてEMU参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- 2）F T S E 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

① 投資対象

米国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。

② 投資態度

- 1）主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- 2）F T S E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。

① 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。

② 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。）

① 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象と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します。）
- 3）金銭債権
- 4）約束手形

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券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・エンド型のものは除きます。）のうち公社債に投資する投資証券
- 10）預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるもので、第1号から第5号までの証券の性質を有する本邦通貨建のものとします。）
- 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します。）
- 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、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。

- ③ 委託会社は、信託金を②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

- ④ 上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を前項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 「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。

① 株式への投資は行いません。

② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③ 同一銘柄の転換社債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。

④ 投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(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

① 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。

② 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・アンド・プアーズ社のいずれかからA A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

① 投資の対象とする資産

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

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

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

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の
- 8) 投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、外国投資信託は除きます。）のうち公社債投資信託の受益証券
- 9) 投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、外国投資証券およびクローズド・エンド型のものは除きます。）のうち公社債に投資する投資証券

- 10) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるもので、第1号から第5号までの証券の性質を有するものとします。）
- 11) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 12) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 13) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

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

- ③ 委託会社は、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

- ④ 上記②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

- ① 株式への投資は行いません。
- ② 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。
- ③ 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。
- ④ 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ＪリートマザーファンドⅡ」の概要

（１）投資方針

① 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。

② 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

① 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象と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

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として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。）

③ 委託会社は、信託金を②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

④ 上記②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

① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

② 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、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。

③ 株式への投資は行いません。

④ 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JリートマザーファンドⅡ」（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

① 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。

② 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

① 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象と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

② 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として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。）

③ 委託会社は、信託金を②に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品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

- ④ 上記②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

- ① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ② 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、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REIT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REIT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。
- ③ 株式への投資は行いません。
- ④ 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

① 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。

② 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により公社債等の価格が下落するリスクをいいます。一般的に金利低下局面では組入れた公社債等の価格は値上がりし、金利上昇局面では値下がります。また、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。

③ 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。

④ 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。

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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

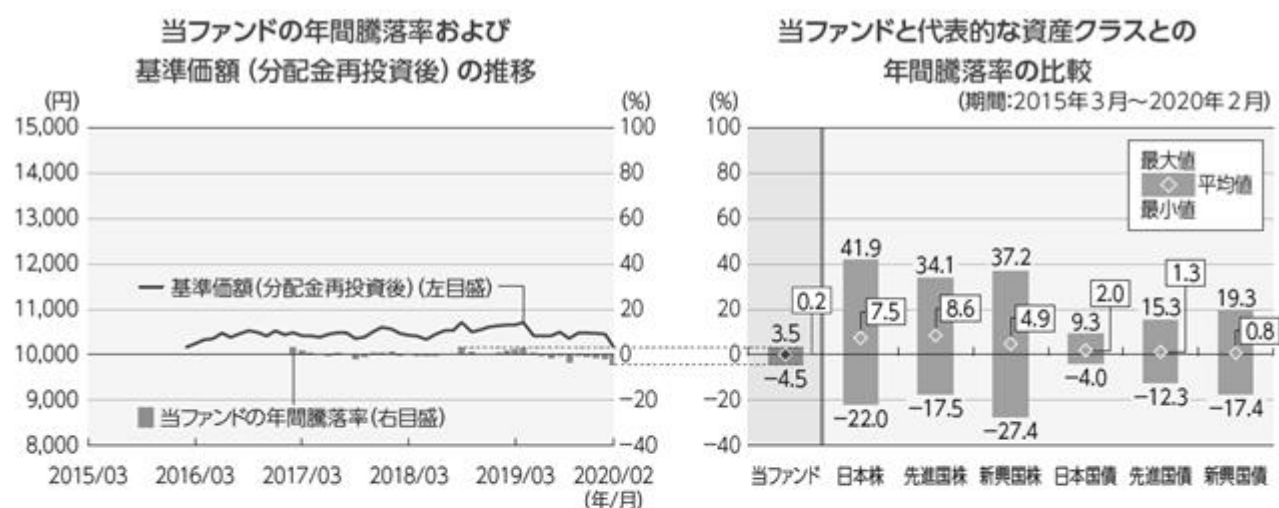
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（クーリング・オフ）の適用はありません。

（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～2020年2月です。

※基準価額（分配金再投資後）は、2016年2月末～2020年2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2020年2月、代表的な資産クラスについては2015年3月から2020年2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】

- ① 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。）

- ② 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。
- ③ 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等相当額」といいます。）が課されます。
- ④ 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】

運用管理費用 (信託報酬)	純資産総額に対して、 <u>年率1.155%（税抜1.05%）</u>	
	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。	
	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】

- ① 投資信託財産において、一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的とし、資金の借入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。
- ② 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社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。
- ③ ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に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。
- ④ 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。

① 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ついて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。

② 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。

③ 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。

損益通算について	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。 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。 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。
----------	---

※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

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	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。 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。 益金不算入制度の適用はありません。
---	---

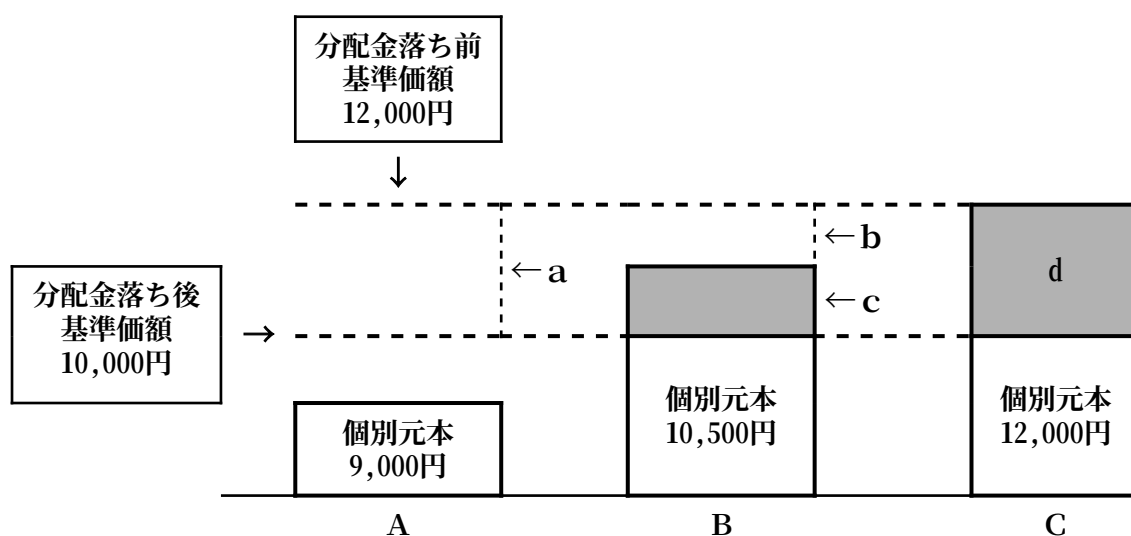
※外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

※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。

<個別元本および収益分配金の区分の具体例>

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



A) 収益分配金受取前の個別元本が9,000円の場合

分配金落ち後の基準価額が分配金受取前の個別元本を上回っているため、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2020年2月28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	8,295,409,725	98.36
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		138,530,592	1.64
合計（純資産総額）		8,433,940,317	100.00

(2)【投資資産】

①【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Ⅱ	3,375,045,916	1.3400	4,522,561,527	1.3538	4,569,137,161	54.18
日本	しんきんＪリートマザーファンドⅡ	313,935,879	2.7231	854,878,792	2.4824	779,314,426	9.24
日本	しんきん世界好配当利回り株マザー ファンド	352,557,151	2.3387	824,525,409	2.1089	743,507,775	8.82
日本	しんきんグローバルリートマザーファ ンド	379,138,236	2.0374	772,456,242	1.8611	705,614,171	8.37
日本	しんきん好配当利回り株マザーファン ド	358,892,887	2.1679	778,043,889	1.9372	695,247,300	8.24
日本	しんきん米国ソブリン債マザーファン ド	190,276,743	1.7059	324,593,095	1.7345	330,035,010	3.91
日本	しんきん欧州ソブリン債マザーファン ド	202,211,118	1.5846	320,423,737	1.6142	326,409,186	3.87
日本	しんきん高格付外国債券マザーファン ド	115,877,495	1.2722	147,419,349	1.2612	146,144,696	1.73

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	98.36
合計	98.36

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

2020年2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
第4計算期間末（2020年2月14日）	8,725,207,889	8,725,207,889	10,487	10,487
2019年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	—
9月末日	8,930,511,280	—	10,362	—
10月末日	9,000,240,151	—	10,482	—
11月末日	8,934,111,447	—	10,483	—
12月末日	8,807,500,237	—	10,478	—
2020年1月末日	8,720,989,218	—	10,458	—
2月末日	8,433,940,317	—	10,182	—

（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。

②【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
第4期	2019年2月15日～2020年2月14日	0

③【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	2019年2月15日～2020年2月14日	△1.58

（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	2019年 2月15日～2020年 2月14日	1,669,917,892	1,702,853,171

（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Ⅱ」、「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Ⅱ」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	27,217,519,980	97.77
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		619,536,417	2.23
合計（純資産総額）		27,837,056,397	100.00

(2) 投資資産

① 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	伊藤忠商事	卸売業	147,000	2,072.25	304,620,750	2,461.50	361,840,500	1.30
2	日本	株式	TKC	情報・通信業	71,900	4,241.90	304,993,262	4,890.00	351,591,000	1.26
3	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	15,700	16,131.65	253,266,905	22,325.00	350,502,500	1.26
4	日本	株式	パナソニック	電気機器	339,400	928.86	315,255,084	1,030.50	349,751,700	1.26
5	日本	株式	みらかホールディングス	サービス業	129,500	2,563.94	332,030,230	2,685.00	347,707,500	1.25
6	日本	株式	カシオ計算機	電気機器	182,500	1,453.23	265,214,475	1,857.00	338,902,500	1.22
7	日本	株式	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	保険業	97,100	3,381.24	328,318,682	3,483.00	338,199,300	1.21
8	日本	株式	太陽ホールディングス	化学	78,800	3,588.34	282,761,192	4,290.00	338,052,000	1.21
9	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	115,300	2,512.62	289,705,086	2,927.50	337,540,750	1.21
10	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	58,000	5,514.36	319,832,960	5,801.00	336,458,000	1.21
11	日本	株式	中国電力	電気・ガス業	233,000	1,426.71	332,423,430	1,436.00	334,588,000	1.20
12	日本	株式	大林組	建設業	304,300	1,078.72	328,254,496	1,089.00	331,382,700	1.19
13	日本	株式	あおぞら銀行	銀行業	122,600	2,974.03	364,616,078	2,702.00	331,265,200	1.19
14	日本	株式	ヤマダ電機	小売業	632,900	534.74	338,436,946	519.00	328,475,100	1.18
15	日本	株式	SUBARU	輸送用機器	125,100	2,699.32	337,685,383	2,619.50	327,699,450	1.18
16	日本	株式	トレンドマイクロ	情報・通信業	61,000	5,184.69	316,266,090	5,370.00	327,570,000	1.18
17	日本	株式	因幡電機産業	卸売業	136,400	2,245.32	306,261,648	2,391.00	326,132,400	1.17
18	日本	株式	ホクト	水産・農林業	177,300	1,981.72	351,360,626	1,838.00	325,877,400	1.17
19	日本	株式	トッパン・フォームズ	その他製品	316,500	963.95	305,090,175	1,029.00	325,678,500	1.17
20	日本	株式	ローソン	小売業	56,500	6,016.39	339,926,035	5,730.00	323,745,000	1.16
21	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	190,500	1,660.31	316,289,055	1,699.00	323,659,500	1.16
22	日本	株式	三井物産	卸売業	180,100	1,782.05	320,947,205	1,783.50	321,208,350	1.15
23	日本	株式	住友商事	卸売業	207,500	1,608.24	333,709,800	1,544.50	320,483,750	1.15
24	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	667,400	411.74	274,795,276	479.50	320,018,300	1.15
25	日本	株式	日本郵政	サービス業	339,400	1,206.07	409,343,512	940.70	319,273,580	1.15

26	日本	株式	SANKYO	機械	89,900	4,056.68	364,695,540	3,545.00	318,695,500	1.14
27	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	125,200	2,415.38	302,406,596	2,529.50	316,693,400	1.14
28	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	112,900	2,964.07	334,643,503	2,799.50	316,063,550	1.14
29	日本	株式	キャノン	電気機器	115,400	3,120.35	360,089,500	2,733.50	315,445,900	1.13
30	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	240,900	1,635.53	393,999,177	1,304.00	314,133,600	1.13

業種別投資比率

業種	投資比率（％）
水産・農林業	1.17
建設業	3.34
食料品	2.14
繊維製品	2.13
化学	6.56
医薬品	3.36
石油・石炭製品	2.14
ゴム製品	2.11
ガラス・土石製品	1.07
鉄鋼	0.89
非鉄金属	2.12
金属製品	2.09
機械	7.61
電気機器	10.20
輸送用機器	6.62
精密機器	1.12
その他製品	2.26
電気・ガス業	1.20
陸運業	2.14
空運業	1.09
倉庫・運輸関連業	1.05
情報・通信業	5.92
卸売業	7.01
小売業	3.37
銀行業	6.65
証券、商品先物取引業	2.26
保険業	3.48
不動産業	2.14
サービス業	4.54
合計（対純資産総額比）	97.77

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。

- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

＜参考＞

「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	4,340,403,445	20.43
株式	ドイツ	1,153,735,032	5.43
株式	イタリア	2,203,771,927	10.37
株式	フランス	2,275,718,275	10.71
株式	オランダ	262,406,340	1.24
株式	スペイン	618,502,919	2.91
株式	ベルギー	184,876,789	0.87
株式	イギリス	7,532,990,634	35.46
株式	オーストラリア	756,844,769	3.56
小計		19,329,250,130	90.99
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		1,914,441,847	9.01
合計（純資産総額）		21,243,691,977	100.00

(2) 投資資産

① 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	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,356,269	886.73	1,202,653,238	746.89	1,012,990,846	4.77
2	イタリア	株式	ENI SPA	エネルギー	672,072	1,684.13	1,131,858,508	1,414.72	950,795,420	4.48
3	イギリス	株式	CENTRICA PLC	公益事業	8,467,184	117.43	994,313,488	107.94	914,025,316	4.30
4	イギリス	株式	WM MORRISON SUPERMARKETS	食品・生活必需品小売り	3,726,181	285.03	1,062,108,755	239.95	894,125,282	4.21
5	アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	60,949	14,862.78	905,871,737	14,566.22	887,796,988	4.18
6	イギリス	株式	ANGLO AMERICAN PLC	素材	337,932	2,642.99	893,150,999	2,611.66	882,564,798	4.15
7	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	81,811	9,290.16	760,038,023	10,641.10	870,559,097	4.10
8	イギリス	株式	PEARSON PLC	メディア・娯楽	1,022,259	1,064.18	1,087,874,118	803.48	821,365,008	3.87
9	オーストラリア	株式	SOUTH32 LTD	素材	4,717,713	214.23	1,010,693,777	160.42	756,844,769	3.56
10	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	278,529	2,081.15	579,663,409	2,394.32	666,889,895	3.14
11	イタリア	株式	INTESA SANPAOLOA	銀行	2,400,399	259.25	622,326,478	275.35	660,955,433	3.11

12	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	107,467	5,253.73	564,603,064	6,109.47	656,567,154	3.09
13	アメリカ	株式	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	保険	137,320	5,661.21	777,398,527	4,750.35	652,318,927	3.07
14	イギリス	株式	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	銀行	2,479,384	303.38	752,211,634	258.79	641,654,016	3.02
15	イギリス	株式	STANDARD CHARTERED PLC	銀行	789,639	937.15	740,017,339	805.17	635,796,523	2.99
16	イギリス	株式	TESCO PLC	食品・生活必需品小売り	1,937,874	333.18	645,671,919	325.96	631,677,354	2.97
17	スペイン	株式	REPSOL SA	エネルギー	489,104	1,640.77	802,509,254	1,264.56	618,502,919	2.91
18	イタリア	株式	UNICREDIT SPA	銀行	409,964	1,347.95	552,614,633	1,444.08	592,021,074	2.79
19	フランス	株式	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	メディア・娯楽	572,433	1,055.17	604,018,379	810.35	463,874,058	2.18
20	フランス	株式	SOCIETE BIC SA	商業・専門サービス	69,993	7,723.76	540,609,175	6,617.60	463,185,677	2.18
21	ドイツ	株式	RTL GROUP S.A.	メディア・娯楽	96,463	5,121.41	494,026,756	4,716.54	454,971,984	2.14
22	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	103,345	5,696.97	588,754,029	4,381.57	452,814,096	2.13
23	ドイツ	株式	CONTINENTAL AG	自動車・自動車部品	34,656	13,434.12	465,573,047	12,332.80	427,405,517	2.01
24	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	52,933	7,567.86	400,589,877	7,052.76	373,323,930	1.76
25	アメリカ	株式	OMNICOM GROUP	メディア・娯楽	47,915	8,582.04	411,208,674	7,607.57	364,516,889	1.72
26	フランス	株式	PUBLICIS GROUPE SA	メディア・娯楽	83,303	4,697.32	391,301,033	4,237.67	353,010,657	1.66
27	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	144,497	2,279.67	329,406,063	2,299.81	332,315,757	1.56
28	イギリス	株式	BARCLAYS PLC	銀行	1,330,466	222.29	295,761,494	217.93	289,948,833	1.36
29	オランダ	株式	ING GROEP NV	銀行	246,960	1,208.68	298,497,953	1,062.54	262,406,340	1.24
30	イギリス	株式	WPP PLC	メディア・娯楽	229,038	1,357.73	310,973,067	1,074.69	246,145,708	1.16

業種別投資比率

業種	投資比率（％）
エネルギー	7.39
素材	7.72
商業・専門サービス	2.18
運輸	1.08
自動車・自動車部品	3.29
メディア・娯楽	12.73
小売	0.81
食品・生活必需品小売り	7.18
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.66

銀行	21.88
保険	3.94
ソフトウェア・サービス	4.18
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.55
公益事業	4.30
半導体・半導体製造装置	3.09
合計（対純資産総額比）	90.99

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。
- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「しんきん国内債券マザーファンドⅡ」

(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	16,128,705,500	83.09
地方債証券	日本	1,420,116,000	7.32
特殊債券	日本	614,765,000	3.17
社債券	日本	1,114,321,000	5.74
現金・預金およびその他の資産(負債控除後)		133,363,027	0.69
合計(純資産総額)		19,411,270,527	100.00

(2) 投資資産

① 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315回利付国債（10年）	1,000,000,000	102.69	1,026,946,000	101.85	1,018,530,000	1.2	2021/6/20	5.25
2	日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	900,000,000	102.41	921,690,000	102.76	924,876,000	0.1	2029/3/20	4.76
3	日本	国債証券	第322回利付国債（10年）	900,000,000	103.07	927,684,000	102.37	921,411,000	0.9	2022/3/20	4.75
4	日本	国債証券	第317回利付国債（10年）	800,000,000	102.90	823,225,000	102.08	816,648,000	1.1	2021/9/20	4.21
5	日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	800,000,000	102.64	821,128,000	101.58	812,696,000	1.3	2021/3/20	4.19
6	日本	国債証券	第168回利付国債（20年）	700,000,000	104.54	731,837,500	104.92	734,447,000	0.4	2039/3/20	3.78
7	日本	国債証券	第160回利付国債（20年）	650,000,000	110.25	716,625,000	110.33	717,177,500	0.7	2037/3/20	3.69
8	日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	650,000,000	102.93	669,076,500	102.83	668,421,000	0.1	2028/9/20	3.44
9	日本	国債証券	第164回利付国債（20年）	600,000,000	106.70	640,200,000	106.90	641,412,000	0.5	2038/3/20	3.30
10	日本	国債証券	第22回利付国債（30年）	450,000,000	141.21	635,487,500	138.89	625,036,500	2.5	2036/3/20	3.22
11	日本	国債証券	第61回利付国債（20年）	600,000,000	104.70	628,200,000	103.92	623,520,000	1	2023/3/20	3.21
12	日本	国債証券	第318回利付国債（10年）	600,000,000	102.62	615,725,000	101.92	611,550,000	1	2021/9/20	3.15
13	日本	国債証券	第152回利付国債（20年）	500,000,000	118.57	592,850,000	117.61	588,080,000	1.2	2035/3/20	3.03
14	日本	国債証券	第148回利付国債（20年）	450,000,000	122.05	549,225,000	121.15	545,215,500	1.5	2034/3/20	2.81
15	日本	国債証券	第125回利付国債（20年）	400,000,000	127.36	509,440,000	125.69	502,788,000	2.2	2031/3/20	2.59

16	日本	国債証券	第116回利付国債（20年）	400,000,000	125.33	501,320,000	123.85	495,400,000	2.2	2030/3/20	2.55
17	日本	国債証券	第135回利付国債（20年）	400,000,000	122.71	490,840,000	121.43	485,736,000	1.7	2032/3/20	2.50
18	日本	国債証券	第144回利付国債（20年）	400,000,000	121.32	485,280,000	120.12	480,488,000	1.5	2033/3/20	2.48
19	日本	国債証券	第62回利付国債（30年）	450,000,000	107.33	482,985,000	106.19	477,877,500	0.5	2049/3/20	2.46
20	日本	国債証券	第333回利付国債（10年）	350,000,000	104.25	364,875,000	103.56	362,463,500	0.6	2024/3/20	1.87
21	日本	国債証券	第46回利付国債（30年）	250,000,000	134.75	336,875,000	131.01	327,525,000	1.5	2045/3/20	1.69
22	日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	300,000,000	103.50	310,500,000	102.69	308,091,000	0.1	2029/6/20	1.59
23	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	100.59	301,788,000	0.08	2026/5/25	1.55
24	日本	国債証券	第58回利付国債（30年）	250,000,000	118.37	295,936,500	114.41	286,040,000	0.8	2048/3/20	1.47
25	日本	国債証券	第50回利付国債（30年）	250,000,000	116.52	291,311,000	114.14	285,372,500	0.8	2046/3/20	1.47
26	日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	250,000,000	104.26	260,650,000	103.42	258,572,500	0.4	2025/3/20	1.33
27	日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	250,000,000	102.31	255,797,000	102.67	256,677,500	0.1	2029/9/20	1.32
28	日本	国債証券	第54回利付国債（30年）	200,000,000	116.61	233,229,000	114.22	228,448,000	0.8	2047/3/20	1.18
29	日本	国債証券	第34回利付国債（30年）	150,000,000	143.87	215,817,000	141.83	212,745,000	2.2	2041/3/20	1.10
30	日本	国債証券	第36回利付国債（30年）	150,000,000	140.56	210,849,000	139.04	208,560,000	2	2042/3/20	1.07

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	83.09
地方債証券	7.32
特殊債券	3.17
社債券	5.74
合計	99.31

業種別投資比率

該当事項はありません。

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。

- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	ドイツ	2,080,861,846	15.88
国債証券	フランス	4,328,299,637	33.04
国債証券	オランダ	841,038,002	6.42
国債証券	スペイン	3,483,757,913	26.59
国債証券	ベルギー	1,384,216,628	10.57
国債証券	オーストリア	815,622,809	6.23
小計		12,933,796,835	98.72
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		167,767,815	1.28
合計（純資産総額）		13,101,564,650	100.00

(2) 投資資産

① 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 4.000 10/25/38	2,700,000	20,145.17	543,919,796	20,583.14	555,744,845	4	2038/10/25	4.24
2	ベルギー	国債証券	BGB 5.000 03/28/35	2,400,000	20,632.47	495,179,367	20,835.81	500,059,546	5	2035/3/28	3.82
3	フランス	国債証券	FRTR 2.500 05/25/30	2,900,000	15,290.26	443,417,703	15,458.71	448,302,695	2.5	2030/5/25	3.42
4	ドイツ	国債証券	DBR 4.000 01/04/37	2,000,000	20,599.86	411,997,338	21,119.04	422,380,954	4	2037/1/4	3.22
5	フランス	国債証券	FRTR 1.250 05/25/34	2,900,000	13,945.08	404,407,552	14,218.21	412,328,218	1.25	2034/5/25	3.15
6	フランス	国債証券	FRTR 2.750 10/25/27	2,700,000	14,908.85	402,538,982	15,001.49	405,040,435	2.75	2027/10/25	3.09
7	ドイツ	国債証券	DBR 4.750 07/04/34	1,900,000	20,873.71	396,600,588	21,293.75	404,581,293	4.75	2034/7/4	3.09
8	スペイン	国債証券	SPGB 4.700 07/30/41	1,900,000	20,849.04	396,131,942	20,975.38	398,532,326	4.7	2041/7/30	3.04
9	スペイン	国債証券	SPGB 4.200 01/31/37	2,100,000	18,712.16	392,955,494	18,781.95	394,420,992	4.2	2037/1/31	3.01
10	フランス	国債証券	FRTR 3.250 05/25/45	1,900,000	19,780.60	375,831,553	20,397.84	387,559,143	3.25	2045/5/25	2.96
11	スペイン	国債証券	SPGB 1.500 04/30/27	2,800,000	13,267.68	371,495,218	13,250.84	371,023,564	1.5	2027/4/30	2.83
12	スペイン	国債証券	SPGB 2.350 07/30/33	2,400,000	14,813.79	355,531,162	14,861.92	356,686,234	2.35	2033/7/30	2.72
13	スペイン	国債証券	SPGB 0.450 10/31/22	2,800,000	12,296.70	344,307,712	12,289.48	344,105,574	0.45	2022/10/31	2.63

14	フランス	国債証券	FRTR 0.500 05/25/25	2,700,000	12,652.85	341,626,982	12,697.36	342,828,979	0.5	2025/5/25	2.62
15	フランス	国債証券	FRTR 5.750 10/25/32	1,600,000	20,828.59	333,257,524	21,108.94	337,743,053	5.75	2032/10/25	2.58
16	フランス	国債証券	FRTR 2.250 10/25/22	2,400,000	12,968.08	311,234,151	12,968.69	311,248,589	2.25	2022/10/25	2.38
17	スペイン	国債証券	SPGB 1.950 07/30/30	2,200,000	14,014.87	308,327,220	14,040.14	308,883,098	1.95	2030/7/30	2.36
18	スペイン	国債証券	SPGB 2.150 10/31/25	2,200,000	13,567.28	298,480,230	13,591.34	299,009,638	2.15	2025/10/31	2.28
19	オランダ	国債証券	NETHER 2.500 01/15/33	1,800,000	16,191.46	291,446,323	16,481.43	296,665,805	2.5	2033/1/15	2.26
20	フランス	国債証券	FRTR 2.250 05/25/24	2,000,000	13,488.47	269,769,472	13,511.33	270,226,688	2.25	2024/5/25	2.06
21	フランス	国債証券	FRTR 4.250 10/25/23	1,900,000	14,208.58	269,963,187	14,211.59	270,020,339	4.25	2023/10/25	2.06
22	ドイツ	国債証券	DBR 0.250 02/15/29	2,000,000	12,810.83	256,216,627	12,994.80	259,896,013	0.25	2029/2/15	1.98
23	フランス	国債証券	FRTR 3.750 04/25/21	2,000,000	12,664.16	253,283,226	12,642.98	252,859,699	3.75	2021/4/25	1.93
24	スペイン	国債証券	SPGB 0.750 07/30/21	2,000,000	12,245.32	244,906,547	12,238.34	244,766,976	0.75	2021/7/30	1.87
25	スペイン	国債証券	SPGB 3.800 04/30/24	1,600,000	14,077.44	225,239,040	14,055.18	224,882,893	3.8	2024/4/30	1.72
26	ドイツ	国債証券	DBR 4.750 07/04/28	1,200,000	17,437.73	209,252,843	17,609.31	211,311,759	4.75	2028/7/4	1.61
27	フランス	国債証券	FRTR 0.500 05/25/26	1,600,000	12,713.61	203,417,805	12,777.98	204,447,744	0.5	2026/5/25	1.56
28	スペイン	国債証券	SPGB 1.950 04/30/26	1,500,000	13,506.52	202,597,824	13,489.67	202,345,152	1.95	2026/4/30	1.54
29	スペイン	国債証券	SPGB 0.600 10/31/29	1,600,000	12,390.55	198,248,858	12,408.60	198,537,626	0.6	2029/10/31	1.52
30	オーストリア	国債証券	RAGB 1.500 02/20/47	1,200,000	15,476.76	185,721,139	16,002.56	192,030,720	1.5	2047/2/20	1.47

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.72
合計	98.72

業種別投資比率

該当事項はありません。

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。

- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」

(1) 投資状況

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	12,595,481,073	96.10
特殊債券	国際機関	399,200,640	3.05
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		112,151,538	0.86
合計（純資産総額）		13,106,833,251	100.00

(2) 投資資産

① 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-BOND 4.375 05/15/40	3,400,000	15,500.58	527,020,011	16,132.37	548,500,776	4.375	2040/5/15	4.18
2	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.625 01/31/26	4,600,000	11,668.82	536,766,121	11,848.36	545,024,666	2.625	2026/1/31	4.16
3	アメリカ	国債証券	T-NOTE 3.625 02/15/21	4,700,000	11,170.40	525,009,233	11,189.21	525,893,223	3.625	2021/2/15	4.01
4	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.625 02/15/44	3,500,000	14,267.79	499,372,693	14,918.38	522,143,535	3.625	2044/2/15	3.98
5	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 02/15/24	4,400,000	11,520.92	506,920,796	11,636.34	511,999,034	2.75	2024/2/15	3.91
6	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 11/15/23	4,400,000	11,487.58	505,453,752	11,593.59	510,118,206	2.75	2023/11/15	3.89
7	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.125 02/15/42	3,500,000	13,182.46	461,386,376	13,784.76	482,466,611	3.125	2042/2/15	3.68
8	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.875 05/31/25	4,000,000	11,749.19	469,967,655	11,907.35	476,294,075	2.875	2025/5/31	3.63
9	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 08/15/25	4,000,000	11,265.30	450,612,223	11,429.45	457,178,024	2	2025/8/15	3.49
10	アメリカ	国債証券	T-BOND 2.500 05/15/46	3,500,000	11,931.28	417,595,139	12,545.12	439,079,325	2.5	2046/5/15	3.35
11	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 11/15/22	3,900,000	11,011.39	429,444,356	11,095.17	432,711,867	1.625	2022/11/15	3.30
12	アメリカ	国債証券	T-BOND 3.125 05/15/48	3,000,000	13,477.54	404,326,410	14,186.57	425,597,208	3.125	2048/5/15	3.25
13	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.500 08/15/23	3,600,000	11,358.49	408,905,713	11,458.51	412,506,645	2.5	2023/8/15	3.15
14	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 05/15/26	3,500,000	11,038.75	386,356,294	11,222.55	392,789,583	1.625	2026/5/15	3.00
15	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.125 08/15/21	3,500,000	11,049.01	386,715,361	11,091.75	388,211,474	2.125	2021/8/15	2.96
16	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 02/15/23	3,400,000	11,139.63	378,747,489	11,234.52	381,973,966	2	2023/2/15	2.91

17	アメリカ	国債証券	T-BOND 5.250 02/15/29	2,600,000	14,346.44	373,007,544	14,640.53	380,653,965	5.25	2029/2/15	2.90
18	アメリカ	国債証券	T-NOTE 3.125 11/15/28	3,000,000	12,344.21	370,326,510	12,610.95	378,328,579	3.125	2028/11/15	2.89
19	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.750 05/15/23	3,200,000	11,067.81	354,170,195	11,163.56	357,234,235	1.75	2023/5/15	2.73
20	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.625 08/15/22	3,200,000	11,007.97	352,255,170	11,084.91	354,717,345	1.625	2022/8/15	2.71
21	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.375 06/30/23	3,200,000	10,937.87	350,011,856	11,039.60	353,267,399	1.375	2023/6/30	2.70
22	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.750 02/15/28	2,800,000	11,946.67	334,506,992	12,191.18	341,353,206	2.75	2028/2/15	2.60
23	アメリカ	国債証券	T-NOTE 3.125 05/15/21	2,900,000	11,166.13	323,817,905	11,193.49	324,611,272	3.125	2021/5/15	2.48
24	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.375 08/15/24	2,700,000	11,406.36	307,971,926	11,540.59	311,595,941	2.375	2024/8/15	2.38
25	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.750 05/15/22	2,800,000	11,029.34	308,821,720	11,099.45	310,784,621	1.75	2022/5/15	2.37
26	アメリカ	国債証券	T-BOND 4.750 02/15/37	1,900,000	15,722.86	298,734,497	16,292.24	309,552,678	4.75	2037/2/15	2.36
27	アメリカ	国債証券	T-NOTE 1.875 04/30/22	2,300,000	11,053.28	254,225,553	11,119.11	255,739,619	1.875	2022/4/30	1.95
28	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.000 02/15/22	2,200,000	11,072.09	243,586,051	11,129.37	244,846,205	2	2022/2/15	1.87
29	アメリカ	国債証券	T-NOTE 2.625 02/15/29	2,000,000	11,920.17	238,403,515	12,185.20	243,704,031	2.625	2029/2/15	1.86
30	国際機関	特殊債券	IADB 2.125 01/15/25	2,000,000	11,238.46	224,769,220	11,414.64	228,292,866	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	96.10
特殊債券	3.05
合計	99.14

業種別投資比率

該当事項はありません。

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。
- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「しんきん高格付外国債券マザーファンド」

(1) 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	カナダ	469,561,657	20.70
国債証券	イギリス	568,948,464	25.08
国債証券	ノルウェー	537,500,943	23.70
国債証券	オーストラリア	536,933,758	23.67
小計		2,112,944,822	93.15
特殊債券	カナダ	84,923,512	3.74
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		70,525,386	3.11
合計（純資産総額）		2,268,393,720	100.00

(2) 投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

評価額上位銘柄（外国債券）

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	34,200,000	1,259.45	430,732,095	1,251.79	428,113,035	3	2024/3/14	18.87
2	カナダ	国債 証券	CAN 1.500 06/01/26	4,700,000	8,239.06	387,235,895	8,338.87	391,927,104	1.5	2026/6/1	17.28
3	オーストラ リア	国債 証券	ACGB 3.250 04/21/25	3,800,000	8,142.07	309,398,689	8,151.05	309,740,044	3.25	2025/4/21	13.65
4	イギリス	国債 証券	UKT 5.000 03/07/25	1,700,000	17,696.80	300,845,673	17,393.21	295,684,716	5	2025/3/7	13.03
5	イギリス	国債 証券	UKT 1.500 07/22/26	1,800,000	15,200.07	273,601,424	15,181.31	273,263,748	1.5	2026/7/22	12.05
6	オーストラ リア	国債 証券	ACGB 2.750 04/21/24	2,900,000	7,774.55	225,462,118	7,834.26	227,193,714	2.75	2024/4/21	10.02
7	ノルウェー	国債 証券	NGB 1.500 02/19/26	9,200,000	1,179.26	108,492,605	1,188.99	109,387,908	1.5	2026/2/19	4.82
8	カナダ	特殊 債券	CANHOU 2.550 12/15/23	1,000,000	8,456.08	84,560,853	8,492.35	84,923,512	2.55	2023/12/15	3.74
9	カナダ	国債 証券	CAN 2.250 06/01/25	900,000	8,622.41	77,601,718	8,626.06	77,634,553	2.25	2025/6/1	3.42

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	93.15
特殊債券	3.74
合計	96.89

業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件
該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「しんきんJリートマザーファンドⅡ」

(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	5,582,709,600	98.63
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		77,421,672	1.37
合計（純資産総額）		5,660,131,272	100.00

(2) 投資資産

① 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	525	810,030	425,266,173	809,000	424,725,000	7.50
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	543	704,962	382,794,598	736,000	399,648,000	7.06
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	1,800	186,328	335,391,734	171,300	308,340,000	5.45
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	824	279,350	230,185,104	292,700	241,184,800	4.26
5	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	1,040	222,693	231,601,614	205,000	213,200,000	3.77
6	日本	投資証券	G L P投資法人	1,420	137,850	195,747,774	136,800	194,256,000	3.43
7	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	210	821,060	172,422,721	806,000	169,260,000	2.99
8	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	820	242,056	198,486,208	205,100	168,182,000	2.97
9	日本	投資証券	産業ファンド投資法人	990	148,195	146,713,960	169,700	168,003,000	2.97
10	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	600	284,532	170,719,221	269,200	161,520,000	2.85
11	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	485	341,265	165,513,987	321,500	155,927,500	2.75
12	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	880	198,104	174,332,109	172,600	151,888,000	2.68
13	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	220	640,221	140,848,722	661,000	145,420,000	2.57
14	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	910	144,764	131,736,068	158,000	143,780,000	2.54
15	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	300	499,030	149,709,149	475,000	142,500,000	2.52
16	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	265	547,831	145,175,288	514,000	136,210,000	2.41
17	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	1,480	91,450	135,346,665	85,300	126,244,000	2.23
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	138	827,981	114,261,474	833,000	114,954,000	2.03
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	650	167,536	108,898,551	169,800	110,370,000	1.95
20	日本	投資証券	日本リート投資法人	233	476,192	110,952,944	466,000	108,578,000	1.92
21	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	4,450	21,013	93,508,417	21,980	97,811,000	1.73
22	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	530	174,886	92,689,598	180,400	95,612,000	1.69

23	日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人	830	116,202	96,448,344	112,600	93,458,000	1.65
24	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	345	262,351	90,511,247	268,400	92,598,000	1.64
25	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	475	202,374	96,127,873	193,400	91,865,000	1.62
26	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	940	99,745	93,760,817	97,600	91,744,000	1.62
27	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	185	442,442	81,851,945	482,500	89,262,500	1.58
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	270	331,174	89,417,123	330,500	89,235,000	1.58
29	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	475	196,496	93,335,880	183,300	87,067,500	1.54
30	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,195	88,176	105,370,762	60,400	72,178,000	1.28

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	98.63
合計	98.63

業種別投資比率

該当事項はありません。

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。
- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

<参考>

「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	3,794,438,161	73.21
投資証券	カナダ	110,889,508	2.14
投資証券	ドイツ	14,950,609	0.29
投資証券	イタリア	1,330,982	0.03
投資証券	フランス	171,106,616	3.30
投資証券	オランダ	11,910,478	0.23
投資証券	スペイン	34,309,409	0.66
投資証券	ベルギー	59,980,453	1.16
投資証券	アイルランド	6,711,427	0.13
投資証券	イギリス	274,324,620	5.29
投資証券	オーストラリア	344,351,496	6.64
投資証券	ニュージーランド	23,270,359	0.45
投資証券	香港	93,336,867	1.80
投資証券	シンガポール	213,530,553	4.12
投資証券	韓国	398,861	0.01
投資証券	イスラエル	4,868,027	0.09
小計		5,159,708,426	99.56
現金・預金およびその他の資産（負債控除後）		23,020,797	0.44
合計（純資産総額）		5,182,729,223	100.00

(2) 投資資産

① 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	27,202	8,886.81	241,739,013	9,488.67	258,110,945	4.98
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,142	62,071.97	195,030,158	65,383.33	205,434,425	3.96
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	11,305	16,807.35	190,007,134	13,766.29	155,627,954	3.00
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,535	26,624.31	147,365,606	23,123.65	127,989,421	2.47
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	14,949	9,553.23	142,811,370	8,270.71	123,638,984	2.39
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,148	23,136.78	119,108,169	22,725.32	116,989,989	2.26
7	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	12,864	9,052.04	116,445,566	8,585.87	110,448,732	2.13
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,690	13,543.05	104,146,107	13,480.68	103,666,442	2.00
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	12,008	8,131.74	97,645,973	7,976.35	95,780,043	1.85
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	13,732	7,649.15	105,038,224	6,019.74	82,663,129	1.59
11	香港	投資証券	LINK REIT	77,300	1,270.62	98,218,926	1,039.66	80,365,873	1.55
12	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,435	34,432.14	83,842,284	32,466.78	79,056,626	1.53
13	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,517	16,546.91	74,742,394	16,926.63	76,457,599	1.48

14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	5,299	14,072.69	74,571,226	14,034.39	74,368,272	1.43
15	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,069	15,557.37	78,860,339	13,409.66	67,973,587	1.31
16	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	59,061	1,031.61	60,928,486	1,118.66	66,069,592	1.27
17	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,234	3,737.03	68,141,087	3,586.02	65,387,509	1.26
18	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	19,835	3,160.33	62,685,312	3,166.90	62,815,545	1.21
19	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	4,203	13,726.89	57,694,158	14,685.50	61,723,182	1.19
20	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	3,415	15,520.45	53,002,360	17,156.43	58,589,227	1.13
21	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	6,348	9,606.85	60,984,345	8,834.28	56,080,034	1.08
22	アメリカ	投資証券	UDR INC	10,805	5,164.00	55,797,038	5,144.30	55,584,208	1.07
23	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,772	12,464.07	59,478,576	11,018.50	52,580,314	1.01
24	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	6,709	7,108.57	47,691,415	7,679.79	51,523,761	0.99
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	13,549	3,613.37	48,957,666	3,707.48	50,232,760	0.97
26	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	196,146	279.84	54,890,791	255.38	50,093,138	0.97
27	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	40,380	1,076.66	43,475,906	1,209.31	48,832,047	0.94
28	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	16,985	2,440.28	41,448,309	2,713.86	46,094,980	0.89
29	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	19,054	2,056.18	39,178,638	2,351.65	44,808,352	0.86
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,571	11,816.25	42,195,834	12,120.46	43,282,187	0.84

投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.56
合計	99.56

業種別投資比率

該当事項はありません。

- ② 投資不動産物件
該当事項はありません。
- ③ その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

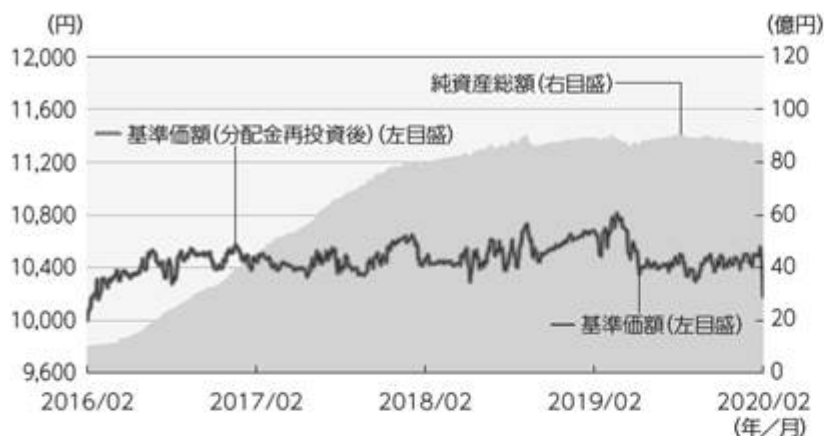
（参考情報）運用実績

データは2020年2月28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	10,182円
純資産総額	8,434百万円

分配の推移（税引前）

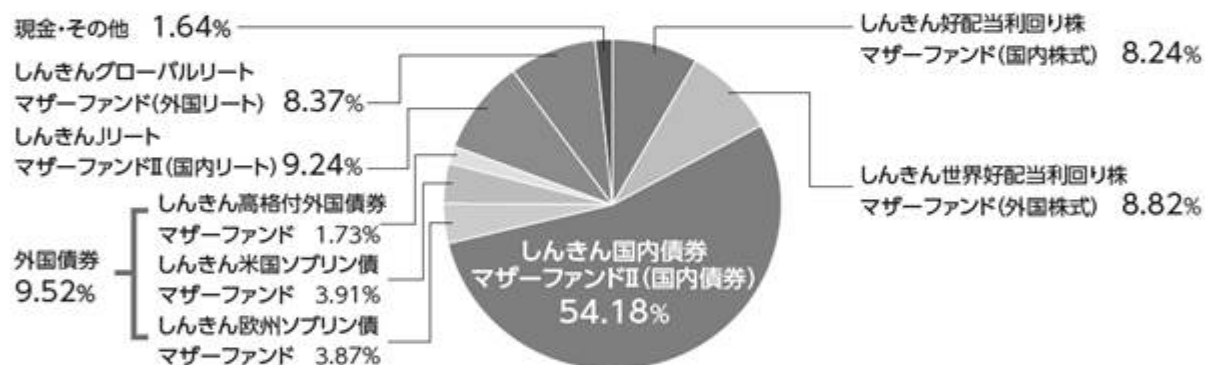
決算期	分配金
2020年 2月	0円
2019年 2月	0円
2018年 2月	0円
2017年 2月	0円
—	—
設定来累計	0円

※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。

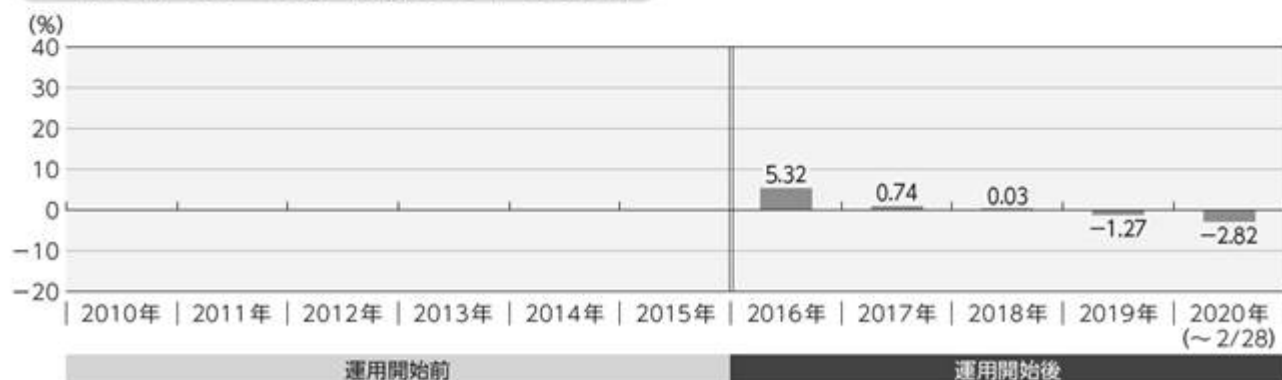
主要な資産の状況

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：2010年～2020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。

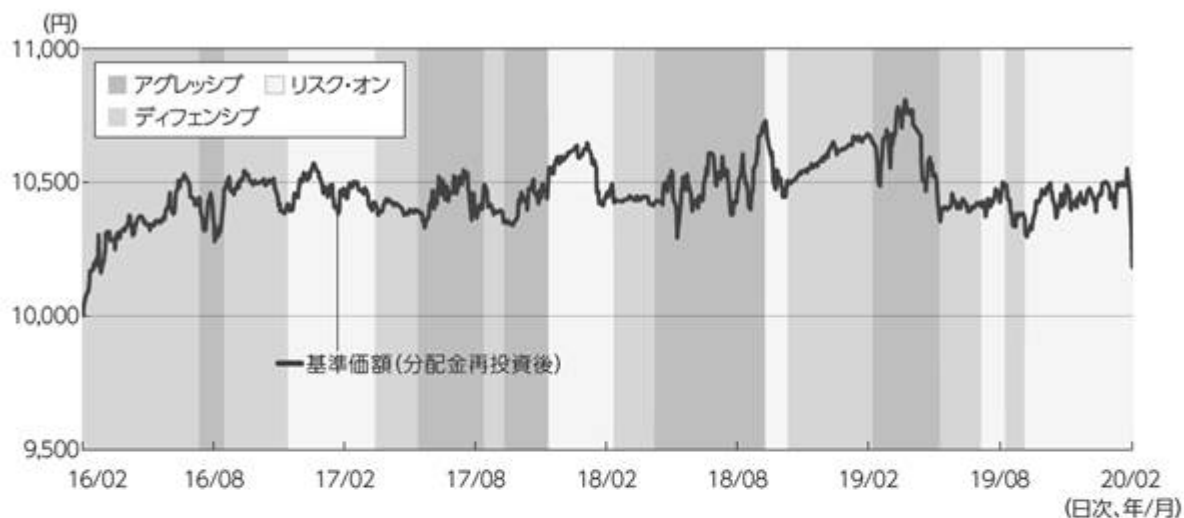
※上記の収益率は決算時の分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

※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

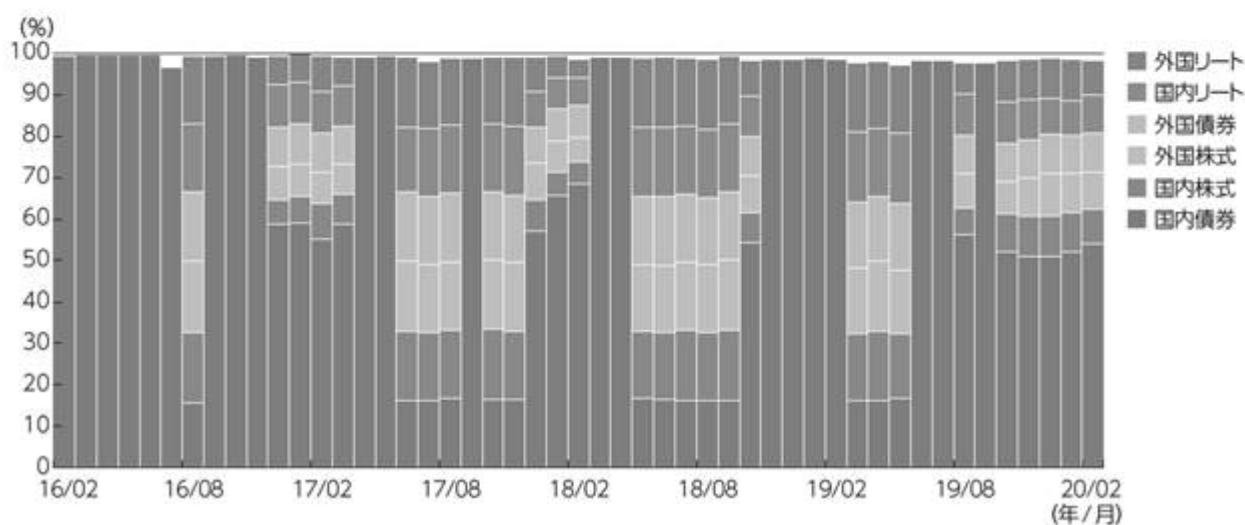
データは2020年2月28日現在です。

■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～2020年2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	伊藤忠商事	卸売業	1.30%	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	銀行	4.77%
2	TKC	情報・通信業	1.26%	ENI SPA	イタリア	エネルギー	4.48%
3	東京エレクトロン	電気機器	1.26%	CENTRICA PLC	イギリス	公益事業	4.30%
4	パナソニック	電気機器	1.26%	WM MORRISON SUPERMARKETS	イギリス	食品・生活必需品小売り	4.21%
5	みらかホールディングス	サービス業	1.25%	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	4.18%
6	カシオ計算機	電気機器	1.22%	ANGLO AMERICAN PLC	イギリス	素材	4.15%
7	MS&AD インシュアランスグループホールディングス	保険業	1.21%	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	4.10%
8	太陽ホールディングス	化学	1.21%	PEARSON PLC	イギリス	メディア・娯楽	3.87%
9	NTTドコモ	情報・通信業	1.21%	SOUTH32 LTD	オーストラリア	素材	3.56%
10	東京海上ホールディングス	保険業	1.21%	HP INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.14%

	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315回利付国債(10年)	1.2%	2021/06/20	5.25%	フランス国債	4.00%	2038/10/25	4.24%
2	第354回利付国債(10年)	0.1%	2029/03/20	4.76%	ベルギー国債	5.00%	2035/03/28	3.82%
3	第322回利付国債(10年)	0.9%	2022/03/20	4.75%	フランス国債	2.50%	2030/05/25	3.42%
4	第317回利付国債(10年)	1.1%	2021/09/20	4.21%	ドイツ国債	4.00%	2037/01/04	3.22%
5	第313回利付国債(10年)	1.3%	2021/03/20	4.19%	フランス国債	1.25%	2034/05/25	3.15%
6	第168回利付国債(20年)	0.4%	2039/03/20	3.78%	フランス国債	2.75%	2027/10/25	3.09%
7	第160回利付国債(20年)	0.7%	2037/03/20	3.69%	ドイツ国債	4.75%	2034/07/04	3.09%
8	第352回利付国債(10年)	0.1%	2028/09/20	3.44%	スペイン国債	4.70%	2041/07/30	3.04%
9	第164回利付国債(20年)	0.5%	2038/03/20	3.30%	スペイン国債	4.20%	2037/01/31	3.01%
10	第22回利付国債(30年)	2.5%	2036/03/20	3.22%	フランス国債	3.25%	2045/05/25	2.96%

	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	4.375%	2040/05/15	4.18%	ノルウェー国債	3.00%	2024/03/14	18.87%
2	アメリカ国債	2.625%	2026/01/31	4.16%	カナダ国債	1.50%	2026/06/01	17.28%
3	アメリカ国債	3.625%	2021/02/15	4.01%	オーストラリア国債	3.25%	2025/04/21	13.65%
4	アメリカ国債	3.625%	2044/02/15	3.98%	イギリス国債	5.00%	2025/03/07	13.03%
5	アメリカ国債	2.750%	2024/02/15	3.91%	イギリス国債	1.50%	2026/07/22	12.05%
6	アメリカ国債	2.750%	2023/11/15	3.89%	オーストラリア国債	2.75%	2024/04/21	10.02%
7	アメリカ国債	3.125%	2042/02/15	3.68%	ノルウェー国債	1.50%	2026/02/19	4.82%
8	アメリカ国債	2.875%	2025/05/31	3.63%	カナダ政府機関債	2.55%	2023/12/15	3.74%
9	アメリカ国債	2.000%	2025/08/15	3.49%	カナダ国債	2.25%	2025/06/01	3.42%
10	アメリカ国債	2.500%	2046/05/15	3.35%				

	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	7.50%	PROLOGIS INC	アメリカ	4.98%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	7.06%	EQUINIX INC	アメリカ	3.96%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.45%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.00%
4	日本プロロジスリート投資法人	4.26%	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.47%
5	オリックス不動産投資法人	3.77%	WELLTOWER INC	アメリカ	2.39%
6	GLP 投資法人	3.43%	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.26%
7	ケネディクス・オフィス投資法人	2.99%	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	2.13%
8	日本リートールファンド投資法人	2.97%	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.00%
9	産業ファンド投資法人	2.97%	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.85%
10	大和ハウスリート投資法人	2.85%	VENTAS INC	アメリカ	1.59%

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】

① 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。

② 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Ⅱ」、「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Ⅱ」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】

- ① 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「①ファンドの繰上償還条項」により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。
- ② 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たときは、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】

- ① 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。
- ② 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】

① 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発します。
- 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。

② 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。

③ 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。

④ 販売会社との契約の更改等

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

⑤ 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。

⑥ 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。

⑦ 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

- ① 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てします。）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てします。当該取得申込みにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

- ② 販売会社は、受益者が自己に帰属する受益権について、あらかじめ収益分配金の再投資に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。
- ③ 受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（2） 償還金に対する請求権

- ① 受益者は、ファンドに係る償還金を持分に応じて請求する権利を有します。
- ② 償還金は、信託終了日後1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します。）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対し委託会社がこの信託の償還をするのと引き換えに、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。
- ③ 償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。
- ④ 受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

（3） 換金（解約）請求権

受益者は、委託会社に受益権の一部解約の実行を請求することにより換金する権利を有します。権利行使の方法等については、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（2019年2月15日から2020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 (2019年2月14日現在)	当期 (2020年2月14日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	—	122,490,145
コール・ローン	200,769,536	120,338,778
親投資信託受益証券	8,759,642,532	8,544,902,040
流動資産合計	8,960,412,068	8,787,730,963
資産合計	8,960,412,068	8,787,730,963
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,326,052	10,998,803
未払受託者報酬	2,390,816	2,453,387
未払委託者報酬	47,816,298	49,067,652
未払利息	495	352
その他未払費用	8,075	2,880
流動負債合計	60,541,736	62,523,074
負債合計	60,541,736	62,523,074
純資産の部		
元本等		
元本	※1,※2 8,352,967,222	※1,※2 8,320,031,943
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	546,903,110	405,175,946
（分配準備積立金）	192,376,979	230,421,614
元本等合計	8,899,870,332	8,725,207,889
純資産合計	8,899,870,332	8,725,207,889
負債純資産合計	8,960,412,068	8,787,730,963

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期 （自 2018年 2月15日 至 2019年 2月14日）	当期 （自 2019年 2月15日 至 2020年 2月14日）
営業収益		
有価証券売買等損益	295,360,642	△38,837,275
営業収益合計	295,360,642	△38,837,275
営業費用		
支払利息	94,778	155,973
受託者報酬	4,612,486	4,823,709
委託者報酬	※1 92,249,658	※1 96,474,087
その他費用	42,635	34,903
営業費用合計	96,999,557	101,488,672
営業利益又は営業損失（△）	198,361,085	△140,325,947
経常利益又は経常損失（△）	198,361,085	△140,325,947
当期純利益又は当期純損失（△）	198,361,085	△140,325,947
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（△）	16,497,822	△19,344,325
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	104,449,240	85,376,618
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	104,449,240	85,376,618
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,576,336	106,122,160
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	53,576,336	106,122,160
分配金	※2 —	※2 —
期末剰余金又は期末欠損金（△）	546,903,110	405,175,946

(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 (2019年2月14日現在)	当期 (2020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 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 1,669,917,892円 期中一部解約元本額 1,702,853,171円
※2 計算期間末日における受益権の総数	8,352,967,222口	8,320,031,943口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 (自 2018年2月15日 至 2019年2月14日)	当期 (自 2019年2月15日 至 2020年2月14日)
※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 「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。	※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 同左
※2 分配金の計算過程 A 費用控除後の配当等収益額 113,073,305円 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 C 収益調整金額 354,526,131円 D 分配準備積立金額 67,692,254円 E 当ファンドの分配対象収益額 546,903,110円 F 当ファンドの期末残存口数 8,352,967,222口 G 10,000口当たり収益分配対象額 654円 H 10,000口当たり分配金額 0円 I 収益分配金金額 0円	※2 分配金の計算過程 A 費用控除後の配当等収益額 69,784,206円 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 C 収益調整金額 174,754,332円 D 分配準備積立金額 160,637,408円 E 当ファンドの分配対象収益額 405,175,946円 F 当ファンドの期末残存口数 8,320,031,943口 G 10,000口当たり収益分配対象額 486円 H 10,000口当たり分配金額 0円 I 収益分配金金額 0円

(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 2018年2月15日 至 2019年2月14日)	当期 (自 2019年2月15日 至 2020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 (2019年2月14日現在)	当期 (2020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	(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
----------------------------	---	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	前期 (2019年2月14日現在)	当期 (2020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	161,257,054円	161,389,013円
合計	161,257,054円	161,389,013円

(デリバティブ取引等に関する注記)

前期 (2019年2月14日現在)	当期 (2020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 2018年2月15日 至 2019年2月14日)	当期 (自 2019年2月15日 至 2020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 (2019年2月14日現在)	当期 (2020年2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 1.0487円 (1万口当たり純資産額 10,487円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	しんきん好配当利回り株マザーファンド	358,892,887	778,043,889	
親投資信託受益証券	しんきんJリートマザーファンドⅡ	313,935,879	854,878,792	
親投資信託受益証券	しんきん欧州ソブリン債マザーファンド	202,211,118	320,423,737	
親投資信託受益証券	しんきん米国ソブリン債マザーファンド	190,276,743	324,593,095	
親投資信託受益証券	しんきん世界好配当利回り株マザーファンド	352,557,151	824,525,409	
親投資信託受益証券	しんきん国内債券マザーファンドⅡ	3,375,045,916	4,522,561,527	
親投資信託受益証券	しんきん高格付外国債券マザーファンド	115,877,495	147,419,349	
親投資信託受益証券	しんきんグローバルリートマザーファンド	379,138,236	772,456,242	
親投資信託受益証券 合計		5,287,935,425	8,544,902,040	
合計		5,287,935,425	8,544,902,040	

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Ⅱ」、「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Ⅱ」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、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		2020年２月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		206,033,150
コール・ローン		202,414,468
株式		29,864,274,690
未収配当金		91,223,000
流動資産合計		30,363,945,308
資産合計		30,363,945,308
負債の部		
流動負債		
未払利息		593
その他未払費用		9,314
流動負債合計		9,907
負債合計		9,907
純資産の部		
元本等		
元本	※１，※２	14,006,279,717
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		16,357,655,684
元本等合計		30,363,935,401
純資産合計		30,363,935,401
負債純資産合計		30,363,945,308

(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	株式 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	2020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 12,526,373,571円 期中追加設定元本額 6,190,457,191円 期中一部解約元本額 4,710,551,045円
元本の内訳	しんきん3資産ファンド（毎月決算型） 9,347,949,927円 しんきん好配当利回り株ファンド（3ヵ月決算型） 1,601,245,418円 しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,293,576,269円 しんきん世界アロケーションファンド 805,910,911円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 358,892,887円 しんきん3資産ファンド（1年決算型） 90,923,846円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 22,617,987円 しんきん好配当利回り株スペシャルII（適格機関投資家限定） 358,026,895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） 127,135,577円 合計 14,006,279,717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	14,006,279,717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 2019年2月15日 至 2020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。
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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	649,209,563円
合計	649,209,563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）

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 2.1679円 (1万口当たり純資産額 21,679円)

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

銘柄	株式数（株）	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
ホクト	177,300	2,003.00	355,131,900	
大林組	304,300	1,249.00	380,070,700	
大東建託	25,100	12,715.00	319,146,500	
積水ハウス	146,700	2,407.00	353,106,900	
麒麟ホールディングス	142,600	2,532.00	361,063,200	
日本たばこ産業	140,200	2,276.50	319,165,300	
帝人	165,400	2,010.00	332,454,000	
オンワードホールディングス	546,200	624.00	340,828,800	
クラレ	258,900	1,344.00	347,961,600	
三菱ケミカルホールディングス	412,700	796.20	328,591,740	
三洋化成工業	64,300	4,935.00	317,320,500	
太陽ホールディングス	78,800	5,000.00	394,000,000	
マンダム	116,400	2,633.00	306,481,200	
日東電工	55,700	6,100.00	339,770,000	
武田薬品工業	79,300	4,298.00	340,831,400	
アステラス製薬	190,500	1,906.50	363,188,250	
大塚ホールディングス	76,800	4,741.00	364,108,800	
出光興産	108,300	2,827.00	306,164,100	
J X T Gホールディングス	660,200	475.80	314,123,160	
横浜ゴム	161,100	1,907.00	307,217,700	
ブリヂストン	82,500	3,891.00	321,007,500	
A G C	86,600	3,500.00	303,100,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	247,200	1,228.00	303,561,600	
住友金属鉱山	96,900	3,172.00	307,366,800	

住友電気工業	218,800	1,469.00	321,417,200	
三和ホールディングス	271,300	1,135.00	307,925,500	
L I X I Lグループ	177,000	1,945.00	344,265,000	
アマダホールディングス	271,000	1,119.00	303,249,000	
小松製作所	129,500	2,336.50	302,576,750	
SANKYO	89,900	3,905.00	351,059,500	
マックス	171,100	2,082.00	356,230,200	
日本精工	331,000	919.00	304,189,000	
三菱重工業	77,600	3,868.00	300,156,800	
スター精密	219,700	1,347.00	295,935,900	
コニカミノルタ	479,700	659.00	316,122,300	
三菱電機	222,000	1,567.00	347,874,000	
マブチモーター	79,700	4,125.00	328,762,500	
I D E C	151,300	1,906.00	288,377,800	
パナソニック	339,400	1,207.50	409,825,500	
マクセルホールディングス	227,000	1,471.00	333,917,000	
カシオ計算機	182,500	2,055.00	375,037,500	
キヤノン	115,400	2,830.00	326,582,000	
東京エレクトロン	15,700	25,685.00	403,254,500	
デンソー	68,200	4,481.00	305,604,200	
トヨタ自動車	43,900	7,729.00	339,303,100	
アイシン精機	83,000	3,705.00	307,515,000	
本田技研工業	112,900	2,960.00	334,184,000	
S U B A R U	125,100	2,857.00	357,410,700	
ヤマハ発動機	158,100	1,953.00	308,769,300	
ニプロ	271,000	1,252.00	339,292,000	
トッパン・フォームズ	316,500	1,170.00	370,305,000	
大日本印刷	116,900	2,980.00	348,362,000	
中国電力	233,000	1,461.00	340,413,000	
日本通運	52,800	5,910.00	312,048,000	
九州旅客鉄道	92,400	3,635.00	335,874,000	
日本航空	101,700	3,099.00	315,168,300	
住友倉庫	224,400	1,473.00	330,541,200	
トレンドマイクロ	61,000	6,000.00	366,000,000	
日本テレビホールディングス	240,900	1,478.00	356,050,200	
日本電信電話	125,200	2,798.50	350,372,200	
N T T ドコモ	115,300	3,112.00	358,813,600	
T K C	71,900	5,450.00	391,855,000	
伊藤忠商事	147,000	2,617.00	384,699,000	
三井物産	180,100	1,943.00	349,934,300	
住友商事	207,500	1,685.00	349,637,500	
サンゲツ	162,200	1,857.00	301,205,400	
リョーサン	121,600	2,480.00	301,568,000	

東陽テクニカ	30,100	1,054.00	31,725,400	
因幡電機産業	136,400	2,698.00	368,007,200	
ローソン	56,500	6,200.00	350,300,000	
青山商事	205,100	1,324.00	271,552,400	
ヤマダ電機	632,900	593.00	375,309,700	
あおぞら銀行	122,600	3,075.00	376,995,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	587,300	572.30	336,111,790	
りそなホールディングス	717,000	456.80	327,525,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	83,800	4,023.00	337,127,400	
三井住友フィナンシャルグループ	86,400	3,867.00	334,108,800	
みずほフィナンシャルグループ	2,016,300	161.00	324,624,300	
大和証券グループ本社	671,200	558.00	374,529,600	
野村ホールディングス	667,400	562.00	375,078,800	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	97,100	3,759.00	364,998,900	
東京海上ホールディングス	58,000	6,140.00	356,120,000	
T&Dホールディングス	261,000	1,247.00	325,467,000	
野村不動産ホールディングス	134,800	2,806.00	378,248,800	
パーク24	132,900	2,806.00	372,917,400	
みらかホールディングス	129,500	2,833.00	366,873,500	
ユー・エス・エス	167,300	1,929.00	322,721,700	
日本郵政	339,400	1,002.00	340,078,800	
メイテック	59,600	5,980.00	356,408,000	
合計	19,018,800		29,864,274,690	

- ② 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

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。

「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		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		1,428,157,260
金銭信託		139,324,708
コール・ローン		136,877,666
株式		21,508,844,770
未収配当金		18,263,698
流動資産合計		23,231,468,102
資産合計		23,231,468,102
負債の部		
流動負債		
未払利息		401
その他未払費用		4,450
流動負債合計		4,851
負債合計		4,851
純資産の部		
元本等		
元本	※１,※２	9,933,297,248
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		13,298,166,003
元本等合計		23,231,463,251
純資産合計		23,231,463,251
負債純資産合計		23,231,468,102

(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	株式 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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買取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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2020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 7,472,421,419円 期中追加設定元本額 5,919,409,064円 期中一部解約元本額 3,458,533,235円
元本の内訳	しんきん世界好配当利回り株ファンド（毎月決算型） 7,283,240,872円 しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 1,229,319,248円 しんきん世界アロケーションファンド 792,388,600円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 352,557,151円 しんきん世界好配当利回り株ファンド（1年決算型） 130,180,791円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 20,770,369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） 124,840,217円 合計 9,933,297,248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	9,933,297,248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 2019年2月15日 至 2020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。
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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	160,892,855円
合計	160,892,855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)

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 2.3387円 (1万口当たり純資産額 23,387円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

① 株式

通貨	銘柄	株式数(株)	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	OMNICOM GROUP	47,915	79.53	3,810,679.95	
米ドル	GAP INC/THE	111,388	18.33	2,041,742.04	
米ドル	CITIGROUP INC	52,933	79.00	4,181,707.00	
米ドル	WELLS FARGO & CO	11,404	48.12	548,760.48	
米ドル	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	137,320	50.93	6,993,707.60	
米ドル	INTL BUSINESS MACHINES CORP	71,846	154.31	11,086,556.26	
米ドル	CISCO SYSTEMS INC	103,345	47.32	4,890,285.40	
米ドル	HP INC	278,529	22.22	6,188,914.38	
米ドル	VISHAY INTERTECHNOLOGY INC	29,936	21.03	629,554.08	
米ドル	INTEL CORP	107,467	67.44	7,247,574.48	
米ドル 小計		952,083		47,619,481.67 (5,232,904,840)	
ユーロ	ENI SPA	672,072	12.98	8,728,871.13	
ユーロ	REPSOL SA	489,104	12.66	6,194,502.16	
ユーロ	SOCIETE BIC SA	69,993	61.50	4,304,569.50	

ユーロ	DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	5,608	43.24	242,517.96	
ユーロ	Schaeffler AG Preference NPV	248,171	9.56	2,372,514.76	
ユーロ	PUBLICIS GROUPE SA	83,303	40.77	3,396,263.31	
ユーロ	RTL GROUP S.A.	96,463	41.46	3,999,355.98	
ユーロ	TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	572,433	6.95	3,981,271.51	
ユーロ	SANOFI	81,811	92.38	7,557,700.18	
ユーロ	BNP PARIBAS	22,907	53.57	1,227,127.99	
ユーロ	ING GROEP NV	246,960	10.77	2,660,253.12	
ユーロ	INTESA SANPAOLOA	2,400,399	2.51	6,025,001.49	
ユーロ	UNICREDIT SPA	409,964	14.02	5,750,974.99	
ユーロ	AGEAS	35,129	52.48	1,843,569.92	
ユーロ 小計		5,434,317		58,284,494.00 (6,941,100,390)	
英ポンド	ANGLO AMERICAN PLC	375,735	21.32	8,010,670.20	
英ポンド	ROYAL MAIL PLC	992,182	1.78	1,770,052.68	
英ポンド	PEARSON PLC	1,022,259	5.56	5,687,849.07	
英ポンド	WPP PLC	229,038	9.79	2,242,740.09	
英ポンド	TESCO PLC	1,937,874	2.52	4,885,380.35	
英ポンド	WM MORRISON SUPERMARKETS	3,726,181	1.79	6,671,727.08	
英ポンド	GLAXOSMITHKLINE PLC	144,497	16.81	2,429,572.55	
英ポンド	BARCLAYS PLC	1,330,466	1.76	2,345,877.65	
英ポンド	HSBC HOLDINGS PLC	1,356,269	5.89	8,000,630.83	
英ポンド	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,479,384	2.28	5,670,351.20	
英ポンド	STANDARD CHARTERED PLC	789,639	6.34	5,007,890.53	
英ポンド	CENTRICA PLC	8,467,184	0.71	6,081,131.54	
英ポンド 小計		22,850,708		58,803,873.77 (8,432,475,498)	
オーストラリアドル	SOUTH32 LTD	4,717,713	2.59	12,218,876.67	
オーストラリアドル 小計		4,717,713		12,218,876.67 (902,364,042)	
合計		33,954,821		21,508,844,770 (21,508,844,770)	

② 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式10銘柄	100.0%	24.3%
ユーロ	株式14銘柄	100.0%	32.3%
英ポンド	株式12銘柄	100.0%	39.2%
オーストラリアドル	株式1銘柄	100.0%	4.2%

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。

「しんきん国内債券マザーファンドⅡ」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Ⅱ

(1) 貸借対照表

区分		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		30,378,690
コール・ローン		29,845,131
国債証券		16,045,727,000
地方債証券		1,417,091,000
特殊債券		614,124,000
社債券		1,007,723,000
未収利息		60,626,259
前払費用		553,284
流動資産合計		19,206,068,364
資産合計		19,206,068,364
負債の部		
流動負債		
未払利息		87
その他未払費用		689
流動負債合計		776
負債合計		776
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※2	14,332,401,792
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		4,873,665,796
元本等合計		19,206,067,588
純資産合計		19,206,067,588
負債純資産合計		19,206,068,364

(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	2020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 29,436,175,876円 期中追加設定元本額 23,862,110,784円 期中一部解約元本額 38,965,884,868円
元本の内訳	しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 2,106,707,064円 しんきん世界アロケーションファンド 7,648,289,701円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 3,375,045,916円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 36,767,252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） 1,165,591,859円 合計 14,332,401,792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	14,332,401,792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 2019年2月15日 至 2020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。
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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△311,062,500円
地方債証券	△2,508,000円
特殊債券	△4,487,000円
社債券	△2,064,000円
合計	△320,121,500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)

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年２月14日現在
１口当たり純資産額 1.3400円
（１万口当たり純資産額 13,400円）

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第３１３回利付国債（１０年）	800,000,000	812,560,000	
国債証券	第３１４回利付国債（１０年）	350,000,000	354,732,000	
国債証券	第３１５回利付国債（１０年）	1,000,000,000	1,018,010,000	
国債証券	第３１７回利付国債（１０年）	800,000,000	815,856,000	
国債証券	第３１８回利付国債（１０年）	600,000,000	610,938,000	
国債証券	第３２２回利付国債（１０年）	900,000,000	919,665,000	
国債証券	第３３３回利付国債（１０年）	350,000,000	360,860,500	
国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	250,000,000	257,045,000	
国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	150,000,000	152,569,500	
国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	650,000,000	660,400,000	
国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	900,000,000	913,563,000	
国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	300,000,000	304,362,000	
国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	50,000,000	50,698,000	
国債証券	第２２回利付国債（３０年）	450,000,000	616,090,500	
国債証券	第３２回利付国債（３０年）	100,000,000	139,874,000	
国債証券	第３４回利付国債（３０年）	150,000,000	209,002,500	
国債証券	第３６回利付国債（３０年）	150,000,000	204,724,500	
国債証券	第３８回利付国債（３０年）	150,000,000	199,870,500	
国債証券	第４２回利付国債（３０年）	150,000,000	198,058,500	
国債証券	第４６回利付国債（３０年）	250,000,000	320,360,000	
国債証券	第５０回利付国債（３０年）	250,000,000	278,555,000	
国債証券	第５４回利付国債（３０年）	200,000,000	223,092,000	
国債証券	第５８回利付国債（３０年）	250,000,000	278,767,500	
国債証券	第６２回利付国債（３０年）	450,000,000	464,751,000	
国債証券	第６１回利付国債（２０年）	600,000,000	621,480,000	
国債証券	第１１６回利付国債（２０年）	400,000,000	489,980,000	
国債証券	第１２５回利付国債（２０年）	400,000,000	496,996,000	
国債証券	第１３５回利付国債（２０年）	400,000,000	479,568,000	
国債証券	第１４４回利付国債（２０年）	400,000,000	473,856,000	
国債証券	第１４８回利付国債（２０年）	450,000,000	537,129,000	
国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	500,000,000	578,720,000	

国債証券	第160回利付国債（20年）	650,000,000	704,853,500	
国債証券	第164回利付国債（20年）	600,000,000	629,766,000	
国債証券	第168回利付国債（20年）	650,000,000	668,973,500	
国債証券 合計		14,700,000,000	16,045,727,000	
地方債証券	第8回東京都公募公債（7年）	100,000,000	100,579,000	
地方債証券	第719回東京都公募公債	100,000,000	102,612,000	
地方債証券	第729回東京都公募公債	100,000,000	102,776,000	
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	203,590,000	
地方債証券	平成25年度第4回広島県公募公債	100,000,000	102,496,000	
地方債証券	平成28年度第3回埼玉県公募公債	300,000,000	301,020,000	
地方債証券	平成28年度第6回福岡県公募公債	100,000,000	101,026,000	
地方債証券	第496回名古屋市長公募公債（10年）	200,000,000	200,556,000	
地方債証券	平成28年度第4回福井県公募公債	200,000,000	202,436,000	
地方債証券 合計		1,400,000,000	1,417,091,000	
特殊債券	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	207,656,000	
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	202,640,000	
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	101,685,000	
特殊債券	第19回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,143,000	
特殊債券 合計		600,000,000	614,124,000	
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	100,584,000	
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	100,822,000	
社債券	第37回王子ホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,443,000	
社債券	第14回株式会社オリエンタルランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,229,000	
社債券	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,706,000	
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	100,214,000	
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	100,209,000	
社債券	第51回三菱UFJリース株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	100,160,000	
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付）	200,000,000	205,356,000	
社債券 合計		1,000,000,000	1,007,723,000	
合計		17,700,000,000	19,084,665,000	

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。

「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		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		35,174,593
金銭信託		17,133,355
コール・ローン		16,832,431
国債証券		12,754,283,313
未収利息		114,587,986
前払費用		12,804,348
流動資産合計		12,950,816,026
資産合計		12,950,816,026
負債の部		
流動負債		
未払解約金		4,500,000
未払利息		49
その他未払費用		578
流動負債合計		4,500,627
負債合計		4,500,627
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※2	8,169,968,755
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		4,776,346,644
元本等合計		12,946,315,399
純資産合計		12,946,315,399
負債純資産合計		12,950,816,026

(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	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2020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
	6,656,337,456円
	期中追加設定元本額
	3,417,705,307円
	期中一部解約元本額
	1,904,074,008円

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	195,359,742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	187,621,991円
	しんきん3資産ファンド（毎月決算型）	6,398,718,895円
	しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）	591,114,264円
	しんきん世界アロケーションファンド	447,454,760円
	しんきん世界アロケーションファンド（積極型）	202,211,118円
	しんきん3資産ファンド（1年決算型）	62,387,950円
	しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）	10,346,623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）	74,753,412円
	合計	8,169,968,755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		8,169,968,755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 2019年2月15日 至 2020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。
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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。

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。
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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	15,676,412円
合計	15,676,412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）

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 1.5846円 (1万口当たり純資産額 15,846円)

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	ユーロ	BGB 0.800 06/22/25	1,000,000.00	1,057,100.00	
国債証券	ユーロ	BGB 0.800 06/22/27	1,300,000.00	1,402,960.00	
国債証券	ユーロ	BGB 0.900 06/22/29	1,000,000.00	1,098,300.00	

国債証券	ユーロ	BGB 1.600 06/22/47	1,200,000.00	1,500,240.00	
国債証券	ユーロ	BGB 2.600 06/22/24	900,000.00	1,009,980.00	
国債証券	ユーロ	BGB 4.000 03/28/22	1,100,000.00	1,191,960.00	
国債証券	ユーロ	BGB 5.000 03/28/35	2,400,000.00	4,097,520.00	
国債証券	ユーロ	DBR 0.250 02/15/29	2,000,000.00	2,130,720.00	
国債証券	ユーロ	DBR 0.500 02/15/25	1,000,000.00	1,057,180.00	
国債証券	ユーロ	DBR 0.500 02/15/26	600,000.00	640,122.00	
国債証券	ユーロ	DBR 1.000 08/15/25	1,000,000.00	1,090,120.00	
国債証券	ユーロ	DBR 1.500 02/15/23	1,400,000.00	1,491,882.00	
国債証券	ユーロ	DBR 1.750 07/04/22	900,000.00	951,957.00	
国債証券	ユーロ	DBR 2.000 01/04/22	600,000.00	630,462.00	
国債証券	ユーロ	DBR 2.250 09/04/21	1,000,000.00	1,045,020.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.000 01/04/37	2,000,000.00	3,427,000.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.750 07/04/28	1,200,000.00	1,739,112.00	
国債証券	ユーロ	DBR 4.750 07/04/34	1,900,000.00	3,298,723.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 0.500 05/25/25	2,700,000.00	2,840,265.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 0.500 05/25/26	1,600,000.00	1,691,040.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 1.250 05/25/34	2,900,000.00	3,371,540.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 2.250 05/25/24	2,000,000.00	2,241,700.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 2.250 10/25/22	2,400,000.00	2,585,880.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 2.500 05/25/30	2,900,000.00	3,689,090.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 2.750 10/25/27	2,700,000.00	3,347,190.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 3.250 05/25/45	1,900,000.00	3,137,470.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 3.750 04/25/21	2,000,000.00	2,103,680.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 4.000 10/25/38	2,700,000.00	4,534,110.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 4.250 10/25/23	1,900,000.00	2,242,570.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 5.500 04/25/29	700,000.00	1,073,240.00	
国債証券	ユーロ	FRTR 5.750 10/25/32	1,600,000.00	2,773,760.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 0.250 07/15/25	800,000.00	833,960.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 0.250 07/15/29	600,000.00	631,620.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 0.500 01/15/40	600,000.00	651,600.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 0.750 07/15/27	800,000.00	870,240.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 1.750 07/15/23	700,000.00	757,295.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 2.500 01/15/33	1,800,000.00	2,425,860.00	
国債証券	ユーロ	NETHER 3.250 07/15/21	700,000.00	738,430.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 0.500 04/20/27	1,000,000.00	1,062,200.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 0.750 02/20/28	400,000.00	434,120.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 1.200 10/20/25	1,000,000.00	1,095,100.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 1.500 02/20/47	1,200,000.00	1,547,640.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 1.750 10/20/23	800,000.00	861,280.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 2.400 05/23/34	1,100,000.00	1,470,700.00	
国債証券	ユーロ	RAGB 3.650 04/20/22	200,000.00	218,720.00	

国債証券	ユーロ	SPGB 0.450 10/31/22	2,800,000.00	2,864,680.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 0.600 10/31/29	1,600,000.00	1,653,920.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 0.750 07/30/21	2,000,000.00	2,036,100.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 1.500 04/30/27	2,800,000.00	3,094,840.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 1.950 04/30/26	1,500,000.00	1,686,825.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 1.950 07/30/30	2,200,000.00	2,571,360.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 2.150 10/31/25	2,200,000.00	2,484,460.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 2.350 07/30/33	2,400,000.00	2,970,000.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 3.800 04/30/24	1,600,000.00	1,873,600.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 4.200 01/31/37	2,100,000.00	3,284,610.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 4.700 07/30/41	1,900,000.00	3,315,500.00	
国債証券	ユーロ	SPGB 5.400 01/31/23	1,000,000.00	1,171,300.00	
ユーロ 小計			86,300,000.00	107,097,853.00 (12,754,283,313)	
国債証券 合計				12,754,283,313 (12,754,283,313)	
合計				12,754,283,313 (12,754,283,313)	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
ユーロ	国債証券57銘柄	100.0%	100.0%

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。

「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		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		53,533,251
金銭信託		15,215,507
コール・ローン		14,948,269
国債証券		12,742,750,840
特殊債券		393,873,232
未収利息		120,636,427
前払費用		2,556,922
流動資産合計		13,343,514,448
資産合計		13,343,514,448
負債の部		
流動負債		
未払解約金		7,000,000
未払利息		43
その他未払費用		508
流動負債合計		7,000,551
負債合計		7,000,551
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※2	7,817,926,649
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		5,518,587,248
元本等合計		13,336,513,897
純資産合計		13,336,513,897
負債純資産合計		13,343,514,448

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2020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
	6,621,964,854円
	期中追加設定元本額
	3,089,689,724円
	期中一部解約元本額
	1,893,727,929円

元本の内訳	しんきん海外ソブリン債セレクション 米国ソブリン債ポートフォリオ	220,122,930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	180,668,045円
	しんきん3資産ファンド（毎月決算型）	6,104,942,547円
	しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）	561,972,798円
	しんきん世界アロケーションファンド	421,713,290円
	しんきん世界アロケーションファンド（積極型）	190,276,743円
	しんきん3資産ファンド（1年決算型）	58,107,030円
	しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）	9,636,517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）	70,486,749円
	合計	7,817,926,649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		7,817,926,649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 2019年2月15日 至 2020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。
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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。

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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△31,434,980円
特殊債券	△54,945円
合計	△31,489,925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)

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 1.7059円 (1万口当たり純資産額 17,059円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	T-BOND 2.500 05/15/46	3,500,000.00	3,792,304.70	

国債証券	米ドル	T-BOND 3.125 02/15/42	3,500,000.00	4,194,804.70	
国債証券	米ドル	T-BOND 3.125 05/15/48	3,700,000.00	4,527,585.95	
国債証券	米ドル	T-BOND 3.625 02/15/44	3,500,000.00	4,536,328.12	
国債証券	米ドル	T-BOND 4.375 05/15/40	3,400,000.00	4,789,484.39	
国債証券	米ドル	T-BOND 4.750 02/15/37	1,900,000.00	2,716,554.69	
国債証券	米ドル	T-BOND 5.250 02/15/29	2,600,000.00	3,397,062.50	
国債証券	米ドル	T-BOND 6.250 08/15/23	1,100,000.00	1,281,070.31	
国債証券	米ドル	T-BOND 6.500 11/15/26	1,000,000.00	1,321,562.50	
国債証券	米ドル	T-BOND 7.875 02/15/21	1,000,000.00	1,062,890.63	
国債証券	米ドル	T-BOND 8.125 05/15/21	1,900,000.00	2,056,898.44	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.375 06/30/23	3,200,000.00	3,195,000.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.625 05/15/26	3,500,000.00	3,521,875.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.625 08/15/22	3,200,000.00	3,216,500.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.625 08/15/29	1,800,000.00	1,801,125.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.625 11/15/22	3,900,000.00	3,920,109.37	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.750 05/15/22	2,800,000.00	2,819,468.76	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.750 05/15/23	3,200,000.00	3,232,500.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 1.875 04/30/22	2,300,000.00	2,321,203.12	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.000 02/15/22	2,200,000.00	2,223,718.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.000 02/15/23	3,400,000.00	3,457,640.64	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.000 08/15/25	4,000,000.00	4,110,312.51	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.125 08/15/21	3,500,000.00	3,532,265.62	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.375 08/15/24	2,700,000.00	2,809,265.62	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.500 08/15/23	3,600,000.00	3,731,625.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.625 01/31/26	4,600,000.00	4,893,609.39	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.625 02/15/29	2,000,000.00	2,170,781.26	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.625 11/15/20	3,600,000.00	3,628,406.26	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.750 02/15/24	4,400,000.00	4,624,468.77	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.750 02/15/28	2,800,000.00	3,048,281.26	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.750 11/15/23	4,400,000.00	4,611,406.27	
国債証券	米ドル	T-NOTE 2.875 05/31/25	4,000,000.00	4,286,250.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.125 05/15/21	2,900,000.00	2,957,093.75	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.125 11/15/28	3,000,000.00	3,373,125.00	
国債証券	米ドル	T-NOTE 3.625 02/15/21	4,700,000.00	4,796,570.33	
米ドル 小計			106,800,000.00	115,959,148.61 (12,742,750,840)	
国債証券 合計				12,742,750,840 (12,742,750,840)	
特殊債券	米ドル	IADB 2.125 01/15/25	2,000,000.00	2,055,000.00	
特殊債券	米ドル	IBRD 1.875 10/27/26	1,500,000.00	1,529,250.00	
米ドル 小計			3,500,000.00	3,584,250.00 (393,873,232)	

特殊債券 合計		393,873,232 (393,873,232)	
合計		13,136,624,072 (13,136,624,072)	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券35銘柄	97.0%	97.0%
	特殊債券 2 銘柄	3.0%	3.0%

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。

「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		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		52,173,945
金銭信託		2,742,748
コール・ローン		2,694,576
国債証券		2,132,829,754
特殊債券		85,623,328
未収利息		20,157,134
前払費用		4,800,207
流動資産合計		2,301,021,692
資産合計		2,301,021,692
負債の部		
流動負債		
未払金		10,781,818
未払利息		7
その他未払費用		93
流動負債合計		10,781,918
負債合計		10,781,918
純資産の部		
元本等		
元本	※ 1, ※ 2	1,800,277,157
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		489,962,617
元本等合計		2,290,239,774
純資産合計		2,290,239,774
負債純資産合計		2,301,021,692

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

(貸借対照表に関する注記)

区分	2020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 1,278,192,390円 期中追加設定元本額 1,652,987,090円 期中一部解約元本額 1,130,902,323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） 747,099,227円 しんきん世界アロケーションファンド 252,114,702円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 115,877,495円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 12,935,095円 しんきん高格付外国債券スペシャル（適格機関投資家限定） 625,258,858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） 46,991,780円 合計 1,800,277,157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	1,800,277,157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 2019年2月15日 至 2020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。
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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	△21,075,302円
特殊債券	△179,850円
合計	△21,255,152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)

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 1.2722円 (1万口当たり純資産額 12,722円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	カナダドル	CAN 1.500 06/01/26	4,700,000.00	4,729,422.00	
国債証券	カナダドル	CAN 2.250 06/01/25	900,000.00	939,177.00	
カナダドル 小計			5,600,000.00	5,668,599.00 (469,813,485)	
国債証券	英ポンド	UKT 1.500 07/22/26	1,800,000.00	1,914,210.00	
国債証券	英ポンド	UKT 5.000 03/07/25	1,700,000.00	2,080,630.00	
英ポンド 小計			3,500,000.00	3,994,840.00 (572,860,056)	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 1.500 02/19/26	9,200,000.00	9,286,480.00	
国債証券	ノルウェークローネ	NGB 3.000 03/14/24	34,200,000.00	36,474,300.00	
ノルウェークローネ 小計			43,400,000.00	45,760,780.00 (543,180,458)	

国債証券	オーストラリアドル	ACGB 2.750 04/21/24	2,900,000.00	3,134,610.00	
国債証券	オーストラリアドル	ACGB 3.250 04/21/25	3,800,000.00	4,271,967.60	
オーストラリアドル 小計			6,700,000.00	7,406,577.60 (546,975,755)	
国債証券 合計				2,132,829,754 (2,132,829,754)	
特殊債券	カナダドル	CANHOU 2.550 12/15/23	1,000,000.00	1,033,100.00	
カナダドル 小計			1,000,000.00	1,033,100.00 (85,623,328)	
特殊債券 合計				85,623,328 (85,623,328)	
合計				2,218,453,082 (2,218,453,082)	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
カナダドル	国債証券 2 銘柄	84.6%	21.2%
	特殊債券 1 銘柄	15.4%	3.8%
英ポンド	国債証券 2 銘柄	100.0%	25.8%
ノルウェークローネ	国債証券 2 銘柄	100.0%	24.5%
オーストラリアドル	国債証券 2 銘柄	100.0%	24.7%

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。

「しんきんJリートマザーファンドⅡ」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JリートマザーファンドⅡ

(1) 貸借対照表

区分		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
金銭信託		17,203,714
コール・ローン		16,901,555
投資証券		6,177,254,800
未収入金		12,186,595
未収配当金		45,255,235
流動資産合計		6,268,801,899
資産合計		6,268,801,899
負債の部		
流動負債		
未払金		25,928,824
未払利息		49
その他未払費用		1,277
流動負債合計		25,930,150
負債合計		25,930,150
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※2	2,292,593,837
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		3,950,277,912
元本等合計		6,242,871,749
純資産合計		6,242,871,749
負債純資産合計		6,268,801,899

(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	2020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 1,203,021,071円 期中追加設定元本額 4,813,828,346円 期中一部解約元本額 3,724,255,580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） 1,070,229,581円 しんきん世界アロケーションファンド 706,311,687円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 313,935,879円 しんきん3資産ファンド（1年決算型） 72,952,770円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 18,147,457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） 111,016,463円 合計 2,292,593,837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	2,292,593,837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 2019年2月15日 至 2020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。
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。

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。
-------------------	--

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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る場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	364,801,805円
合計	364,801,805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)

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

2020年２月14日現在
１口当たり純資産額 2.7231円
（１万口当たり純資産額 27,231円）

（３）附属明細表

第１ 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	サンケイリアルエステート投資法人	280	37,716,000	
投資証券	S O S i L A物流リート投資法人	360	45,360,000	
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	220	157,080,000	
投資証券	MCUBS M i d C i t y投資法人	830	104,995,000	
投資証券	森ヒルズリート投資法人	610	113,704,000	
投資証券	産業ファンド投資法人	1,000	179,000,000	
投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	485	164,657,500	
投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	334	71,576,200	
投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	265	151,580,000	
投資証券	G L P投資法人	1,420	208,882,000	
投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	275	96,387,500	
投資証券	日本プロロジスリート投資法人	800	248,400,000	
投資証券	O n e リート投資法人	150	56,850,000	
投資証券	イオンリート投資法人	570	82,878,000	
投資証券	ヒューリックリート投資法人	390	81,159,000	
投資証券	日本リート投資法人	233	117,199,000	
投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,450	107,690,000	
投資証券	積水ハウス・リート投資法人	1,480	137,640,000	
投資証券	ケネディクス商業リート投資法人	205	55,575,500	
投資証券	ヘルスケア&メディカル投資法人	90	12,213,000	
投資証券	サムティ・レジデンシャル投資法人	110	12,254,000	
投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	1,800	361,080,000	
投資証券	ラサールロジポート投資法人	930	169,446,000	
投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	170	87,550,000	
投資証券	投資法人みらい	600	36,360,000	
投資証券	森トラスト・ホテルリート投資法人	150	22,200,000	
投資証券	三菱地所物流リート投資法人	150	61,275,000	
投資証券	C R Eロジスティクスファンド投資法人	313	46,073,600	
投資証券	ザイマックス・リート投資法人	80	11,312,000	
投資証券	タカラレーベン不動産投資法人	155	20,491,000	
投資証券	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	40	5,112,000	

投資証券	日本ビルファンド投資法人	498	437,742,000	
投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	540	429,840,000	
投資証券	日本リテールファンド投資法人	820	192,044,000	
投資証券	オリックス不動産投資法人	1,055	252,356,000	
投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	300	148,800,000	
投資証券	プレミア投資法人	400	65,360,000	
投資証券	東急リアル・エステート投資法人	500	103,900,000	
投資証券	グローバル・ワン不動産投資法人	220	31,614,000	
投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	900	171,360,000	
投資証券	森トラスト総合リート投資法人	500	99,700,000	
投資証券	インヴィンシブル投資法人	1,780	96,832,000	
投資証券	フロンティア不動産投資法人	120	54,120,000	
投資証券	平和不動産リート投資法人	250	37,400,000	
投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	345	98,842,500	
投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	210	185,220,000	
投資証券	いちごオフィスリート投資法人	645	75,723,000	
投資証券	大和証券オフィス投資法人	125	111,625,000	
投資証券	阪急阪神リート投資法人	210	37,800,000	
投資証券	大和ハウスリート投資法人	600	177,000,000	
投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,300	94,380,000	
投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,060	114,586,000	
投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	490	97,314,000	
投資証券 合計		31,813	6,177,254,800	
合計		31,813	6,177,254,800	

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。

「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		2020年2月14日現在
科目	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		5,406,312
金銭信託		666,724
コール・ローン		655,013
投資証券		5,752,544,955
未収入金		3,218,193
未収配当金		14,152,919
流動資産合計		5,776,644,116
資産合計		5,776,644,116
負債の部		
流動負債		
未払利息		1
その他未払費用		60
流動負債合計		61
負債合計		61
純資産の部		
元本等		
元本	※1, ※2	2,835,288,650
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）		2,941,355,405
元本等合計		5,776,644,055
純資産合計		5,776,644,055
負債純資産合計		5,776,644,116

(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	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。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本報告書における開示対象ファンドの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。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	2020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 1,479,859,049円 期中追加設定元本額 5,425,189,621円 期中一部解約元本額 4,069,760,020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） 1,447,357,680円 しんきん世界アロケーションファンド 850,137,571円 しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 379,138,236円 しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 24,325,922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） 134,329,241円 合計 2,835,288,650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	2,835,288,650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 2019年2月15日 至 2020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。
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」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、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。
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。

2. 金融商品の時価等に関する事項

区分	2020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。
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。
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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2020年2月14日現在
種類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	331,937,038円
合計	331,937,038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）

2020年2月14日現在
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 2019年2月15日 至 2020年2月14日
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

2020年2月14日現在
1口当たり純資産額 2.0374円 (1万口当たり純資産額 20,374円)

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

- ① 株式
該当事項はありません。

② 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	3,258	82,134.18	
投資証券	米ドル	AGREE REALTY CORP	1,589	121,383.71	
投資証券	米ドル	ALEXANDER'S INC	78	25,322.70	
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	4,594	797,426.52	
投資証券	米ドル	AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,797	82,662.00	
投資証券	米ドル	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,149	244,526.01	
投資証券	米ドル	AMERICAN FINANCE TRUST INC	4,000	53,840.00	
投資証券	米ドル	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	9,550	278,860.00	
投資証券	米ドル	AMERICOLD REALTY TRUST	7,185	268,000.50	
投資証券	米ドル	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	5,579	301,991.27	
投資証券	米ドル	APPLE HOSPITALITY REIT INC	7,885	119,773.15	
投資証券	米ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	21,500	18,382.50	
投資証券	米ドル	ASHFORD HOSPITALITY TRUST INC	3,474	8,962.92	

投資証券	米ドル	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,233	1,180,512.47	
投資証券	米ドル	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT	862	9,999.20	
投資証券	米ドル	BOSTON PROPERTIES INC	5,388	784,385.04	
投資証券	米ドル	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1,225	10,081.75	
投資証券	米ドル	BRANDYWINE REALTY TRUST	6,602	105,301.90	
投資証券	米ドル	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,160	228,891.60	
投資証券	米ドル	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	2,453	45,723.92	
投資証券	米ドル	BRT APARTMENTS CORP	409	7,075.70	
投資証券	米ドル	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,629	426,661.53	
投資証券	米ドル	CARETRUST REIT INC	3,581	81,682.61	
投資証券	米ドル	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	7,102	5,044.55	
投資証券	米ドル	CEDAR REALTY TRUST INC	3,529	9,951.78	
投資証券	米ドル	CHATHAM LODGING TRUST	1,758	30,343.08	
投資証券	米ドル	CITY OFFICE REIT INC	2,044	28,513.80	
投資証券	米ドル	CLIPPER REALTY INC	542	6,162.54	
投資証券	米ドル	COLONY CAPITAL INC	18,248	89,232.72	
投資証券	米ドル	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,381	98,441.07	
投資証券	米ドル	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	697	34,808.18	
投資証券	米ドル	CORECIVIC INC	4,462	75,407.80	
投資証券	米ドル	COREPOINT LODGING INC	1,602	15,971.94	
投資証券	米ドル	CORESITE REALTY CORP	1,412	159,753.68	
投資証券	米ドル	CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST	4,199	124,290.40	
投資証券	米ドル	COUSINS PROPERTIES INC	5,499	232,552.71	
投資証券	米ドル	CUBESMART	7,252	235,544.96	
投資証券	米ドル	CYRUSONE INC	4,242	283,323.18	
投資証券	米ドル	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	7,501	78,310.44	
投資証券	米ドル	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,821	989,591.13	
投資証券	米ドル	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	8,914	68,192.10	
投資証券	米ドル	DOUGLAS EMMETT INC	6,176	274,337.92	
投資証券	米ドル	DUKE REALTY CORP	13,773	522,547.62	
投資証券	米ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	19,600	10,388.00	
投資証券	米ドル	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES, INC.	2,779	69,586.16	
投資証券	米ドル	EASTGROUP PROPERTIES INC	1,439	203,805.57	
投資証券	米ドル	EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	5,595	76,539.60	
投資証券	米ドル	EPR PROPERTIES	2,940	206,417.40	
投資証券	米ドル	EQUINIX INC	3,195	2,031,221.25	
投資証券	米ドル	EQUITY COMMONWEALTH	4,568	151,931.68	
投資証券	米ドル	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	6,822	506,874.60	
投資証券	米ドル	EQUITY RESIDENTIAL	13,080	1,114,677.60	
投資証券	米ドル	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	3,295	93,709.80	
投資証券	米ドル	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,476	796,058.76	

投資証券	米ドル	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,853	548,583.12	
投資証券	米ドル	FARMLAND PARTNERS INC	1,103	7,334.95	
投資証券	米ドル	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,632	328,605.20	
投資証券	米ドル	FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,757	218,108.45	
投資証券	米ドル	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,583	82,397.70	
投資証券	米ドル	FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	4,018	32,264.54	
投資証券	米ドル	FRONT YARD RESIDENTIAL CORPORATION	1,772	19,952.72	
投資証券	米ドル	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	7,642	374,075.90	
投資証券	米ドル	GEO GROUP INC/THE	4,544	79,247.36	
投資証券	米ドル	GETTY REALTY CORP	1,281	41,863.08	
投資証券	米ドル	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,160	25,230.00	
投資証券	米ドル	GLADSTONE LAND CORP	756	10,553.76	
投資証券	米ドル	GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,385	21,606.00	
投資証券	米ドル	GLOBAL NET LEASE INC	3,352	72,135.04	
投資証券	米ドル	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,011	182,901.50	
投資証券	米ドル	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	7,763	253,617.21	
投資証券	米ドル	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,546	691,394.88	
投資証券	米ドル	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,297	18,300.67	
投資証券	米ドル	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,887	203,328.97	
投資証券	米ドル	HOST HOTELS & RESORTS INC	26,872	453,330.64	
投資証券	米ドル	HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	5,806	221,731.14	
投資証券	米ドル	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	3,406	56,199.00	
投資証券	米ドル	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	2,443	57,630.37	
投資証券	米ドル	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	585	55,247.40	
投資証券	米ドル	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	436	36,715.56	
投資証券	米ドル	INVITATION HOMES INC	20,172	652,564.20	
投資証券	米ドル	IRON MOUNTAIN INC	10,759	358,920.24	
投資証券	米ドル	JBG SMITH PROPERTIES	4,423	185,235.24	
投資証券	米ドル	KILROY REALTY CORP	3,654	320,711.58	
投資証券	米ドル	KIMCO REALTY CORP	15,821	299,491.53	
投資証券	米ドル	KITE REALTY GROUP TRUST	3,147	56,111.01	
投資証券	米ドル	LEXINGTON REALTY TRUST	9,288	105,883.20	
投資証券	米ドル	LIFE STORAGE INC	1,748	201,020.00	
投資証券	米ドル	LTC PROPERTIES INC	1,489	72,812.10	
投資証券	米ドル	MACERICH CO/THE	4,129	94,388.94	
投資証券	米ドル	MACK-CALI REALTY CORP	3,393	74,951.37	
投資証券	米ドル	MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	55,268	58,031.40	
投資証券	米ドル	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	19,388	457,750.68	
投資証券	米ドル	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	4,274	616,054.36	
投資証券	米ドル	MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,634	54,437.32	

投資証券	米ドル	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,432	361,864.32	
投資証券	米ドル	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,223	82,539.99	
投資証券	米ドル	NATL HEALTH INVESTORS INC	1,647	144,656.01	
投資証券	米ドル	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	3,078	24,962.58	
投資証券	米ドル	NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	834	42,709.14	
投資証券	米ドル	OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	1,807	62,052.38	
投資証券	米ドル	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	8,187	357,853.77	
投資証券	米ドル	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	539	15,242.92	
投資証券	米ドル	PARAMOUNT GROUP INC	7,544	110,972.24	
投資証券	米ドル	PARK HOTELS & RESORTS INC	8,970	211,871.40	
投資証券	米ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	4,895	123,256.10	
投資証券	米ドル	PENNSYLVANIA REIT	2,447	9,151.78	
投資証券	米ドル	PHYSICIANS REALTY TRUST	6,944	141,727.04	
投資証券	米ドル	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	4,713	114,667.29	
投資証券	米ドル	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	452	9,374.48	
投資証券	米ドル	PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	1,823	21,511.40	
投資証券	米ドル	PRIME US REIT	12,700	13,081.00	
投資証券	米ドル	PROLOGIS INC	27,663	2,668,649.61	
投資証券	米ドル	PS BUSINESS PARKS INC	750	127,732.50	
投資証券	米ドル	PUBLIC STORAGE	5,629	1,286,564.24	
投資証券	米ドル	QTS REALTY TRUST INC	2,177	130,358.76	
投資証券	米ドル	REALTY INCOME CORP	12,212	962,183.48	
投資証券	米ドル	REGENCY CENTERS CORP	6,279	394,509.57	
投資証券	米ドル	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,346	73,317.02	
投資証券	米ドル	RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	8,006	99,514.58	
投資証券	米ドル	RETAIL VALUE INC	553	18,984.49	
投資証券	米ドル	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	4,156	214,989.88	
投資証券	米ドル	RLJ LODGING TRUST	6,389	104,332.37	
投資証券	米ドル	RPT REALTY	3,012	43,824.60	
投資証券	米ドル	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,040	184,028.40	
投資証券	米ドル	SABRA HEALTH CARE REIT INC	7,258	155,611.52	
投資証券	米ドル	SAFEHOLD INC	453	23,841.39	
投資証券	米ドル	SAUL CENTERS INC	429	20,956.65	
投資証券	米ドル	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	1,256	47,388.88	
投資証券	米ドル	SERVICE PROPERTIES TRUST	6,166	138,919.98	
投資証券	米ドル	SIMON PROPERTY GROUP INC	11,498	1,594,312.68	
投資証券	米ドル	SITE CENTERS CORP	5,592	72,304.56	
投資証券	米ドル	SL GREEN REALTY CORP	3,054	289,091.64	
投資証券	米ドル	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	3,737	198,957.88	
投資証券	米ドル	STAG INDUSTRIAL INC	5,571	181,837.44	
投資証券	米ドル	STORE CAPITAL CORP	8,006	314,635.80	
投資証券	米ドル	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,930	45,470.10	

投資証券	米ドル	SUN COMMUNITIES INC	3,473	576,413.81	
投資証券	米ドル	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	8,425	113,147.75	
投資証券	米ドル	TANGER FACTORY OUTLET CENTERS	3,481	45,670.72	
投資証券	米ドル	TAUBMAN CENTERS INC	2,294	121,994.92	
投資証券	米ドル	TERRENO REALTY CORP	2,511	153,622.98	
投資証券	米ドル	UDR INC	10,981	544,767.41	
投資証券	米ドル	UMH PROPERTIES INC	1,317	21,638.31	
投資証券	米ドル	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	474	61,795.38	
投資証券	米ドル	URBAN EDGE PROPERTIES	4,315	79,352.85	
投資証券	米ドル	URSTADT BIDDLE - CLASS A	1,119	26,330.07	
投資証券	米ドル	VENTAS INC	13,966	817,709.30	
投資証券	米ドル	VEREIT INC	40,006	394,059.10	
投資証券	米ドル	VICI PROPERTIES INC	17,274	481,771.86	
投資証券	米ドル	VORNADO REALTY TRUST	5,935	401,799.50	
投資証券	米ドル	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,806	19,465.16	
投資証券	米ドル	WASHINGTON REIT	3,020	96,700.40	
投資証券	米ドル	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4,532	137,364.92	
投資証券	米ドル	WELLTOWER INC	15,204	1,333,390.80	
投資証券	米ドル	WHITESTONE REIT	1,458	19,726.74	
投資証券	米ドル	WP CAREY INC	6,455	551,063.35	
投資証券	米ドル	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,221	82,689.39	
米ドル 小計			944,264	38,928,118.11 (4,277,810,899)	
投資証券	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REIT	2,255	132,255.75	
投資証券	カナダドル	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,532	30,763.80	
投資証券	カナダドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	849	42,585.84	
投資証券	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REIT	3,110	181,002.00	
投資証券	カナダドル	CHOICE PROPERTIES REIT	5,697	83,859.84	
投資証券	カナダドル	COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,342	50,397.36	
投資証券	カナダドル	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,610	25,727.80	
投資証券	カナダドル	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,865	31,089.55	
投資証券	カナダドル	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	2,442	34,798.50	
投資証券	カナダドル	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT	1,032	34,819.68	
投資証券	カナダドル	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,023	87,339.33	
投資証券	カナダドル	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	992	72,812.80	
投資証券	カナダドル	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	5,252	112,602.88	
投資証券	カナダドル	INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,226	38,420.76	
投資証券	カナダドル	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,742	36,582.00	
投資証券	カナダドル	MINTO APARTMENT REIT	717	18,477.09	

投資証券	カナダドル	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	781	15,877.73	
投資証券	カナダドル	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,205	38,487.70	
投資証券	カナダドル	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REIT	2,746	35,917.68	
投資証券	カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,823	161,180.64	
投資証券	カナダドル	SLATE OFFICE REIT	1,363	7,987.18	
投資証券	カナダドル	SLATE RETAIL REIT - U	839	11,284.55	
投資証券	カナダドル	SMARTCENTRES REIT VAR VT UN	2,634	83,313.42	
投資証券	カナダドル	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	2,545	35,019.20	
投資証券	カナダドル	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	1,434	11,228.22	
カナダドル 小計			59,056	1,413,831.30 (117,178,338)	
投資証券	ユーロ	AEDIFICA	921	119,730.00	
投資証券	ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5,911	109,176.17	
投資証券	ユーロ	ALTAREA	131	26,593.00	
投資証券	ユーロ	BEFIMMO	857	48,077.70	
投資証券	ユーロ	COFINIMMO	920	137,632.00	
投資証券	ユーロ	COVIVIO	1,665	183,649.50	
投資証券	ユーロ	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	1,542	35,712.72	
投資証券	ユーロ	GECINA SA	2,055	368,256.00	
投資証券	ユーロ	HAMBORNER REIT AG	2,629	27,462.53	
投資証券	ユーロ	HIBERNIA REIT PLC	25,654	34,017.20	
投資証券	ユーロ	ICADE	1,052	108,461.20	
投資証券	ユーロ	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	1,986	12,392.64	
投資証券	ユーロ	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	9,139	119,538.12	
投資証券	ユーロ	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	817	22,753.45	
投資証券	ユーロ	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	16,013	24,307.73	
投資証券	ユーロ	KLEPIERRE	7,833	241,178.07	
投資証券	ユーロ	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,269	16,177.97	
投資証券	ユーロ	MERCIALYS	1,021	11,884.44	
投資証券	ユーロ	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	13,730	180,549.50	
投資証券	ユーロ	MONTEA	411	40,319.10	
投資証券	ユーロ	NSI NV	626	31,863.40	
投資証券	ユーロ	RETAIL ESTATES	407	33,781.00	
投資証券	ユーロ	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	5,157	636,373.80	
投資証券	ユーロ	VASTNED RETAIL NV	683	18,611.75	
投資証券	ユーロ	WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,847	135,861.41	
投資証券	ユーロ	WERELDHAVE NV	1,601	25,567.97	
ユーロ 小計			109,877	2,749,928.37 (327,488,969)	
投資証券	英ポンド	AEW UK REIT PLC	6,622	6,423.34	
投資証券	英ポンド	ASSURA PLC	90,005	73,804.10	
投資証券	英ポンド	BIG YELLOW GROUP PLC	5,807	69,219.44	

投資証券	英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	35,280	203,001.12	
投資証券	英ポンド	CAPITAL & REGIONAL PLC	2,023	4,292.80	
投資証券	英ポンド	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	23,323	22,576.66	
投資証券	英ポンド	DERWENT LONDON PLC	3,945	163,954.20	
投資証券	英ポンド	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	22,564	22,925.02	
投資証券	英ポンド	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	9,512	89,869.37	
投資証券	英ポンド	HAMMERSON PLC	28,862	68,460.66	
投資証券	英ポンド	INTU PROPERTIES PLC	38,014	4,827.77	
投資証券	英ポンド	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,150	273,336.50	
投資証券	英ポンド	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	31,472	73,329.76	
投資証券	英ポンド	LXI REIT PLC	19,538	26,141.84	
投資証券	英ポンド	NEWRIVER REIT PLC	11,473	21,844.59	
投資証券	英ポンド	PICTON PROPERTY INCOME LTD	20,519	20,806.26	
投資証券	英ポンド	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	45,504	72,806.40	
投資証券	英ポンド	RDI REIT PLC	9,326	12,496.84	
投資証券	英ポンド	REGIONAL REIT LTD	15,198	18,267.99	
投資証券	英ポンド	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,843	64,547.89	
投資証券	英ポンド	SCHRODER REIT LTD	23,283	12,386.55	
投資証券	英ポンド	SEGRO PLC	41,091	378,612.47	
投資証券	英ポンド	SHAFTESBURY PLC	8,290	74,858.70	
投資証券	英ポンド	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	12,477	12,102.69	
投資証券	英ポンド	TRITAX BIG BOX REIT PLC	63,960	92,869.92	
投資証券	英ポンド	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	31,647	26,805.00	
投資証券	英ポンド	UNITE GROUP PLC	13,621	178,571.31	
投資証券	英ポンド	WORKSPACE GROUP PLC	4,792	61,002.16	
英ポンド 小計			654,141	2,150,141.35 (308,330,269)	
投資証券	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	13,304	50,422.16	
投資証券	オーストラリアドル	APN INDUSTRIA REIT	4,842	14,961.78	
投資証券	オーストラリアドル	ARENA REIT	11,041	35,110.38	
投資証券	オーストラリアドル	BWP TRUST	18,120	72,298.80	
投資証券	オーストラリアドル	CENTURIA OFFICE REIT	12,856	40,882.08	
投資証券	オーストラリアドル	CHARTER HALL GROUP	17,345	223,577.05	
投資証券	オーストラリアドル	CHARTER HALL LONG WALE REIT	15,271	87,197.41	
投資証券	オーストラリアドル	CHARTER HALL RETAIL REIT	13,355	66,240.80	
投資証券	オーストラリアドル	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE	9,292	33,358.28	

投資証券	オーストラリアドル	CROMWELL PROPERTY GROUP	70,483	85,284.43	
投資証券	オーストラリアドル	DEXUS	40,601	531,873.10	
投資証券	オーストラリアドル	GDI PROPERTY GROUP	18,477	28,546.96	
投資証券	オーストラリアドル	GOODMAN GROUP	60,052	978,847.60	
投資証券	オーストラリアドル	GPT GROUP	72,189	452,625.03	
投資証券	オーストラリアドル	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	10,488	45,517.92	
投資証券	オーストラリアドル	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	5,924	20,734.00	
投資証券	オーストラリアドル	INGENIA COMMUNITIES GROUP	9,719	48,400.62	
投資証券	オーストラリアドル	MIRVAC GROUP	148,291	489,360.30	
投資証券	オーストラリアドル	NATIONAL STORAGE REIT	29,528	65,256.88	
投資証券	オーストラリアドル	RURAL FUNDS GROUP	13,328	27,322.40	
投資証券	オーストラリアドル	SCENTRE GROUP	199,499	756,101.21	
投資証券	オーストラリアドル	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	34,914	108,931.68	
投資証券	オーストラリアドル	STOCKLAND	91,219	453,358.43	
投資証券	オーストラリアドル	VICINITY CENTRES	120,406	302,219.06	
投資証券	オーストラリアドル	VIVA ENERGY REIT	17,263	47,991.14	
オーストラリアドル 小計			1,057,807	5,066,419.50 (374,155,080)	
投資証券	ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,994	43,546.57	
投資証券	ニュージーランドドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	41,540	96,165.10	
投資証券	ニュージーランドドル	KIWI PROPERTY GROUP INC	58,793	90,835.18	
投資証券	ニュージーランドドル	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND LTD	40,365	75,886.20	
投資証券	ニュージーランドドル	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	12,491	36,161.44	
ニュージーランドドル 小計			184,183	342,594.49 (24,245,412)	
投資証券	香港ドル	CHAMPION REIT	75,000	352,500.00	
投資証券	香港ドル	FORTUNE REIT	53,000	470,110.00	
投資証券	香港ドル	LINK REIT	78,600	6,189,750.00	

投資証券	香港ドル	PROSPERITY REIT	44,000	131,120.00	
投資証券	香港ドル	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	38,000	185,440.00	
投資証券	香港ドル	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	55,000	280,500.00	
香港ドル 小計			343,600	7,609,420.00 (107,673,293)	
投資証券	シンガポールドル	AIMS APAC REIT	16,715	24,236.75	
投資証券	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,261	370,461.30	
投資証券	シンガポールドル	ASCOTT RESIDENCE TRUST	69,289	87,304.14	
投資証券	シンガポールドル	CACHE LOGISTICS TRUST	35,834	25,442.14	
投資証券	シンガポールドル	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	106,988	223,604.92	
投資証券	シンガポールドル	CAPITALAND MALL TRUST	106,400	269,192.00	
投資証券	シンガポールドル	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	28,570	43,997.80	
投資証券	シンガポールドル	CDL HOSPITALITY TRUSTS	30,450	45,675.00	
投資証券	シンガポールドル	ESR-REIT	77,049	41,606.46	
投資証券	シンガポールドル	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	30,800	20,790.00	
投資証券	シンガポールドル	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,200	23,200.00	
投資証券	シンガポールドル	FRASERS CENTREPOINT TRUST	27,221	79,485.32	
投資証券	シンガポールドル	FRASERS COMMERCIAL TRUST	25,380	43,146.00	
投資証券	シンガポールドル	FRASERS HOSPITALITY TRUST	31,200	21,684.00	
投資証券	シンガポールドル	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	58,370	75,881.00	
投資証券	シンガポールドル	KEPPEL DC REIT	45,840	113,683.20	
投資証券	シンガポールドル	KEPPEL REIT	72,150	91,630.50	
投資証券	シンガポールドル	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	77,400	17,415.00	
投資証券	シンガポールドル	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	80,509	190,001.24	
投資証券	シンガポールドル	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	56,880	162,676.80	
投資証券	シンガポールドル	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	112,388	223,652.12	
投資証券	シンガポールドル	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	80,200	95,438.00	

投資証券	シンガポールドル	OUE COMMERCIAL REIT	94,500	49,140.00	
投資証券	シンガポールドル	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	15,500	55,800.00	
投資証券	シンガポールドル	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	36,456	16,952.04	
投資証券	シンガポールドル	SASSEUR REIT	20,700	16,974.00	
投資証券	シンガポールドル	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	34,560	17,452.80	
投資証券	シンガポールドル	SPH REIT	13,000	13,780.00	
投資証券	シンガポールドル	STARHILL GLOBAL REIT	50,700	35,997.00	
投資証券	シンガポールドル	SUNTEC REIT	87,100	158,522.00	
シンガポールドル 小計			1,657,610	2,654,821.53 (209,863,641)	
投資証券	韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	623	4,691,190.00	
韓国ウォン 小計			623	4,691,190.00 (436,280)	
投資証券	イスラエル・シェケル	REIT 1 LTD	7,315	167,220.90	
イスラエル・シェケル 小計			7,315	167,220.90 (5,362,774)	
投資証券 合計				5,752,544,955 (5,752,544,955)	
合計				5,752,544,955 (5,752,544,955)	

注1 通貨種類毎の小計欄の（ ）内は、邦貨換算額であります。

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

注3 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券157銘柄	100.0%	74.4%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	5.7%
英ポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	5.4%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.6%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエル・シェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（2020年2月28日現在）

しんきん世界アロケーションファンド(積極型)

I 資産総額	8,456,259,907 円
II 負債総額	22,319,590 円
III 純資産総額（I－II）	8,433,940,317 円
IV 発行済数量	8,283,473,360 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0182 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II」、「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II」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

I 資産総額	28,183,506,042 円
II 負債総額	346,449,645 円
III 純資産総額（I－II）	27,837,056,397 円
IV 発行済数量	14,370,106,888 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9372 円

しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

I 資産総額	21,243,697,948 円
II 負債総額	5,971 円
III 純資産総額（I－II）	21,243,691,977 円
IV 発行済数量	10,073,134,203 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1089 円

しんきん国内債券マザーファンドII

I 資産総額	19,768,619,423 円
II 負債総額	357,348,896 円
III 純資産総額（I－II）	19,411,270,527 円
IV 発行済数量	14,338,486,115 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3538 円

しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

I 資産総額	13,186,565,512 円
II 負債総額	85,000,862 円
III 純資産総額（I－II）	13,101,564,650 円
IV 発行済数量	8,116,407,388 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.6142 円

しんきん米国ソブリン債マザーファンド

I 資産総額	13,566,835,155 円
II 負債総額	460,001,904 円
III 純資産総額（I－II）	13,106,833,251 円
IV 発行済数量	7,556,388,120 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.7345 円

しんきん高格付外国債券マザーファンド

I 資産総額	2,273,393,875 円
II 負債総額	5,000,155 円
III 純資産総額（I－II）	2,268,393,720 円
IV 発行済数量	1,798,590,967 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2612 円

しんきんJリートマザーファンドII

I 資産総額	5,668,927,191 円
II 負債総額	8,795,919 円
III 純資産総額（I－II）	5,660,131,272 円
IV 発行済数量	2,280,058,685 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.4824 円

しんきんグローバルリートマザーファンド

I 資産総額	5,292,729,639 円
II 負債総額	110,000,416 円
III 純資産総額（I－II）	5,182,729,223 円
IV 発行済数量	2,784,804,517 口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8611 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

① 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ます。

② 上記①の申請のある場合には、上記①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ます。ただし、上記①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ます。

③ 上記①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た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てします。）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します。

○投資運用の意思決定機構

① 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。

② 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。

③ 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、2020年2月28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	77	830,305
単位型公社債投資信託	13	68,300
単位型株式投資信託	38	110,981
合計	128	1,009,588

（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。
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）ならびに同規則第38条および第57条の規定により「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
2. 財務諸表および中間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）の財務諸表ならびに中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査および中間監査を受けております。

1 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

		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)	
科 目	注記 番号	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

		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)	
科 目	注記 番号	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】

		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	
科 目	注記 番号	金 額		金 額	
営業収益		千円	千円	千円	千円
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

		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	
科 目	注記 番号	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					
	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	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	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)
2.固定資産の減価償却の方法	(1)有形固定資産 定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下のとおりです。 建 物 3年 ～ 50年 器 具 備 品 3年 ～ 20年 (2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づいております。
3.引当金の計上基準	(1)賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しています。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当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。 (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。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理 消費税および地方消費税の会計処理は、税抜方式によっています。 なお、仮払消費税等および仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(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
簡便法で計算した退職給付費用	千円 12,149	千円 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) 0.0582%	(2018年3月分) 0.0676%

(3) 補足説明	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。 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。	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。 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。
----------	--	--

(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**①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。

②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**①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。

②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	一千円	一千円
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。

2 中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

当中間会計期間末 2019年9月30日		
科 目	金 額	
	千円	千円
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		5,590,817
前払費用		28,865
未収委託者報酬		536,055
未収運用受託報酬		4,843
未収収益		50
その他の流動資産		4,430
流動資産計		6,165,062
固定資産		
有形固定資産 ※ 1		88,734
建物	68,217	
器具備品	20,517	
無形固定資産		19,751
ソフトウェア	18,399	
電話加入権	959	
その他	392	
投資その他の資産		39,386
投資有価証券	2,575	
長期前払費用	6,650	
繰延税金資産	30,161	
固定資産計		147,873
資産合計		6,312,936

当中間会計期間末 2019年9月30日		
科 目	金 額	
	千円	千円
(負債の部)		
流動負債		
未払金		376,434
未払手数料	322,681	
その他未払金	53,752	
未払法人税等		204,652
未払消費税等 ※ 2		32,351
未払事業所税		1,027
前受収益		64,849
賞与引当金		54,865
その他の流動負債		3,879
流動負債計		738,058
固定負債		
退職給付引当金		106,025
役員退職慰労引当金		14,513
固定負債計		120,539
負債合計		858,598
(純資産の部)		
株主資本		5,454,285
資本金		200,000
利益剰余金		5,254,285
利益準備金	2,000	
その他利益剰余金	5,252,285	
別途積立金	4,650,000	
繰越利益剰余金	602,285	
評価・換算差額等		52
その他有価証券評価差額金	52	
純資産合計		5,454,338
負債・純資産合計		6,312,936

(2) 中間損益計算書

当中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日		
科 目	金 額	
	千円	千円
営業収益		
委託者報酬		2,803,141
運用受託報酬		66,134
営業収益計		2,869,275
営業費用		
支払手数料		1,385,329
広告宣伝費		14,588
調査費		288,796
調査研究費	193,377	
委託調査費	95,419	
営業雑経費		34,029
印刷費	30,062	
郵便料	91	
電信電話料	1,239	
協会費	2,636	
営業費用計		1,722,744
一般管理費		
給料		266,208
役員報酬	25,849	
給料・手当	193,005	
賞与	2,896	
法定福利費	40,028	
福利厚生費	2,538	
その他給料	1,890	
賞与引当金繰入		54,865
退職給付費用		32,585
役員退職慰労引当金繰入		7,366
交際費		1,647
旅費交通費		5,859
租税公課		13,690
不動産賃借料		31,357
固定資産減価償却費 ※ 1		14,882
諸経費		69,033
一般管理費計		497,495
営業利益		649,035
営業外収益		
受取利息		71
その他営業外収益		263
営業外収益計		335

営業外費用		
雑損失		170
営業外費用計		170
経常利益		649,199

当中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日		
科 目	金 額	
	千円	千円
税引前中間純利益		649,199
法人税、住民税および事業税		193,106
法人税等調整額		9,484
中間純利益		446,608

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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	3,830,000	975,677	4,807,677	5,007,677
当中間期変動額						
新株の発行	—	—	—	—	—	—
剰余金の配当	—	—	—	—	—	—
別途積立金の積立	—	—	820,000	△820,000	—	—
別途積立金の取崩	—	—	—	—	—	—
中間純利益	—	—	—	446,608	446,608	446,608
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	—	—	—	—	—	—
当中間期変動額合計	—	—	820,000	△373,391	446,608	446,608
当中間期末残高	200,000	2,000	4,650,000	602,285	5,254,285	5,454,285

	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	13	13	5,007,690
当中間期変動額			
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	—	—	—
中間純利益	—	—	446,608
株主資本以外の項目の当中間期変 動額（純額）	39	39	39
当中間期変動額合計	39	39	446,647
当中間期末残高	52	52	5,454,338

重要な会計方針

項 目	当中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
1.有価証券の評価基準および評価方法 2.固定資産の減価償却の方法 3.引当金の計上基準 4.その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	その他有価証券 時価のあるもの：投資信託は、中間決算期末前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) (1)有形固定資産 定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下のとおりです。 建 物 3年～50年 器具備品 3年～20年 (2)無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づいております。 (1)賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。 (2)退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務を計上しております。 なお、退職給付引当金の対象従業員が300名未満であるため、簡便法によっており、退職給付債務の金額は当中間会計期間末における自己都合要支給額としております。 (3)役員退職慰労引当金 当社常勤役員の退職慰労金の支給に充てるため、「常勤役員退職慰労金規程」に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。 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。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項 目	当中間会計期間末 2019年9月30日
＊１ 有形固定資産の減価償却累計額	建物 67,331千円 器具備品 43,813千円
＊２ 消費税等の取扱い	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。

（中間損益計算書関係）

項 目	当中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
＊１ 減価償却実施額	有形固定資産 7,444千円 無形固定資産 7,437千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(千株)	4	—	—	4
計	4	—	—	4

（金融商品関係）

当中間会計期間末（2019年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	5,590,817	5,590,817	—
(2)未収委託者報酬	536,055	536,055	—
(3)未収運用受託報酬	4,843	4,843	—
(4)投資有価証券	2,575	2,575	—
資産計	6,134,292	6,134,292	—
(5)未払手数料	322,681	322,681	—
(6)その他未払金	53,752	53,752	—
(7)未払法人税等	204,652	204,652	—
(8)未払消費税等	32,351	32,351	—
(9)未払事業所税	1,027	1,027	—
負債計	614,464	614,464	—

（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。

（有価証券関係）

その他有価証券

当中間会計期間末（2019年9月30日）

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託	1,590	1,500	90
小計	1,590	1,500	90
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託	984	1,000	△15
小計	984	1,000	△15
合計	2,575	2,500	75

（セグメント情報等）

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30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、中間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

①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中間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。

②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中間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）

顧客の名称又は氏名	営業収益
信金中央金庫	61,649

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。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
1株当たり純資産額	1,363,584円56銭
1株当たり中間純利益	111,652円07銭
潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載 していません。	
(注)算定上の基礎	
1株当たり中間純利益	
中間純利益	446,608千円
普通株主に帰属しない金額	— 千円
普通株式に係る中間純利益	446,608千円
期中平均株式数	4,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）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

① 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。

② 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 公認会計士 南波 秀哉 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 小松崎 謙 印
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、「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

2020年3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2020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2020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12月16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 公認会計士 小松崎 謙 印
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、「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2019年4月1日から2020年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、しんきんアセットマネジメント投信株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。