

## 【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】                            | 2021年 5 月14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<br>（愛称：しんきんラップ（安定型）） |
| 【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

（ファンドの愛称を「しんきんラップ（安定型）」とします。）

（以下「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行(売出)価額の総額】

2,000億円を上限とします。

### （４）【発行(売出)価格】

- ・取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・基準価額とは、投資信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上１万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）
- ・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 > <https://www.skam.co.jp>

**（５）【申込手数料】**

申込手数料は、購入金額に応じて、購入価額に1.65%（税抜1.5%）を上限に、販売会社が個別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（購入金額とは「買付申込日の翌営業日の基準価額×申込口数」をいいます。）

収益分配金の再投資に際しては、申込手数料は掛かりません。

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

販売会社が定める申込手数料については販売会社または下記の照会先までお問い合わせください。

**< 照会先 >**

しんきんアセットマネジメント投信株式会社（委託会社）

< コールセンター > 0120-781812

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

< ホームページ > <https://www.skam.co.jp>

**（６）【申込単位】**

販売会社が定める単位

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

**（７）【申込期間】**

2021年5月15日から2021年11月12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】**

当ファンドのお申し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 <https://www.skam.co.jp>

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

（受付時間：営業日の9:00から17:00まで）

**（９）【払込期日】**

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

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

**（10）【払込取扱場所】**

取得申込金額は、お申し込みされた販売会社の営業所等で支払うものとします。

**（11）【振替機関に関する事項】**

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

**（12）【その他】**

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

各営業日の午後3時までに受け付けた取得および換金の申込み（当該申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を当日の受付分として取り扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。

ニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの金融商品取引所の休業日またはニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの銀行が休業日の場合は、受益権の取得の申込みを受け付けません。ただし、収益分配金の再投資に係る追加信託の申込みに限ってこれを受け付けるものとします。

当ファンドは自動けいぞく投資専用ファンドですので、分配金は自動的に再投資されます。（再投資の際に、申込手数料は掛かりません。）取得申込者は、販売会社と別に定める「自動けいぞく投資約款」に従い契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合、上記契約または規定は、当該別の名称に読み替えるものとします。

振替受益権について

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

投資信託振替制度について

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

###### ファンドの目的

日本を含む世界各国の株式、公社債、不動産投資信託および国内短期金融資産へ分散投資を行い、投資信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

###### ファンドの基本的性格

当ファンドは、以下の「商品分類」および「属性区分」に該当します。

##### 1）商品分類表

| 単位型投信・追加型投信 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(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<br>一般<br>大型株<br>中小型株 | 年 1 回  |         |           |       |
| 債券<br>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 6 回  | 北米      |           |       |
| クレジット属性                 | ( 隔月 ) | 欧州      |           |       |
| ( )                     |        | アジア     |           |       |
| 不動産投信                   | 年12回   | オセアニア   |           |       |
| その他資産                   | ( 毎月 ) | 中南米     |           |       |
| (投資信託証券                 |        | アフリカ    |           |       |
| (株式・債券・                 | 日々     | 中近東     | ファンド・オブ・  | なし    |
| 不動産投信・短期金               |        | (中東)    | ファンズ      |       |
| 融資産))                   | その他    | エマージング  |           |       |
| 資産複合                    | ( )    |         |           |       |
| ( )                     |        |         |           |       |
| 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・短期金融資産））」...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・短期金融資産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（<https://www.toushin.or.jp>）をご参照ください。

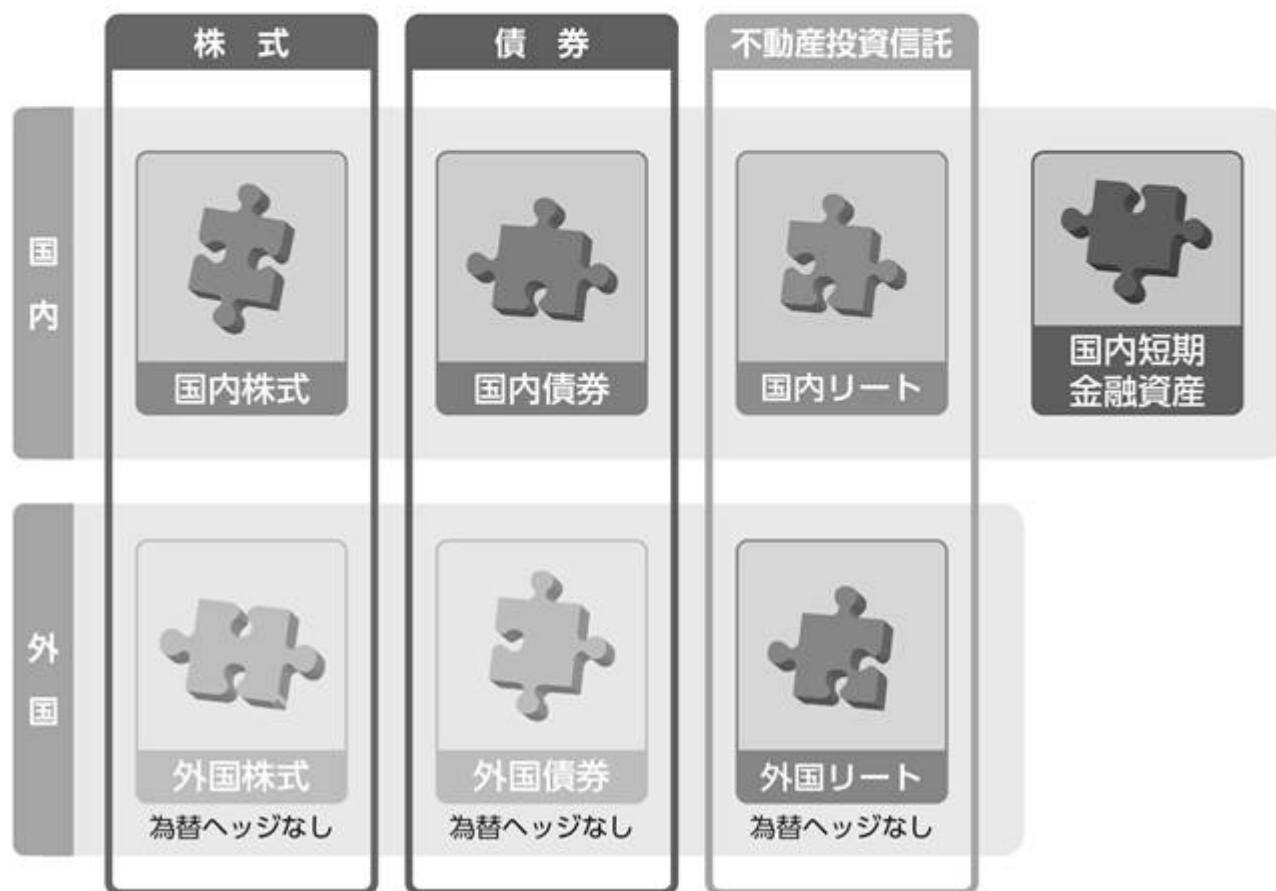
## ファンドの特色

**特色1** 7つの資産を投資対象とした分散投資を行います。

- ◆ 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））に加え、国内短期金融資産を投資対象とし、市場環境の変化に対応した分散投資を行います。

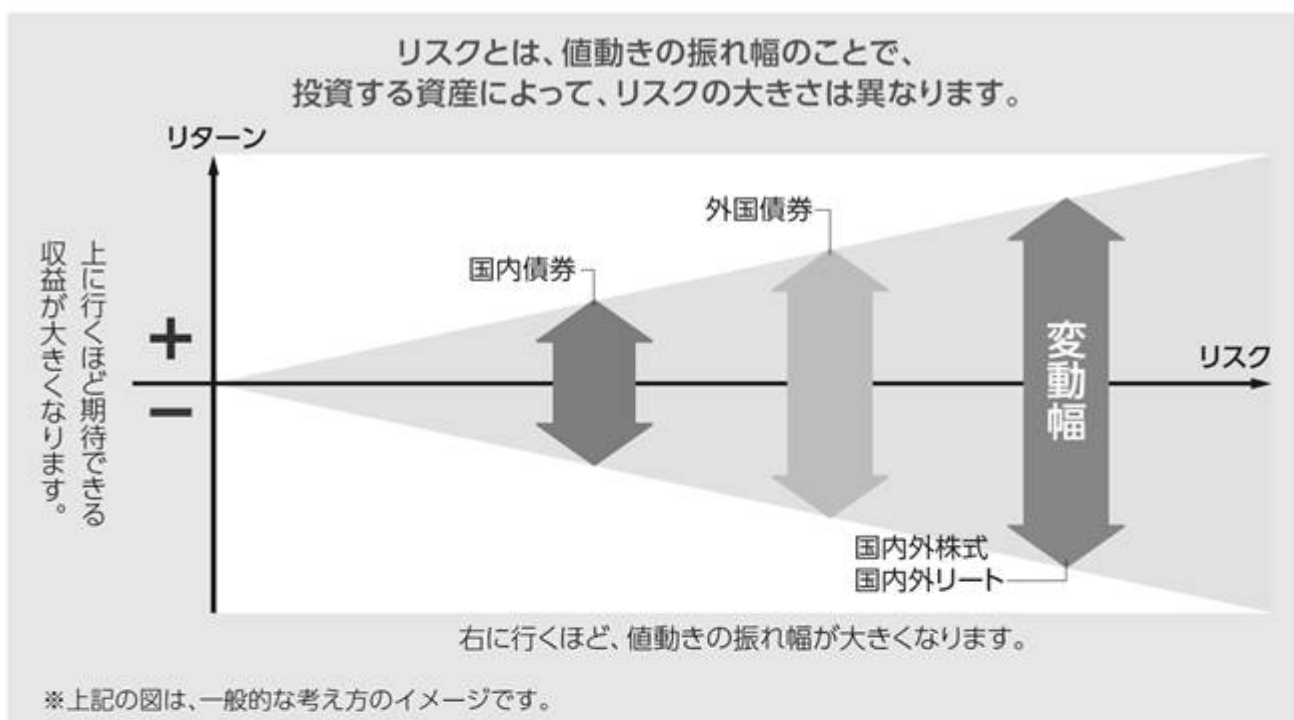
※常に全ての投資対象に投資を行うとは限りません。

- ◆ 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、安定した運用成果を目指します。



## 特色2 各資産のリスクを考慮した分散投資を行います。

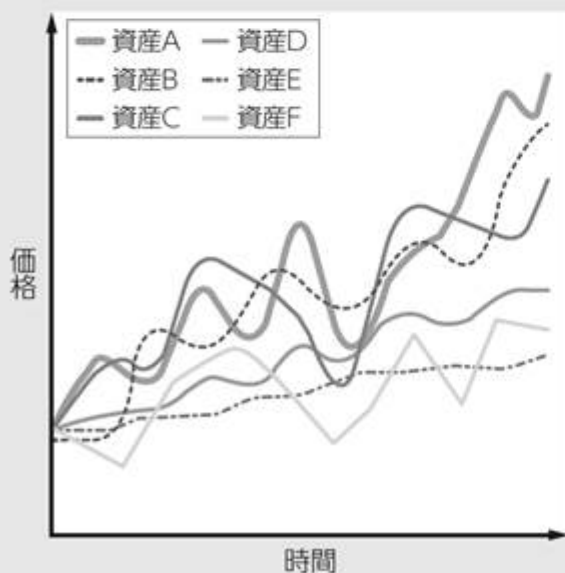
- ◆ 投資する資産はそれぞれ異なるリスク（値動きの振れ幅）を持っています。



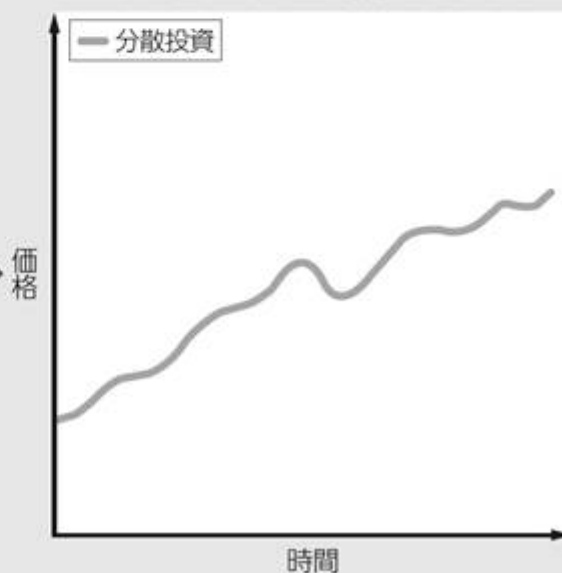
- ◆ 異なる資産にリスクを考慮した分散投資を行うことによって、基準価額の変動を抑えつつ、収益の獲得を目指します。

### 分散投資の効果

各資産はさまざまな値動きをします。



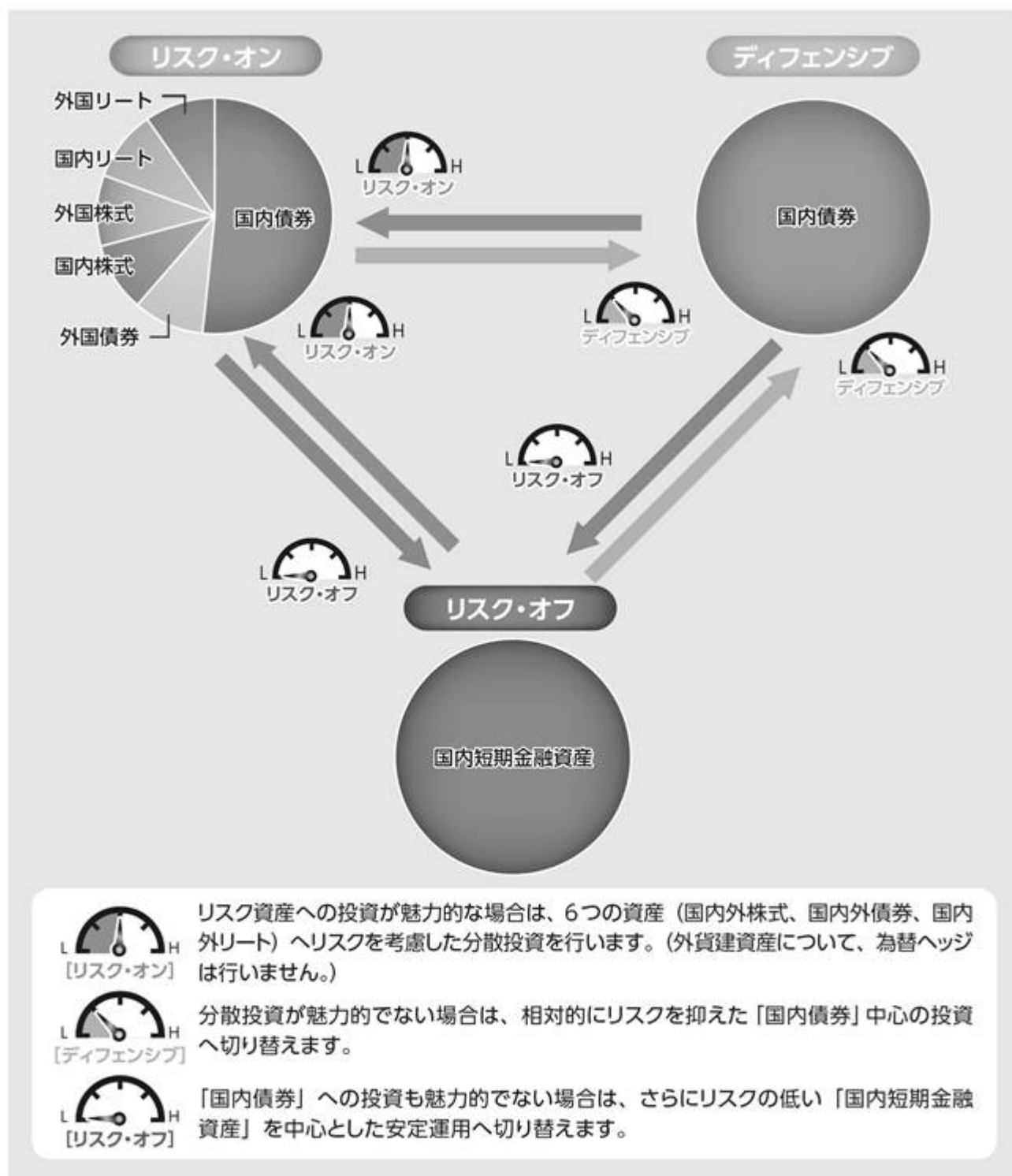
値動きの異なる資産を組み合わせることで、リスクの低減効果が期待できます。



※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、さらに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「リスク・オン」、「ディフェンシブ」および「リスク・オフ」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」**  
(愛称:しんきんラップ(安定型))

- リスク水準の高い資産の配分比率を下げ、リスク水準の低い資産の配分比率を上げること等によって、リスクを抑えた分散投資を目指します。
- 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                               |
|-------------------------|---------|--------|-------|--------|-------------------------------------------|
| <br>アメリカ<br><br><br>カナダ | オーストリア  | フランス   | イタリア  | スペイン   | 香港<br>日本<br>シンガポール<br>オーストラリア<br>ニュージーランド |
|                         | ベルギー    | ドイツ    | オランダ  | スウェーデン |                                           |
|                         | デンマーク   | アイルランド | ノルウェー | スイス    |                                           |
|                         | フィンランド  | イスラエル  | ポルトガル | イギリス   |                                           |

※ 2021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     | <div>● 日本</div> <p>※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。</p>                                                                                                                                                                   |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|        | <div>米 国</div> <p>※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。</p>                                                                                                                                                                                                  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| ユーロ参加国 | <div>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</div> <div>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</div> <p>※欧州経済通貨同盟 (EMU) 参加国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。EMUとは、統一通貨「ユーロ」を導入する欧州連合 (EU) 加盟国による共通の経済政策・通貨対策の実施を目指す同盟です。</p> |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|        | <div>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</div> <p>※日本、米国、EMU参加国を除く世界各国の国債、政府機関債、地方債および国際機関債を主要投資対象とします。投資対象とする公社債は、組入れ時において、信用格付業者等からAA格以上の信用格付を取得しているものとします。上記以外の国に投資することがあります。</p>                                             |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| その他    |                                                                                                                                                                                                                                                      |  |  |  |  |  |  |  |  |  |

※ 2021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   | <div>高い</div> <div>↑</div> <div>↓</div> <div>低い</div> | 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。

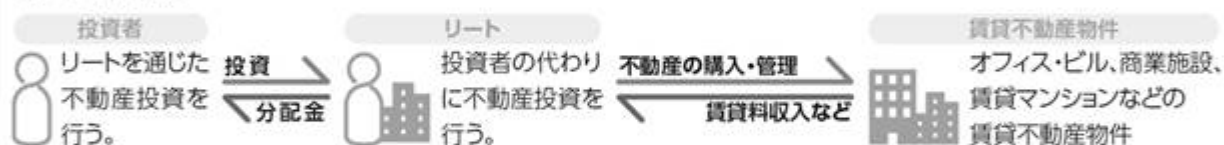
#### ◎不動産投資信託（リート）のポイント

- 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                                                             |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
| <br>アメリカ<br><br>カナダ | <br>ベルギー<br><br>イタリア<br><br>イスラエル<br><br>フランス<br><br>オランダ<br><br>スペイン<br><br>ドイツ<br><br>アイルランド<br><br>イギリス | <br>香港<br><br>日本<br><br>シンガポール<br><br>韓国<br><br>オーストラリア<br><br>ニュージーランド |

※ 2021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。（組み入れている場合もあります。）

※ 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896兆円（2020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。

## ■ 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。

### 国内短期金融資産



#### 国内短期金融資産

わが国の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

#### ◎国内短期金融資産のポイント

- 短期公社債の組み入れにあたっては、原則、残存期間1年以内のものとし、取得時においていずれかの信用格付業者等からA格相当以上の信用格付を得ている銘柄に限定することで、価格変動リスクや金利リスク、信用リスク、流動性リスクなどを抑えた投資成果が期待できます。

※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。

## ■ 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。

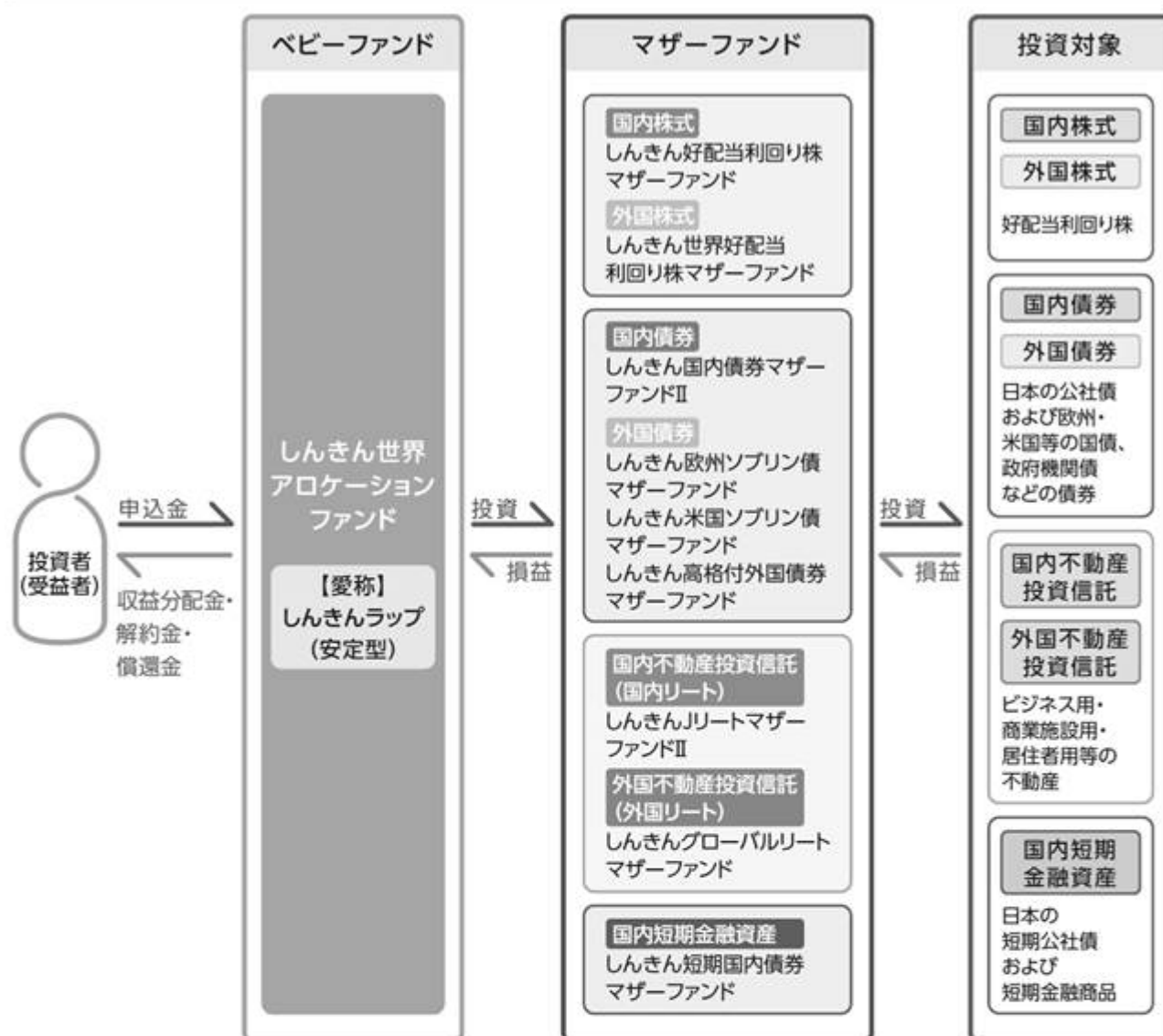


円高になると外貨建資産の価値は  
円ベースで下落します。



※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（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ならびに国内短期金融資産への投資は、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が株式に直接投資したり、外貨建資産に直接投資することはありません。）

### 信託金の限度額

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

## （２）【ファンドの沿革】

2013年10月25日 信託契約締結、当初設定、運用開始



## &lt; 委託会社の概況 &gt;（本書提出日現在）

## 名称

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

## 本店の所在の場所

東京都中央区京橋三丁目 8 番 1 号

## 資本の額

200百万円

## 会社の沿革

|           |                             |
|-----------|-----------------------------|
| 1990年12月  | 全信連投資顧問株式会社として設立            |
| 1991年 3 月 | 投資顧問業の登録                    |
| 1992年 3 月 | 投資一任契約に係る業務の認可              |
| 1998年11月  | 「しんきんアセットマネジメント投信株式会社」に商号変更 |
| 1998年12月  | 証券投資信託委託業の認可                |
| 2007年 9 月 | 金融商品取引業者（投資運用業、投資助言・代理業）の登録 |
| 2017年 8 月 | 金融商品取引法に基づく第二種金融商品取引業の追加登録  |

## 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## （１）【投資方針】

## 投資対象

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

（ ）内は投資対象資産を示します。

## 投資態度

- 1）各マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債、不動産投資信託および国内短期金融資産等へ実質的な投資を行います。
- 2）原則として、各マザーファンド受益証券への配分比率は、定性評価、定量評価等を勘案した資産分散手法により決定し、適宜見直しを行います。なお、一部のマザーファンド受益証券への配分比率をゼロとする場合があります。
- 3）実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 4）市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができないことがあります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- １）次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

- ２）次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

### 投資の対象とする有価証券の範囲等

- １）委託会社は、信託金を、しんきんアセットマネジメント投信株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」、「しんきん高格付外国債券マザーファンド」、「しんきんＪリートマザーファンド」、「しんきんグローバルリートマザーファンド」および「しんきん短期国内債券マザーファンド」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みなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

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

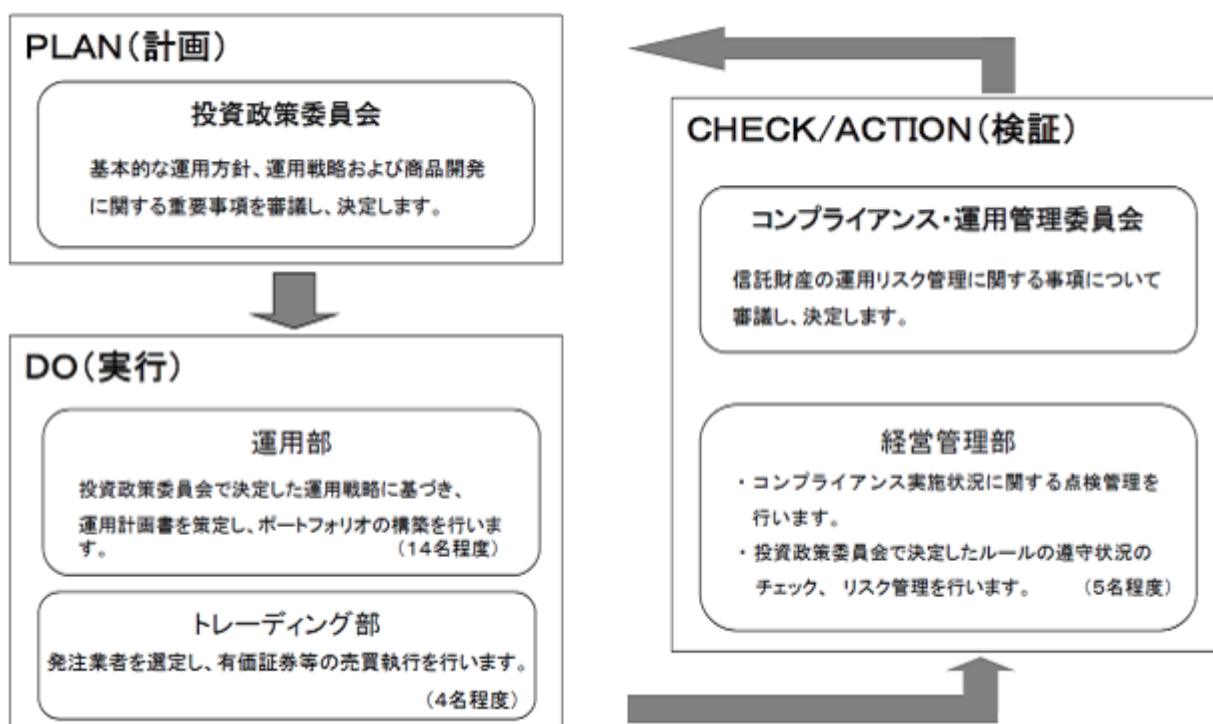
ハ．コール・ローン

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

信金中央金庫グループおよび内外の調査機関からの情報に基づき、投資環境等について当社独自の綿密な調査・分析を行います。

投資政策委員会においては、ファンダメンタルズ分析、市場分析を踏まえて基本的な投資方針を策定します。また、基本的な投資方針に基づき当面の運用に当たってのガイドラインを決定し、併せて個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。

ファンドの運用体制等は、今後変更となる場合があります。

### （４）【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。

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、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないこともあります。

留保益は、投資信託約款の運用の「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。

### （５）【投資制限】

「しんきん世界アロケーションファンド」の投資信託約款（以下「約款」といいます。）では、ファンドの運用に関して一定の制限および限度を定めています。かかる制限、限度は以下のとおりです。

株式への直接投資は行いません。

外貨建資産への直接投資は行いません。

信用リスク集中回避のための投資制限

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

委託会社は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、投資信託財産において一部解約代金の支払資金に不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を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) 上記の資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
  - イ) 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による、受取りの確定している資金の額の範囲内。
  - ロ) 一部解約金支払日の前営業日において確定した、当該支払日における当該支払資金の不足額の範囲内。
  - ハ) 借入指図を行う日における、投資信託財産の純資産総額の10%以内。
- 2) 上記の借入期間は、有価証券等の売却等の代金の入金日までに限るものとします。
- 3) 借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。

## （参考）親投資信託（マザーファンド）に関する情報

### 「しんきん好配当利回り株マザーファンド」の概要

#### （１）投資方針

##### 投資対象

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

##### 投資態度

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

#### （２）投資対象

##### 投資の対象とする資産

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

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

##### ３）金銭債権

##### ４）約束手形

##### 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（本邦通貨表示のものに限りま。）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。）
- 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、1)、12)および16)の証券または証書のうち1)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、2)から6)までの証券および12)ならびに16)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

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

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

（４）その他

「しんきん世界アロケーションファンド」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

#### 投資対象

日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- １）日本を除く世界各国の配当利回りの高い企業の株式へ分散投資を行うことにより、安定した配当収益の獲得と投資信託財産の成長を目標とします。
- ２）運用指図に関する権限は、シュローダー・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、銘柄ごとの配当利回り・増配期待・流動性に着目しつつ、企業のファンダメンタル分析も勘案して行います。
- ４）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ５）株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- ６）資金動向および市況動向等に急激な変化が生じたとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができないことがあります。

### （２）投資対象

#### 投資の対象とする資産

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

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

#### 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券に投資することを指図します。

- １）株券または新株引受権証書
- ２）国債証券
- ３）地方債証券
- ４）特別の法律により法人の発行する債券
- ５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６）特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７）特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８）協同組織金融機関に係る優先出資証券または優先出資引受権を表示する証書（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９）特定目的会社に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）

## 10) コマーシャル・ペーパー

11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りします。）

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します。）

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、1)の証券または証書、12)ならびに17)の証券または証書のうち1)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、2)から6)までの証券および12)ならびに17)の証券または証書のうち2)から6)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13)の証券および14)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

1) 預金

2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3) コール・ローン

4) 手形割引市場において売買される手形

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

### (3) 投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないこと

をあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

#### （４）その他

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

## 「しんきん国内債券マザーファンド」の概要

## （１）投資方針

## 投資対象

我が国の公社債を主要投資対象とします。

## 投資態度

- １）「ダイワ・ボンド・インデックス総合」をベンチマークとします。
- ２）投資対象とする公社債は、組入段階において、いずれかの指定格付業者等から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。
- 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。

## （２）投資対象

## 投資の対象とする資産

この信託において投資の対象とされる資産の種類は次に掲げるものとします。

次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

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

## 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（本邦通貨表示のものに限りま。）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。）
- 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、1)から5)までの証券の性質を有する本邦通貨建のものとしします。)
- 11) 外国法人が発行する本邦通貨建の譲渡性預金証書
- 12) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
- 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

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

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

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

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

### (3) 投資制限

株式への投資は行いません。

同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

### (4) その他

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

「ダイワ・bond・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。

## 「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」の概要

### （１）投資方針

#### 投資対象

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

#### 投資態度

- １）主としてＥＭＵ参加国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- ２）ＦＴＳＥ ＥＭＵ国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとします。
- ３）運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。
- ４）外貨建資産の組入比率については、原則として高位を保ちます。
- ５）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ６）市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## 「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」の概要

### （１）投資方針

#### 投資対象

米国の国債、政府機関債および国際機関債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- １）主として米国の国債、政府機関債および国際機関債に投資します。
- ２）ＦＴＳＥ米国国債インデックス（ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとします。
- ３）運用にあたっては、マクロ経済分析等のファンダメンタルズ分析、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、ポートフォリオの構築を図ります。
- ４）外貨建資産の組入比率については、原則として高位を保ちます。
- ５）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ６）市況動向あるいは資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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

#### 金利リスクのコントロール

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

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

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

国別配分（主として「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」について）

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

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

投資の対象とする資産

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

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

３）金銭債権

４）約束手形

投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券に投資することを指図します。

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

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

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

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

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の５％以下とします。

- (４) その他

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

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

「ＦＴＳＥ世界国債インデックス」は、ＦＴＳＥ Fixed Income ＬＬＣにより運営される債券インデックスで、1984年12月末を100とする世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均し、指数化したものです。

上記の指数は、ＦＴＳＥ Fixed Income ＬＬＣの知的財産です。同社は各指数の算出、公表、利用に関する一切の権利を有しております。同社は、当ファンドの運用成績などに関する一切の責任を負いません。

## 「しんきん高格付外国債券マザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

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

## 投資態度

- 1) 投資対象とする公社債は、組入時において、信用格付業者であるムーディーズ社またはスタンダード&プアーズ社のいずれかから 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、債券市場分析等をふまえて投資戦略を決定し、債券ポートフォリオの構築を図ります。
- 4) 外貨建資産の組入比率については、原則として高位を保ちます。
- 5) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 6) 市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 投資対象

## 投資の対象とする資産

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

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

## 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券に投資することを指図します。

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

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

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

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

### (3) 投資制限

株式への投資は行いません。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### (4) その他

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

## 「しんきん」リートマザーファンド」の概要

### （１）投資方針

#### 投資対象

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

#### 投資態度

- 1) わ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。

### （２）投資対象

#### 投資の対象とする資産

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

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形

#### 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、主として我が国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券のほか、次の有価証券（本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

- 1) コマーシャル・ペーパー
- 2) 外国または外国の者の発行する本邦通貨建の証券または証書で、前号の証券または証書の性質を有するもの
- 3) 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。

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

- 4) 新投資口予約権証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

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

### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド」が「しんきんJ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。

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。

## 「しんきんグローバルリートマザーファンド」の概要

## (1) 投資方針

## 投資対象

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

## 投資態度

- 1) 日本を除く世界各国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託証券に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 2) 運用指図に関する権限は、ブラックロック・ジャパン株式会社に委託します。
- 3) 不動産投資信託証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- 4) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5) 市況動向あるいは資金動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 投資対象

## 投資の対象とする資産

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

- 1) 有価証券
- 2) 金銭債権
- 3) 約束手形

## 投資の対象とする有価証券の範囲等

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

- 1) コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
- 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券
- 4) 投資証券もしくは投資法人証券または外国投資証券
- 5) 新投資口予約権証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

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

### （３） 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P先進国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。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

### （４） その他

「しんきん世界アロケーションファンド」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。

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。

## 「しんきん短期国内債券マザーファンド」の概要

### （１）投資方針

#### 投資対象

我が国の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- １） 主として我が国の短期公社債および短期金融商品を中心に投資を行い、我が国の無担保コール（オーバーナイト物）をベンチマークとし、これを上回る運用成果を目指します。
- ２） 短期公社債の組入れにあたっては、原則、残存期間１年以内のものとし、取得時において、いずれかの信用格付業者等からＡ格相当以上の格付けを得ている銘柄に限定します。
- ３） 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ならびに外国の市場における我が国の有価証券先物取引、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と類似の取引（以下「有価証券先物取引等」といいます。）を行うことができます。
- ４） 資金動向あるいは市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### （２）投資対象

#### 投資の対象とする資産

- １） 特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
  - a. 有価証券
  - b. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、約款第16条、第17条および第18条に定めるものに限りま。
  - c. 約束手形
  - d. 金銭債権

- ２） 次に掲げる特定資産以外の資産  
為替手形

#### 投資の対象とする有価証券の範囲等

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、かつ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。）
- 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、1)から5)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、1)から5)までの証券および7)の証券または証書のうち1)から5)までの証券の性質を  
有するものを以下「公社債」といい、8)から9)の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

### (3) 投資制限

株式への投資は行いません。

公社債および短期金融資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債および新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株  
予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないこと  
をあらかじめ明確にしているものへの投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

### (4) その他

「しんきん世界アロケーションファンド」が「しんきん短期国内債券マザーファンド」（親投資  
信託）の受益証券の一部解約を行う場合の信託財産留保額はありません。

### 3【投資リスク】

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

#### （１） 基準価額の変動要因

##### 価格変動リスク

有価証券の価格は、国内および国外の政治・経済情勢、発行体の業績、市場の需給等を反映して変動します。組入有価証券の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 金利リスク

金利リスクとは、金利変動により公社債等の価格が下落するリスクをいいます。一般的に金利低下局面では組入れた公社債等の価格は値上がりし、金利上昇局面では値下がります。また、償還までの期間が長い公社債等は、概して、短いものより金利変動に対応して大きく変動します。組入有価証券の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 不動産投資信託のリスク

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

##### 為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 信用リスク

有価証券等の発行体が経営不安、倒産等に陥った場合、またその可能性が高まった場合には当該発行体が発行する有価証券および短期金融商品の価格は下落し、場合によっては投資資金が回収できなくなることもあります。組入有価証券等の価格が下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

##### 流動性リスク

流動性リスクとは、有価証券を売買する際に、需給動向により希望する時期・価格で売買することができなくなるリスクをいいます。当ファンドが投資する有価証券の流動性が損なわれた場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### カントリーリスク

海外の有価証券に投資する場合、投資する国の政治・経済情勢、外国為替規制、資本規制、制度変更等による影響を受けることがあり、基準価額が下落する要因となります。

上記の変動要因は主なもののみであり、上記に限定されるものではありません。

#### （２） その他の留意点

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

### （３） リスクの管理体制

運用部門から独立した管理部門が、ファンドのリスクとリターンの計測・分析および法令遵守の観点から運用状況を監視します。モニタリングを日々行い、異常が検知された場合には、直ちに関連部門に報告し、是正を求める態勢としています。運用リスク管理状況は、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および  
基準価額（分配金再投資後）の推移当ファンドと代表的な資産クラスとの  
年間騰落率の比較

※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、当ファンドおよび代表的な資産クラスについて、2016年3月から2021年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・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)<br>(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<br>インデックス<br>(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・<br>マーケット・インデックス<br>(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<br>(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・<br>ボンド・インデックス・<br>エマージング・マーケット・<br>グローバル・ディバースファイド<br>(円ベース) | J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建国債を対象にした指数です。       | J.P. Morgan Securities LLC |

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

申込手数料は、購入金額に応じて購入価額に1.65%（税抜1.5%）を上限に、販売会社が個別に定める手数料率を乗じて得た額とします。

（購入金額とは「買付申込日の翌営業日の基準価額×申込口数」をいいます。）

収益分配金の再投資に際しては、申込手数料は掛かりません。

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

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

## (2)【換金（解約）手数料】

換金（解約）手数料はありませんが、一部解約時に基準価額の0.3%を信託財産留保額としてご負担いただきます。

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

## (3)【信託報酬等】

純資産総額に対して、年率1.155%（税抜1.05%）

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

※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

※運用管理費用は、計算期間を通じて毎日計算され、毎計算期間の最初の6か月終了日および毎計算期間末、または信託終了のときに投資信託財産から支払われます。

運用管理費用  
（信託報酬）

| 支払先  | 配分（税抜）および役務の内容        |                                        |
|------|-----------------------|----------------------------------------|
| 委託会社 | 純資産総額に対して、<br>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、<br>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、<br>年率0.05% | 運用財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価        |

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

「税抜」における「税」とは、消費税等相当額をいいます。

委託会社が受け取る信託報酬には、ファンド監査の費用が含まれます。

#### （４）【その他の手数料等】

投資信託財産において、一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的とし、資金の借入れの指図を行った場合、当該借入金の利息は投資信託財産から支払われます。

投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、受益者の負担とし投資信託財産から支払われます。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は投資信託財産から支払われます。

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取り扱われます。

##### 個別元本について

- 1) 受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 2) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- 3) 同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については販売会社ごとに、個別元本が算出されます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合は、当該支店等ごとに個別元本の算出が行われる場合があります。

##### 収益分配金について

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。受益者が「元本払戻金（特別分配金）」を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該「元本払戻金（特別分配金）」を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

個別元本および収益分配金の区分については、後記＜個別元本および収益分配金の区分の具体例＞をご参照ください。

##### 個人、法人別の課税上の取扱いについて

##### 1) 個人の受益者に対する課税

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

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

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

## 2）法人の受益者に対する課税

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

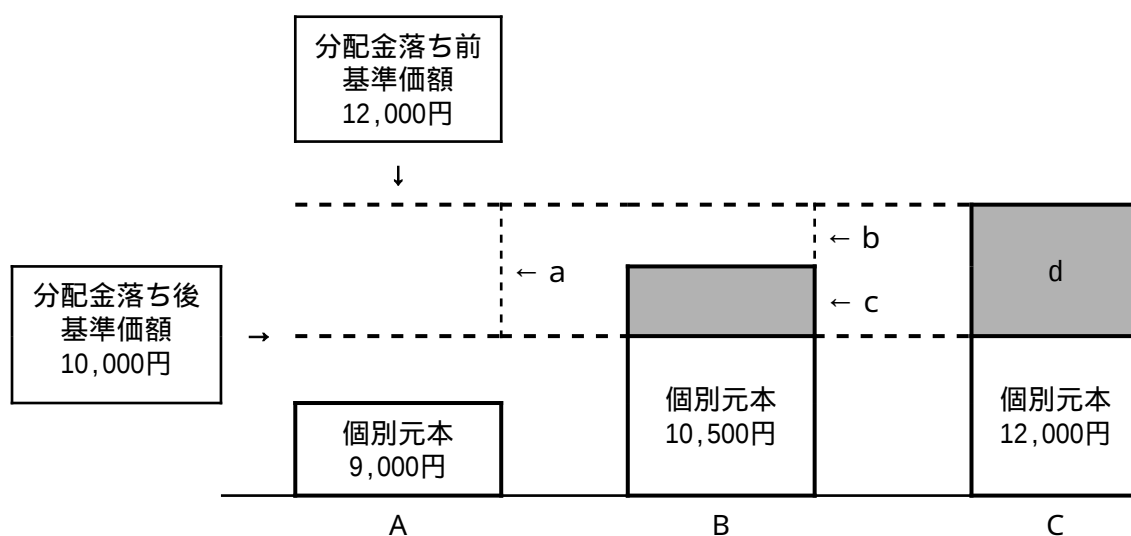
外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

取得申込者によって取扱いが異なる場合があります。また、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

## &lt; 個別元本および収益分配金の区分の具体例 &gt;

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



## A) 収益分配金受取前の個別元本が9,000円の場合

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

## B) 収益分配金受取前の個別元本が10,500円の場合

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

収益分配金受取後の個別元本は

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

## C) 収益分配金受取前の個別元本が12,000円の場合

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

収益分配金受取後の個別元本は

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

取得申込者によって、取扱いが異なる場合があります。また、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 5【運用状況】

以下は2021年2月26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。

### 【しんきん世界アロケーションファンド】

#### （１）【投資状況】

| 資産の種類               | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券           | 日本   | 15,486,679,001 | 98.92   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 169,206,370    | 1.08    |
| 合計(純資産総額)           |      | 15,655,885,371 | 100.00  |

#### （２）【投資資産】

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国／地域 | 種類            | 銘柄名                      | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|---------------|--------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん国内債券マザーファンド          | 8,418,930,450 | 1.3268          | 11,170,236,921  | 1.3180          | 11,096,150,333  | 70.88           |
| 2  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきんJリートマザーファンド          | 314,421,004   | 2.5471          | 800,861,739     | 2.5457          | 800,421,549     | 5.11            |
| 3  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん好配当利回り株マ<br>ザーファンド   | 345,453,598   | 2.2801          | 787,668,748     | 2.2205          | 767,079,714     | 4.90            |
| 4  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん世界好配当利回り株<br>マザーファンド | 305,983,193   | 2.3278          | 712,267,676     | 2.4259          | 742,284,627     | 4.74            |
| 5  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん欧州ソブリン債マ<br>ザーファンド   | 353,540,427   | 1.7008          | 601,301,558     | 1.6917          | 598,084,340     | 3.82            |
| 6  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん米国ソブリン債マ<br>ザーファンド   | 353,023,343   | 1.7050          | 601,904,799     | 1.6900          | 596,609,449     | 3.81            |
| 7  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきんグローバルリートマ<br>ザーファンド  | 328,818,910   | 1.7388          | 571,750,320     | 1.7664          | 580,825,722     | 3.71            |
| 8  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | しんきん高格付外国債券マ<br>ザーファンド   | 222,449,725   | 1.3748          | 305,823,881     | 1.3721          | 305,223,267     | 1.95            |

##### ロ. 種類別投資比率

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.92   |
| 合計        | 98.92   |

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## ( 3 ) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

| 期別                   | 純資産総額（円）       |                | 1万口当たり純資産額（円） |        |
|----------------------|----------------|----------------|---------------|--------|
|                      | （分配落）          | （分配付）          | （分配落）         | （分配付）  |
| 第1計算期間末（2014年 2月14日） | 1,167,708,264  | 1,167,708,264  | 10,136        | 10,136 |
| 第2計算期間末（2015年 2月16日） | 1,872,062,554  | 1,872,062,554  | 11,015        | 11,015 |
| 第3計算期間末（2016年 2月15日） | 3,602,904,616  | 3,602,904,616  | 11,346        | 11,346 |
| 第4計算期間末（2017年 2月14日） | 15,457,001,836 | 15,457,001,836 | 11,736        | 11,736 |
| 第5計算期間末（2018年 2月14日） | 23,683,212,571 | 23,683,212,571 | 11,555        | 11,555 |
| 第6計算期間末（2019年 2月14日） | 23,349,973,970 | 23,349,973,970 | 11,505        | 11,505 |
| 第7計算期間末（2020年 2月14日） | 19,604,125,206 | 19,604,125,206 | 11,515        | 11,515 |
| 第8計算期間末（2021年 2月15日） | 15,864,691,667 | 15,864,691,667 | 11,058        | 11,058 |
| 2020年 2月末日           | 18,837,167,710 | —              | 11,179        | —      |
| 3月末日                 | 18,171,790,611 | —              | 10,955        | —      |
| 4月末日                 | 17,924,559,045 | —              | 10,966        | —      |
| 5月末日                 | 17,871,849,748 | —              | 10,957        | —      |
| 6月末日                 | 17,665,802,871 | —              | 10,946        | —      |
| 7月末日                 | 17,445,121,810 | —              | 10,952        | —      |
| 8月末日                 | 17,335,657,103 | —              | 11,016        | —      |
| 9月末日                 | 17,023,031,089 | —              | 10,964        | —      |
| 10月末日                | 16,534,578,604 | —              | 10,845        | —      |
| 11月末日                | 16,322,348,770 | —              | 10,888        | —      |
| 12月末日                | 16,145,418,736 | —              | 10,954        | —      |
| 2021年 1月末日           | 15,926,178,821 | —              | 10,974        | —      |
| 2月末日                 | 15,655,885,371 | —              | 11,009        | —      |

## 【分配の推移】

| 期   | 計算期間                    | 1万口当たりの分配金（円） |
|-----|-------------------------|---------------|
| 第1期 | 2013年10月25日～2014年 2月14日 | 0             |
| 第2期 | 2014年 2月15日～2015年 2月16日 | 0             |
| 第3期 | 2015年 2月17日～2016年 2月15日 | 0             |
| 第4期 | 2016年 2月16日～2017年 2月14日 | 0             |
| 第5期 | 2017年 2月15日～2018年 2月14日 | 0             |
| 第6期 | 2018年 2月15日～2019年 2月14日 | 0             |
| 第7期 | 2019年 2月15日～2020年 2月14日 | 0             |
| 第8期 | 2020年 2月15日～2021年 2月15日 | 0             |

## 【収益率の推移】

| 期   | 計算期間                    | 収益率（％） |
|-----|-------------------------|--------|
| 第1期 | 2013年10月25日～2014年 2月14日 | 1.36   |
| 第2期 | 2014年 2月15日～2015年 2月16日 | 8.67   |
| 第3期 | 2015年 2月17日～2016年 2月15日 | 3.00   |
| 第4期 | 2016年 2月16日～2017年 2月14日 | 3.44   |
| 第5期 | 2017年 2月15日～2018年 2月14日 | 1.54   |
| 第6期 | 2018年 2月15日～2019年 2月14日 | 0.43   |
| 第7期 | 2019年 2月15日～2020年 2月14日 | 0.09   |
| 第8期 | 2020年 2月15日～2021年 2月15日 | 3.97   |

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。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数に100を乗じた数です。

## （４）【設定及び解約の実績】

| 期   | 計算期間                    | 設定口数（口）        | 解約口数（口）       |
|-----|-------------------------|----------------|---------------|
| 第1期 | 2013年10月25日～2014年 2月14日 | 1,152,013,936  | —             |
| 第2期 | 2014年 2月15日～2015年 2月16日 | 611,092,323    | 63,533,925    |
| 第3期 | 2015年 2月17日～2016年 2月15日 | 1,690,550,674  | 214,552,402   |
| 第4期 | 2016年 2月16日～2017年 2月14日 | 10,568,889,359 | 573,636,896   |
| 第5期 | 2017年 2月15日～2018年 2月14日 | 10,877,047,524 | 3,551,998,573 |
| 第6期 | 2018年 2月15日～2019年 2月14日 | 3,504,611,370  | 3,705,358,910 |
| 第7期 | 2019年 2月15日～2020年 2月14日 | 1,436,508,682  | 4,707,381,983 |
| 第8期 | 2020年 2月15日～2021年 2月15日 | 630,137,428    | 3,307,518,743 |

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

## しんきん好配当利回り株マザーファンド

### 投資状況

| 資産の種類               | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|---------------------|------|----------------|---------|
| 株式                  | 日本   | 28,795,414,360 | 99.44   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 161,860,930    | 0.56    |
| 合計(純資産総額)           |      | 28,957,275,290 | 100.00  |

### 投資資産

#### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種      | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|----|------|----|-------------------|---------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 株式 | 三井物産              | 卸売業     | 165,500 | 1,512.54        | 250,325,370     | 2,263.50        | 374,609,250     | 1.29            |
| 2  | 日本   | 株式 | 九州旅客鉄道            | 陸運業     | 134,400 | 2,847.42        | 382,693,248     | 2,772.00        | 372,556,800     | 1.29            |
| 3  | 日本   | 株式 | ニコン               | 精密機器    | 383,800 | 890.97          | 341,954,286     | 945.00          | 362,691,000     | 1.25            |
| 4  | 日本   | 株式 | ENEOSホールディングス     | 石油・石炭製品 | 774,400 | 343.33          | 265,874,752     | 467.70          | 362,186,880     | 1.25            |
| 5  | 日本   | 株式 | LIXIL             | 金属製品    | 120,100 | 1,244.45        | 149,458,445     | 2,987.00        | 358,738,700     | 1.24            |
| 6  | 日本   | 株式 | 日本テレビホールディングス     | 情報・通信業  | 252,500 | 1,199.91        | 302,977,275     | 1,409.00        | 355,772,500     | 1.23            |
| 7  | 日本   | 株式 | 出光興産              | 石油・石炭製品 | 127,600 | 2,383.39        | 304,120,564     | 2,784.00        | 355,238,400     | 1.23            |
| 8  | 日本   | 株式 | 日本精工              | 機械      | 339,000 | 683.37          | 231,662,430     | 1,043.00        | 353,577,000     | 1.22            |
| 9  | 日本   | 株式 | 住友商事              | 卸売業     | 229,400 | 1,218.89        | 279,613,366     | 1,540.50        | 353,390,700     | 1.22            |
| 10 | 日本   | 株式 | H.U.グループホールディングス  | サービス業   | 107,100 | 2,205.69        | 236,229,399     | 3,295.00        | 352,894,500     | 1.22            |
| 11 | 日本   | 株式 | 三菱ケミカルホールディングス    | 化学      | 476,900 | 605.83          | 288,920,327     | 739.80          | 352,810,620     | 1.22            |
| 12 | 日本   | 株式 | 横浜ゴム              | ゴム製品    | 190,700 | 1,328.19        | 253,285,833     | 1,840.00        | 350,888,000     | 1.21            |
| 13 | 日本   | 株式 | 日立製作所             | 電気機器    | 71,900  | 4,300.48        | 309,204,512     | 4,876.00        | 350,584,400     | 1.21            |
| 14 | 日本   | 株式 | 日本通運              | 陸運業     | 44,200  | 5,082.00        | 224,624,400     | 7,920.00        | 350,064,000     | 1.21            |
| 15 | 日本   | 株式 | アマダ               | 機械      | 270,600 | 816.27          | 220,882,662     | 1,291.00        | 349,344,600     | 1.21            |
| 16 | 日本   | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業     | 625,700 | 406.16          | 254,134,312     | 558.00          | 349,140,600     | 1.21            |
| 17 | 日本   | 株式 | マックス              | 機械      | 218,600 | 1,396.17        | 305,202,762     | 1,596.00        | 348,885,600     | 1.20            |

|    |    |    |                 |        |         |          |             |           |             |      |
|----|----|----|-----------------|--------|---------|----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 18 | 日本 | 株式 | アイシン精機          | 輸送用機器  | 96,200  | 2,588.92 | 249,054,104 | 3,625.00  | 348,725,000 | 1.20 |
| 19 | 日本 | 株式 | ソフトバンク          | 情報・通信業 | 241,600 | 1,431.43 | 345,833,488 | 1,441.00  | 348,145,600 | 1.20 |
| 20 | 日本 | 株式 | 小松製作所           | 機械     | 109,000 | 1,680.91 | 183,219,190 | 3,190.00  | 347,710,000 | 1.20 |
| 21 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業    | 92,800  | 2,716.23 | 252,066,144 | 3,742.00  | 347,257,600 | 1.20 |
| 22 | 日本 | 株式 | 日本郵政            | サービス業  | 380,400 | 775.73   | 295,087,692 | 910.60    | 346,392,240 | 1.20 |
| 23 | 日本 | 株式 | メイテック           | サービス業  | 62,000  | 4,188.83 | 259,707,632 | 5,550.00  | 344,100,000 | 1.19 |
| 24 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ  | 銀行業    | 220,600 | 1,248.52 | 275,423,512 | 1,559.00  | 343,915,400 | 1.19 |
| 25 | 日本 | 株式 | T & Dホールディングス   | 保険業    | 239,400 | 814.24   | 194,929,056 | 1,436.00  | 343,778,400 | 1.19 |
| 26 | 日本 | 株式 | あおぞら銀行          | 銀行業    | 152,300 | 1,960.67 | 298,610,041 | 2,250.00  | 342,675,000 | 1.18 |
| 27 | 日本 | 株式 | マンダム            | 化学     | 188,900 | 1,887.82 | 356,610,335 | 1,812.00  | 342,286,800 | 1.18 |
| 28 | 日本 | 株式 | SANKYO          | 機械     | 115,500 | 2,883.60 | 333,055,800 | 2,956.00  | 341,418,000 | 1.18 |
| 29 | 日本 | 株式 | 大東建託            | 建設業    | 28,900  | 9,796.37 | 283,115,093 | 11,810.00 | 341,309,000 | 1.18 |
| 30 | 日本 | 株式 | キヤノン            | 電気機器   | 148,500 | 2,146.21 | 318,712,185 | 2,292.50  | 340,436,250 | 1.18 |

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率（％） |
|----|---------|----|---------|
|----|---------|----|---------|

|    |    |            |       |
|----|----|------------|-------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業     | 1.10  |
|    |    | 建設業        | 3.29  |
|    |    | 食料品        | 1.94  |
|    |    | 繊維製品       | 1.05  |
|    |    | 化学         | 6.65  |
|    |    | 医薬品        | 3.22  |
|    |    | 石油・石炭製品    | 2.48  |
|    |    | ゴム製品       | 2.35  |
|    |    | ガラス・土石製品   | 1.16  |
|    |    | 鉄鋼         | 1.16  |
|    |    | 非鉄金属       | 2.22  |
|    |    | 金属製品       | 2.35  |
|    |    | 機械         | 9.20  |
|    |    | 電気機器       | 11.19 |
|    |    | 輸送用機器      | 5.58  |
|    |    | 精密機器       | 1.25  |
|    |    | その他製品      | 2.06  |
|    |    | 電気・ガス業     | 2.18  |
|    |    | 陸運業        | 2.50  |
|    |    | 倉庫・運輸関連業   | 1.14  |
|    |    | 情報・通信業     | 6.59  |
|    |    | 卸売業        | 7.02  |
|    |    | 小売業        | 3.31  |
|    |    | 銀行業        | 7.10  |
|    |    | 証券、商品先物取引業 | 2.30  |
|    |    | 保険業        | 3.29  |
|    |    | 不動産業       | 1.17  |
|    |    | サービス業      | 4.60  |
| 合計 |    | 99.44      |       |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

## 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    | 6,590,898,356  | 26.25   |
|                     | ドイツ     | 2,128,472,870  | 8.48    |
|                     | イタリア    | 1,603,055,541  | 6.38    |
|                     | フランス    | 2,532,168,384  | 10.09   |
|                     | オランダ    | 350,517,988    | 1.40    |
|                     | スペイン    | 918,313,385    | 3.66    |
|                     | ベルギー    | 657,610,604    | 2.62    |
|                     | イギリス    | 8,022,519,782  | 31.95   |
|                     | スイス     | 404,167,022    | 1.61    |
|                     | オーストラリア | 682,384,582    | 2.72    |
|                     | シンガポール  | 490,619,279    | 1.95    |
| 小計                  |         | 24,380,727,793 | 97.11   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —       | 726,279,600    | 2.89    |
| 合計(純資産総額)           |         | 25,107,007,393 | 100.00  |

## その他の資産の投資状況

| 資産の種類  | 建別 | 国 / 地域 | 時価合計（円）     | 投資比率（％） |
|--------|----|--------|-------------|---------|
| 為替予約取引 | 買建 | —      | 9,114,650   | 0.04    |
|        | 売建 | —      | 327,809,779 | 1.31    |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名       | 業種    | 数量      | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|----|-----------|-------|---------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | スペイン   | 株式 | REPSOL SA | エネルギー | 669,533 | 1,051.68        | 704,140,028     | 1,371.57        | 918,313,385     | 3.66            |

|    |             |    |                                |                                            |            |           |             |           |             |      |
|----|-------------|----|--------------------------------|--------------------------------------------|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 2  | アメリカ        | 株式 | INTL BUSINESS<br>MACHINES CORP | ソフト<br>ウェア・<br>サービス                        | 68,807     | 13,040.92 | 897,306,659 | 13,012.43 | 895,346,787 | 3.57 |
| 3  | アメリカ        | 株式 | INTEL CORP                     | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                        | 129,011    | 5,806.73  | 749,132,913 | 6,417.50  | 827,928,093 | 3.30 |
| 4  | イギリス        | 株式 | NATWEST GROUP PLC              | 銀行                                         | 2,952,750  | 175.93    | 519,505,814 | 274.53    | 810,646,568 | 3.23 |
| 5  | イギリス        | 株式 | CENTRICA PLC                   | 公益事業                                       | 10,083,749 | 59.70     | 602,073,668 | 77.20     | 778,562,227 | 3.10 |
| 6  | イギリス        | 株式 | WM MORRISON<br>SUPERMARKETS    | 食品・生<br>活必需品<br>小売り                        | 3,014,908  | 274.60    | 827,901,608 | 256.72    | 773,992,970 | 3.08 |
| 7  | イタリア        | 株式 | ENI SPA                        | エネル<br>ギー                                  | 599,180    | 1,111.69  | 666,106,032 | 1,250.17  | 749,078,059 | 2.98 |
| 8  | イギリス        | 株式 | IMPERIAL BRANDS PLC            | 食品・飲<br>料・タバ<br>コ                          | 348,371    | 2,179.02  | 759,108,331 | 2,078.71  | 724,165,765 | 2.88 |
| 9  | オーストラ<br>リア | 株式 | SOUTH32 LTD                    | 素材                                         | 2,863,954  | 159.16    | 455,843,391 | 238.26    | 682,384,582 | 2.72 |
| 10 | イギリス        | 株式 | ANGLO AMERICAN PLC             | 素材                                         | 155,072    | 2,330.96  | 361,468,136 | 4,385.35  | 680,046,050 | 2.71 |
| 11 | アメリカ        | 株式 | WESTERN UNION CO               | ソフト<br>ウェア・<br>サービス                        | 272,111    | 2,221.59  | 604,521,709 | 2,499.00  | 680,005,389 | 2.71 |
| 12 | イギリス        | 株式 | STANDARD CHARTERED<br>PLC      | 銀行                                         | 940,397    | 624.42    | 587,204,089 | 709.73    | 667,432,100 | 2.66 |
| 13 | イギリス        | 株式 | PEARSON PLC                    | メディ<br>ア・娯楽                                | 589,305    | 710.19    | 418,518,777 | 1,128.15  | 664,825,049 | 2.65 |
| 14 | ベルギー        | 株式 | AGEAS                          | 保険                                         | 108,707    | 4,552.49  | 494,888,202 | 6,049.38  | 657,610,604 | 2.62 |
| 15 | ドイツ         | 株式 | RTL GROUP S.A.                 | メディ<br>ア・娯楽                                | 104,184    | 4,445.34  | 463,133,615 | 6,101.04  | 635,631,376 | 2.53 |
| 16 | イギリス        | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC            | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 349,488    | 2,311.64  | 807,891,409 | 1,805.51  | 631,006,455 | 2.51 |
| 17 | ドイツ         | 株式 | BAYER AG                       | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 94,362     | 6,185.10  | 583,639,121 | 6,662.84  | 628,719,710 | 2.50 |
| 18 | フランス        | 株式 | PUBLICIS GROUPE SA             | メディ<br>ア・娯楽                                | 99,207     | 3,587.54  | 355,909,997 | 6,294.77  | 624,485,347 | 2.49 |
| 19 | アメリカ        | 株式 | PFIZER INC                     | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 166,874    | 3,713.66  | 619,714,017 | 3,593.37  | 599,640,860 | 2.39 |

|    |            |    |                                |                                            |           |           |             |           |             |      |
|----|------------|----|--------------------------------|--------------------------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 20 | フランス       | 株式 | SANOFI                         | 医薬品・<br>バイオテ<br>クノロ<br>ジー・ラ<br>イフサイ<br>エンス | 61,063    | 11,050.65 | 674,786,319 | 9,770.19  | 596,597,570 | 2.38 |
| 21 | アメリカ       | 株式 | OMNICO GROUP                   | メディ<br>ア・娯楽                                | 78,973    | 5,888.87  | 465,062,014 | 7,338.68  | 579,558,168 | 2.31 |
| 22 | イタリア       | 株式 | INTESA SANPAOLOA               | 銀行                                         | 2,006,157 | 194.40    | 389,997,988 | 277.93    | 557,572,819 | 2.22 |
| 23 | イギリス       | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL<br>PLC-B SHS | エネ<br>ル<br>ギー                              | 245,473   | 1,925.51  | 472,663,012 | 2,142.86  | 526,015,097 | 2.10 |
| 24 | アメリカ       | 株式 | HOLLYFRONTIER CORP             | エネ<br>ル<br>ギー                              | 128,376   | 2,953.22  | 379,122,640 | 4,081.06  | 523,910,479 | 2.09 |
| 25 | イギリス       | 株式 | TESCO PLC                      | 食品・生<br>活必需品<br>小売り                        | 1,532,784 | 440.35    | 674,968,641 | 337.34    | 517,079,408 | 2.06 |
| 26 | ドイツ        | 株式 | CONTINENTAL AG                 | 自動車・<br>自動車部<br>品                          | 32,825    | 10,807.31 | 354,750,093 | 15,594.86 | 511,901,362 | 2.04 |
| 27 | フランス       | 株式 | SOCIETE BIC SA                 | 商業・専<br>門サービ<br>ス                          | 83,357    | 5,877.98  | 489,971,458 | 6,121.71  | 510,287,381 | 2.03 |
| 28 | イギリス       | 株式 | WPP PLC                        | メディ<br>ア・娯楽                                | 393,283   | 921.34    | 362,348,026 | 1,287.91  | 506,515,279 | 2.02 |
| 29 | シンガポ<br>ール | 株式 | GENTING SINGAPORE<br>LTD       | 消費者<br>サービス                                | 7,171,900 | 59.35     | 425,715,445 | 68.40     | 490,619,279 | 1.95 |
| 30 | アメリカ       | 株式 | MOLSON COORS<br>BREWING CO -B  | 食品・飲<br>料・タバ<br>コ                          | 98,066    | 3,999.51  | 392,216,654 | 4,869.43  | 477,526,258 | 1.90 |

## ロ. 種類別及び業種別の投資比率

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率（％） |
|----|---------|----|---------|
|----|---------|----|---------|

有価証券分析報告書（内閣投資信託）

|    |    |                        |       |
|----|----|------------------------|-------|
| 株式 | 外国 | エネルギー                  | 10.82 |
|    |    | 素材                     | 5.43  |
|    |    | 商業・専門サービス              | 2.03  |
|    |    | 自動車・自動車部品              | 3.44  |
|    |    | 耐久消費財・アパレル             | 1.61  |
|    |    | 消費者サービス                | 1.95  |
|    |    | メディア・娯楽                | 13.62 |
|    |    | 食品・生活必需品小売り            | 5.14  |
|    |    | 食品・飲料・タバコ              | 4.79  |
|    |    | ヘルスケア機器・サービス           | 0.12  |
|    |    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.78  |
|    |    | 銀行                     | 17.00 |
|    |    | 保険                     | 4.49  |
|    |    | ソフトウェア・サービス            | 6.27  |
|    |    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     | 4.20  |
|    |    | 公益事業                   | 3.10  |
|    |    | 半導体・半導体製造装置            | 3.30  |
| 合計 |    |                        | 97.11 |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

| 資産の種類  | 通貨  | 買建 / 売建 | 数量           | 帳簿価額<br>(円) | 評価額<br>(円)  | 投資比率<br>(%) |
|--------|-----|---------|--------------|-------------|-------------|-------------|
| 為替予約取引 | 米ドル | 買建      | 85,793.02    | 9,089,779   | 9,114,650   | 0.04        |
|        | 米ドル | 売建      | 3,000,000.00 | 318,660,000 | 318,720,000 | 1.27        |
|        | ユーロ | 売建      | 70,381.57    | 9,089,779   | 9,089,779   | 0.04        |

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## しんきん国内債券マザーファンド

## 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     | 12,110,016,000 | 80.47   |
| 地方債証券               | 日本     | 1,408,223,000  | 9.36    |
| 特殊債券                | 日本     | 200,412,000    | 1.33    |
| 社債券                 | 日本     | 1,099,206,000  | 7.30    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 231,177,662    | 1.54    |
| 合計(純資産総額)           |        | 15,049,034,662 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                       | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|------|---------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本     | 国債証券 | 第3 4 6 回利<br>付国債（10<br>年） | 500,000,000 | 101.29          | 506,451,000     | 100.63          | 503,175,000     | 0.1       | 2027/3/20  | 3.34            |
| 2  | 日本     | 国債証券 | 第1 7 4 回利<br>付国債（20<br>年） | 450,000,000 | 100.18          | 450,844,500     | 97.17           | 437,305,500     | 0.4       | 2040/9/20  | 2.91            |
| 3  | 日本     | 国債証券 | 第1 4 4 回利<br>付国債（5<br>年）  | 400,000,000 | 101.00          | 404,000,000     | 100.73          | 402,932,000     | 0.1       | 2025/6/20  | 2.68            |
| 4  | 日本     | 国債証券 | 第1 3 7 回利<br>付国債（5<br>年）  | 400,000,000 | 100.68          | 402,720,000     | 100.53          | 402,152,000     | 0.1       | 2023/9/20  | 2.67            |
| 5  | 日本     | 国債証券 | 第1 3 2 回利<br>付国債（5<br>年）  | 400,000,000 | 100.37          | 401,480,000     | 100.28          | 401,148,000     | 0.1       | 2022/6/20  | 2.67            |
| 6  | 日本     | 国債証券 | 第4 1 3 回利<br>付国債（2<br>年）  | 400,000,000 | 100.37          | 401,492,000     | 100.28          | 401,128,000     | 0.1       | 2022/6/1   | 2.67            |
| 7  | 日本     | 国債証券 | 第3 5 5 回利<br>付国債（10<br>年） | 400,000,000 | 101.20          | 404,832,000     | 100.08          | 400,328,000     | 0.1       | 2029/6/20  | 2.66            |
| 8  | 日本     | 国債証券 | 第3 5 7 回利<br>付国債（10<br>年） | 400,000,000 | 101.03          | 404,140,000     | 99.86           | 399,476,000     | 0.1       | 2029/12/20 | 2.65            |

|    |    |       |                  |             |        |             |        |             |      |            |      |
|----|----|-------|------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|------|------------|------|
| 9  | 日本 | 国債証券  | 第360回利付国債（10年）   | 400,000,000 | 100.73 | 402,958,000 | 99.52  | 398,112,000 | 0.1  | 2030/9/20  | 2.65 |
| 10 | 日本 | 国債証券  | 第66回利付国債（30年）    | 400,000,000 | 93.86  | 375,456,000 | 91.10  | 364,428,000 | 0.4  | 2050/3/20  | 2.42 |
| 11 | 日本 | 国債証券  | 第161回利付国債（20年）   | 350,000,000 | 105.01 | 367,559,500 | 102.51 | 358,792,000 | 0.6  | 2037/6/20  | 2.38 |
| 12 | 日本 | 国債証券  | 第333回利付国債（10年）   | 350,000,000 | 102.79 | 359,793,000 | 102.14 | 357,497,000 | 0.6  | 2024/3/20  | 2.38 |
| 13 | 日本 | 国債証券  | 第145回利付国債（5年）    | 350,000,000 | 100.96 | 353,391,500 | 100.75 | 352,639,000 | 0.1  | 2025/9/20  | 2.34 |
| 14 | 日本 | 国債証券  | 第143回利付国債（5年）    | 350,000,000 | 100.85 | 352,975,000 | 100.71 | 352,488,500 | 0.1  | 2025/3/20  | 2.34 |
| 15 | 日本 | 国債証券  | 第142回利付国債（5年）    | 350,000,000 | 100.95 | 353,346,000 | 100.68 | 352,404,500 | 0.1  | 2024/12/20 | 2.34 |
| 16 | 日本 | 国債証券  | 第141回利付国債（5年）    | 350,000,000 | 100.92 | 353,230,500 | 100.67 | 352,369,500 | 0.1  | 2024/9/20  | 2.34 |
| 17 | 日本 | 国債証券  | 第146回利付国債（20年）   | 300,000,000 | 119.55 | 358,656,000 | 117.43 | 352,311,000 | 1.7  | 2033/9/20  | 2.34 |
| 18 | 日本 | 国債証券  | 第138回利付国債（5年）    | 350,000,000 | 100.76 | 352,674,000 | 100.61 | 352,166,500 | 0.1  | 2023/12/20 | 2.34 |
| 19 | 日本 | 国債証券  | 第418回利付国債（2年）    | 350,000,000 | 100.48 | 351,708,000 | 100.38 | 351,347,500 | 0.1  | 2022/11/1  | 2.33 |
| 20 | 日本 | 国債証券  | 第42回利付国債（30年）    | 280,000,000 | 126.76 | 354,930,800 | 123.02 | 344,464,400 | 1.7  | 2044/3/20  | 2.29 |
| 21 | 日本 | 国債証券  | 第160回利付国債（20年）   | 300,000,000 | 106.44 | 319,323,000 | 104.21 | 312,630,000 | 0.7  | 2037/3/20  | 2.08 |
| 22 | 日本 | 国債証券  | 第54回利付国債（30年）    | 300,000,000 | 105.96 | 317,883,000 | 102.65 | 307,965,000 | 0.8  | 2047/3/20  | 2.05 |
| 23 | 日本 | 国債証券  | 第58回利付国債（30年）    | 300,000,000 | 105.50 | 316,512,000 | 102.27 | 306,822,000 | 0.8  | 2048/3/20  | 2.04 |
| 24 | 日本 | 国債証券  | 第354回利付国債（10年）   | 300,000,000 | 101.24 | 303,720,000 | 100.16 | 300,480,000 | 0.1  | 2029/3/20  | 2.00 |
| 25 | 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 | 100.17 | 300,531,000 | 99.95  | 299,865,000 | 0.08 | 2026/5/25  | 1.99 |

|    |    |      |                |             |        |             |        |             |     |           |      |
|----|----|------|----------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----|-----------|------|
| 26 | 日本 | 国債証券 | 第145回利付国債（20年） | 250,000,000 | 119.54 | 298,857,500 | 117.23 | 293,095,000 | 1.7 | 2033/6/20 | 1.95 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 第148回利付国債（20年） | 250,000,000 | 117.72 | 294,315,000 | 115.28 | 288,222,500 | 1.5 | 2034/3/20 | 1.92 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第144回利付国債（20年） | 250,000,000 | 117.05 | 292,627,500 | 114.69 | 286,727,500 | 1.5 | 2033/3/20 | 1.91 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第150回利付国債（20年） | 250,000,000 | 116.57 | 291,445,000 | 114.25 | 285,635,000 | 1.4 | 2034/9/20 | 1.90 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 第419回利付国債（2年）  | 250,000,000 | 100.45 | 251,125,000 | 100.38 | 250,965,000 | 0.1 | 2022/12/1 | 1.67 |

## ロ. 種類別投資比率

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 80.47   |
| 地方債証券 | 9.36    |
| 特殊債券  | 1.33    |
| 社債券   | 7.30    |
| 合計    | 98.46   |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

## 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    | 2,913,338,192  | 22.78   |
|                     | フランス   | 4,097,647,693  | 32.04   |
|                     | オランダ   | 888,212,335    | 6.95    |
|                     | スペイン   | 2,501,482,458  | 19.56   |
|                     | ベルギー   | 1,308,108,690  | 10.23   |
|                     | オーストリア | 844,996,163    | 6.61    |
|                     | 小計     | 12,553,785,531 | 98.17   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 234,047,165    | 1.83    |
| 合計(純資産総額)           |        | 12,787,832,696 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                    | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|------|------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | ドイツ    | 国債証券 | DBR 4.000<br>01/04/37  | 3,400,000 | 21,896.86       | 744,493,441     | 21,231.61       | 721,874,885     | 4         | 2037/1/4   | 5.65            |
| 2  | フランス   | 国債証券 | FRTR 2.500<br>05/25/30 | 4,000,000 | 16,316.81       | 652,672,440     | 15,991.35       | 639,654,120     | 2.5       | 2030/5/25  | 5.00            |
| 3  | スペイン   | 国債証券 | SPGB 1.950<br>07/30/30 | 4,000,000 | 15,185.45       | 607,418,281     | 14,856.12       | 594,244,980     | 1.95      | 2030/7/30  | 4.65            |
| 4  | フランス   | 国債証券 | FRTR 4.000<br>10/25/38 | 2,700,000 | 21,701.07       | 585,929,011     | 20,844.81       | 562,809,870     | 4         | 2038/10/25 | 4.40            |
| 5  | ドイツ    | 国債証券 | DBR 4.750<br>07/04/34  | 2,500,000 | 22,011.16       | 550,279,091     | 21,440.96       | 536,024,160     | 4.75      | 2034/7/4   | 4.19            |
| 6  | フランス   | 国債証券 | FRTR 2.750<br>10/25/27 | 3,300,000 | 15,738.21       | 519,361,227     | 15,545.78       | 513,010,922     | 2.75      | 2027/10/25 | 4.01            |
| 7  | フランス   | 国債証券 | FRTR 1.250<br>05/25/34 | 3,500,000 | 15,105.38       | 528,688,440     | 14,613.32       | 511,466,286     | 1.25      | 2034/5/25  | 4.00            |
| 8  | ドイツ    | 国債証券 | DBR 4.750<br>07/04/28  | 2,700,000 | 18,201.62       | 491,443,905     | 17,948.10       | 484,598,826     | 4.75      | 2028/7/4   | 3.79            |
| 9  | スペイン   | 国債証券 | SPGB 1.950<br>04/30/26 | 3,000,000 | 14,472.54       | 434,176,470     | 14,307.23       | 429,217,110     | 1.95      | 2026/4/30  | 3.36            |

|    |            |      |                          |           |           |             |           |             |      |            |      |
|----|------------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|------------|------|
| 10 | スペイン       | 国債証券 | SPGB 4.700<br>07/30/41   | 1,900,000 | 22,673.57 | 430,797,906 | 21,615.83 | 410,700,875 | 4.7  | 2041/7/30  | 3.21 |
| 11 | スペイン       | 国債証券 | SPGB 4.200<br>01/31/37   | 2,100,000 | 20,040.51 | 420,850,902 | 19,431.90 | 408,070,089 | 4.2  | 2037/1/31  | 3.19 |
| 12 | フランス       | 国債証券 | FRTR 4.250<br>10/25/23   | 2,700,000 | 14,654.00 | 395,658,128 | 14,589.42 | 393,914,603 | 4.25 | 2023/10/25 | 3.08 |
| 13 | ドイツ        | 国債証券 | DBR 0.250<br>02/15/29    | 2,900,000 | 13,786.76 | 399,816,112 | 13,574.82 | 393,669,993 | 0.25 | 2029/2/15  | 3.08 |
| 14 | フランス       | 国債証券 | FRTR 3.250<br>05/25/45   | 1,900,000 | 21,548.67 | 409,424,873 | 20,556.80 | 390,579,305 | 3.25 | 2045/5/25  | 3.05 |
| 15 | ベルギー       | 国債証券 | BGB 5.000<br>03/28/35    | 1,800,000 | 22,026.53 | 396,477,585 | 21,308.45 | 383,552,253 | 5    | 2035/3/28  | 3.00 |
| 16 | フランス       | 国債証券 | FRTR 2.250<br>05/25/24   | 2,600,000 | 14,156.77 | 368,076,208 | 14,090.26 | 366,346,890 | 2.25 | 2024/5/25  | 2.86 |
| 17 | フランス       | 国債証券 | FRTR 0.500<br>05/25/25   | 2,300,000 | 13,525.23 | 311,080,376 | 13,452.90 | 309,416,924 | 0.5  | 2025/5/25  | 2.42 |
| 18 | オランダ       | 国債証券 | NETHER 2.500<br>01/15/33 | 1,800,000 | 17,328.05 | 311,904,999 | 16,900.56 | 304,210,242 | 2.5  | 2033/1/15  | 2.38 |
| 19 | ドイツ        | 国債証券 | DBR 0.500<br>02/15/26    | 2,000,000 | 13,711.72 | 274,234,527 | 13,604.40 | 272,088,054 | 0.5  | 2026/2/15  | 2.13 |
| 20 | ドイツ        | 国債証券 | DBR 1.500<br>02/15/23    | 1,900,000 | 13,501.72 | 256,532,841 | 13,468.92 | 255,909,563 | 1.5  | 2023/2/15  | 2.00 |
| 21 | ベルギー       | 国債証券 | BGB 0.900<br>06/22/29    | 1,800,000 | 14,125.13 | 254,252,439 | 13,837.13 | 249,068,358 | 0.9  | 2029/6/22  | 1.95 |
| 22 | スペイン       | 国債証券 | SPGB 1.500<br>04/30/27   | 1,700,000 | 14,306.59 | 243,212,051 | 14,133.53 | 240,270,014 | 1.5  | 2027/4/30  | 1.88 |
| 23 | フランス       | 国債証券 | FRTR 1.500<br>05/25/31   | 1,500,000 | 14,970.80 | 224,562,146 | 14,831.58 | 222,473,790 | 1.5  | 2031/5/25  | 1.74 |
| 24 | スペイン       | 国債証券 | SPGB 2.150<br>10/31/25   | 1,400,000 | 14,481.58 | 202,742,253 | 14,348.56 | 200,879,910 | 2.15 | 2025/10/31 | 1.57 |
| 25 | オースト<br>リア | 国債証券 | RAGB 1.500<br>02/20/47   | 1,200,000 | 17,135.62 | 205,627,464 | 16,182.49 | 194,189,940 | 1.5  | 2047/2/20  | 1.52 |
| 26 | オランダ       | 国債証券 | NETHER 0.250<br>07/15/29 | 1,400,000 | 13,665.36 | 191,315,061 | 13,449.68 | 188,295,534 | 0.25 | 2029/7/15  | 1.47 |
| 27 | ベルギー       | 国債証券 | BGB 1.600<br>06/22/47    | 1,200,000 | 16,495.03 | 197,940,456 | 15,363.68 | 184,364,208 | 1.6  | 2047/6/22  | 1.44 |
| 28 | オースト<br>リア | 国債証券 | RAGB 2.400<br>05/23/34   | 1,100,000 | 17,267.35 | 189,940,905 | 16,692.63 | 183,619,013 | 2.4  | 2034/5/23  | 1.44 |
| 29 | ベルギー       | 国債証券 | BGB 0.800<br>06/22/27    | 1,300,000 | 13,872.00 | 180,336,019 | 13,688.60 | 177,951,910 | 0.8  | 2027/6/22  | 1.39 |
| 30 | スペイン       | 国債証券 | SPGB 3.800<br>04/30/24   | 1,000,000 | 14,715.35 | 147,153,510 | 14,624.30 | 146,243,003 | 3.8  | 2024/4/30  | 1.14 |

## ロ. 種類別投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|----|---------|
|----|---------|

|      |       |
|------|-------|
| 国債証券 | 98.17 |
| 合計   | 98.17 |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきん米国ソブリン債マザーファンド

## 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   | 11,009,146,062 | 86.65   |
| 特殊債券                | 国際機関   | 1,559,754,250  | 12.28   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 136,351,528    | 1.07    |
| 合計(純資産総額)           |        | 12,705,251,840 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                      | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|------|--------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.875<br>05/31/25 | 5,500,000 | 11,762.20       | 646,921,386     | 11,622.75       | 639,251,464     | 2.875     | 2025/5/31  | 5.03            |
| 2  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.750<br>02/15/24 | 5,300,000 | 11,444.28       | 606,547,219     | 11,380.37       | 603,159,667     | 2.75      | 2024/2/15  | 4.75            |
| 3  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.500<br>08/15/23 | 5,300,000 | 11,252.53       | 596,384,570     | 11,211.86       | 594,228,860     | 2.5       | 2023/8/15  | 4.68            |
| 4  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.000<br>02/15/23 | 5,400,000 | 11,024.26       | 595,310,452     | 11,002.68       | 594,145,022     | 2         | 2023/2/15  | 4.68            |
| 5  | 国際機関   | 特殊債券 | ASIA 1.875<br>01/24/30   | 5,300,000 | 11,197.68       | 593,477,438     | 10,942.68       | 579,962,438     | 1.875     | 2030/1/24  | 4.56            |
| 6  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.625<br>01/31/26 | 5,000,000 | 11,752.24       | 587,612,305     | 11,573.77       | 578,688,968     | 2.625     | 2026/1/31  | 4.55            |
| 7  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 1.375<br>06/30/23 | 5,300,000 | 10,936.27       | 579,622,806     | 10,903.07       | 577,863,040     | 1.375     | 2023/6/30  | 4.55            |
| 8  | アメリカ   | 国債証券 | T-BOND 4.750<br>02/15/37 | 3,800,000 | 15,550.68       | 590,925,976     | 14,882.47       | 565,533,888     | 4.75      | 2037/2/15  | 4.45            |
| 9  | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.000<br>08/15/25 | 5,000,000 | 11,391.16       | 569,558,107     | 11,250.87       | 562,543,945     | 2         | 2025/8/15  | 4.43            |
| 10 | アメリカ   | 国債証券 | T-BOND 3.125<br>02/15/42 | 4,500,000 | 13,177.49       | 592,987,063     | 12,387.25       | 557,426,516     | 3.125     | 2042/2/15  | 4.39            |
| 11 | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 1.750<br>05/15/23 | 5,000,000 | 11,011.81       | 550,590,820     | 10,985.25       | 549,262,695     | 1.75      | 2023/5/15  | 4.32            |
| 12 | アメリカ   | 国債証券 | T-NOTE 2.750<br>11/15/23 | 4,400,000 | 11,383.69       | 500,882,422     | 11,330.56       | 498,544,922     | 2.75      | 2023/11/15 | 3.92            |

|    |      |      |                          |           |           |             |           |             |       |            |      |
|----|------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| 13 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 2.375<br>03/15/22 | 4,500,000 | 10,889.79 | 490,040,774 | 10,874.85 | 489,368,410 | 2.375 | 2022/3/15  | 3.85 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 1.625<br>05/15/26 | 4,200,000 | 11,232.61 | 471,769,922 | 11,049.16 | 464,065,138 | 1.625 | 2026/5/15  | 3.65 |
| 15 | 国際機関 | 特殊債券 | IBRD 0.750<br>11/24/27   | 4,500,000 | 10,507.06 | 472,817,812 | 10,309.43 | 463,924,687 | 0.75  | 2027/11/24 | 3.65 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 2.625<br>02/15/29 | 3,700,000 | 11,986.32 | 443,494,140 | 11,694.14 | 432,683,203 | 2.625 | 2029/2/15  | 3.41 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 3.125<br>11/15/28 | 3,500,000 | 12,378.12 | 433,234,375 | 12,066.84 | 422,339,600 | 3.125 | 2028/11/15 | 3.32 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 1.625<br>08/15/29 | 3,800,000 | 11,147.94 | 423,622,070 | 10,855.76 | 412,518,945 | 1.625 | 2029/8/15  | 3.25 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 4.375<br>05/15/40 | 2,700,000 | 15,350.63 | 414,467,140 | 14,537.98 | 392,525,683 | 4.375 | 2040/5/15  | 3.09 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 2.500<br>05/15/46 | 3,200,000 | 11,890.86 | 380,507,814 | 11,078.22 | 354,503,125 | 2.5   | 2046/5/15  | 2.79 |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 3.625<br>02/15/44 | 2,200,000 | 14,210.10 | 312,622,364 | 13,332.71 | 293,319,727 | 3.625 | 2044/2/15  | 2.31 |
| 22 | 国際機関 | 特殊債券 | IBRD 1.875<br>10/27/26   | 2,600,000 | 11,323.06 | 294,399,625 | 11,158.37 | 290,117,750 | 1.875 | 2026/10/27 | 2.28 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 3.125<br>05/15/48 | 2,300,000 | 13,349.31 | 307,034,277 | 12,470.26 | 286,816,065 | 3.125 | 2048/5/15  | 2.26 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 2.250<br>11/15/25 | 2,500,000 | 11,489.11 | 287,227,783 | 11,375.39 | 284,384,766 | 2.25  | 2025/11/15 | 2.24 |
| 25 | 国際機関 | 特殊債券 | IADB 2.125<br>01/15/25   | 2,000,000 | 11,340.06 | 226,801,250 | 11,287.46 | 225,749,375 | 2.125 | 2025/1/15  | 1.78 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | T-NOTE 1.500<br>02/15/30 | 2,000,000 | 11,001.02 | 220,020,509 | 10,712.98 | 214,259,766 | 1.5   | 2030/2/15  | 1.69 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 3.500<br>02/15/39 | 1,400,000 | 13,593.35 | 190,307,031 | 13,057.12 | 182,799,805 | 3.5   | 2039/2/15  | 1.44 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 5.250<br>02/15/29 | 1,100,000 | 14,178.56 | 155,964,209 | 13,836.57 | 152,202,295 | 5.25  | 2029/2/15  | 1.20 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 6.500<br>11/15/26 | 1,000,000 | 14,175.24 | 141,752,442 | 13,935.35 | 139,353,516 | 6.5   | 2026/11/15 | 1.10 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | T-BOND 6.250<br>08/15/23 | 1,100,000 | 12,260.25 | 134,862,792 | 12,198.82 | 134,187,109 | 6.25  | 2023/8/15  | 1.06 |

## □. 種類別投資比率

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 86.65   |
| 特殊債券 | 12.28   |
| 合計   | 98.93   |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきん高格付外国債券マザーファンド

## 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     | 238,436,017   | 10.26   |
|                     | イギリス    | 199,152,660   | 8.57    |
|                     | ノルウェー   | 360,346,320   | 15.50   |
|                     | 小計      | 797,934,997   | 34.33   |
| 地方債証券               | カナダ     | 244,451,294   | 10.52   |
|                     | オーストラリア | 580,034,746   | 24.95   |
|                     | 小計      | 824,486,040   | 35.47   |
| 特殊債券                | カナダ     | 87,180,475    | 3.75    |
|                     | 国際機関    | 581,038,208   | 25.00   |
|                     | 小計      | 668,218,683   | 28.75   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —       | 33,925,845    | 1.46    |
| 合計(純資産総額)           |         | 2,324,565,565 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域  | 種類    | 銘柄名                     | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限      | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|---------|-------|-------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|
| 1  | カナダ     | 国債証券  | CAN 1.500<br>06/01/26   | 2,760,000  | 8,907.86        | 245,857,128     | 8,638.98        | 238,436,017     | 1.5       | 2026/6/1  | 10.26           |
| 2  | 国際機関    | 特殊債券  | IBRD 1.750<br>11/06/24  | 16,700,000 | 1,302.94        | 217,591,100     | 1,273.23        | 212,630,078     | 1.75      | 2024/11/6 | 9.15            |
| 3  | オーストラリア | 地方債証券 | NSWTC 3.000<br>05/20/27 | 2,200,000  | 9,504.67        | 209,102,861     | 9,249.14        | 203,481,142     | 3         | 2027/5/20 | 8.75            |
| 4  | 国際機関    | 特殊債券  | EIB 5.500<br>04/15/25   | 990,000    | 18,539.36       | 183,539,677     | 17,925.99       | 177,467,305     | 5.5       | 2025/4/15 | 7.63            |
| 5  | カナダ     | 地方債証券 | BRCOL 2.300<br>06/18/26 | 1,910,000  | 9,064.29        | 173,128,006     | 8,825.07        | 168,558,976     | 2.3       | 2026/6/18 | 7.25            |
| 6  | オーストラリア | 地方債証券 | NSWTC 1.250<br>03/20/25 | 1,780,000  | 8,574.24        | 152,621,621     | 8,565.59        | 152,467,549     | 1.25      | 2025/3/20 | 6.56            |
| 7  | ノルウェー   | 国債証券  | NGB 1.500<br>02/19/26   | 10,660,000 | 1,313.38        | 140,006,851     | 1,270.87        | 135,474,785     | 1.5       | 2026/2/19 | 5.83            |

|    |         |       |                          |            |           |             |           |             |       |            |      |
|----|---------|-------|--------------------------|------------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| 8  | ノルウェー   | 国債証券  | NGB 1.750<br>03/13/25    | 10,400,000 | 1,315.19  | 136,780,711 | 1,286.54  | 133,800,659 | 1.75  | 2025/3/13  | 5.76 |
| 9  | 国際機関    | 特殊債券  | IBRD 0.250<br>07/22/26   | 900,000    | 14,797.07 | 133,173,642 | 14,588.16 | 131,293,440 | 0.25  | 2026/7/22  | 5.65 |
| 10 | オーストラリア | 地方債証券 | TCV 5.500<br>11/17/26    | 1,200,000  | 10,766.45 | 129,197,448 | 10,410.57 | 124,926,911 | 5.5   | 2026/11/17 | 5.37 |
| 11 | イギリス    | 国債証券  | UKT 4.250<br>12/07/27    | 660,000    | 19,409.17 | 128,100,526 | 18,551.09 | 122,437,202 | 4.25  | 2027/12/7  | 5.27 |
| 12 | オーストラリア | 地方債証券 | TCV 5.500<br>12/17/24    | 1,000,000  | 10,137.16 | 101,371,608 | 9,915.91  | 99,159,144  | 5.5   | 2024/12/17 | 4.27 |
| 13 | ノルウェー   | 国債証券  | NGB 1.750<br>02/17/27    | 7,100,000  | 1,344.32  | 95,446,870  | 1,282.68  | 91,070,876  | 1.75  | 2027/2/17  | 3.92 |
| 14 | カナダ     | 特殊債券  | CANHOU 2.650<br>12/15/28 | 960,000    | 9,618.46  | 92,337,277  | 9,081.29  | 87,180,475  | 2.65  | 2028/12/15 | 3.75 |
| 15 | イギリス    | 国債証券  | UKT 1.625<br>10/22/28    | 480,000    | 16,659.15 | 79,963,963  | 15,982.38 | 76,715,458  | 1.625 | 2028/10/22 | 3.30 |
| 16 | カナダ     | 地方債証券 | BRCOL 2.550<br>06/18/27  | 850,000    | 9,265.03  | 78,752,808  | 8,928.50  | 75,892,318  | 2.55  | 2027/6/18  | 3.26 |
| 17 | 国際機関    | 特殊債券  | IBRD 1.000<br>12/21/29   | 400,000    | 15,611.48 | 62,445,936  | 14,911.84 | 59,647,385  | 1     | 2029/12/21 | 2.57 |

ロ.種類別投資比率

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券  | 34.33   |
| 地方債証券 | 35.47   |
| 特殊債券  | 28.75   |
| 合計    | 98.54   |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきんＪリートマザーファンド

## 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   | 5,238,692,240 | 98.27   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 92,386,105    | 1.73    |
| 合計(純資産総額)           |      | 5,331,078,345 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国／地域 | 種類   | 銘柄名                | 数量    | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|----|------|------|--------------------|-------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人       | 598   | 613,622         | 366,946,039     | 651,000         | 389,298,000     | 7.30            |
| 2  | 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人   | 549   | 559,334         | 307,074,838     | 649,000         | 356,301,000     | 6.68            |
| 3  | 日本   | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人  | 1,869 | 138,008         | 257,937,138     | 159,500         | 298,105,500     | 5.59            |
| 4  | 日本   | 投資証券 | G L P 投資法人         | 1,429 | 152,381         | 217,752,755     | 172,600         | 246,645,400     | 4.63            |
| 5  | 日本   | 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人     | 2,332 | 78,447          | 182,940,246     | 105,300         | 245,559,600     | 4.61            |
| 6  | 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人     | 735   | 316,479         | 232,612,623     | 326,000         | 239,610,000     | 4.49            |
| 7  | 日本   | 投資証券 | オリックス不動産投資法人       | 1,155 | 154,087         | 177,970,658     | 181,300         | 209,401,500     | 3.93            |
| 8  | 日本   | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人       | 687   | 258,684         | 177,716,409     | 279,600         | 192,085,200     | 3.60            |
| 9  | 日本   | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人    | 1,260 | 120,760         | 152,157,650     | 146,200         | 184,212,000     | 3.46            |
| 10 | 日本   | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人    | 385   | 323,845         | 124,680,375     | 385,500         | 148,417,500     | 2.78            |
| 11 | 日本   | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 | 310   | 393,308         | 121,925,656     | 468,000         | 145,080,000     | 2.72            |
| 12 | 日本   | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人    | 388   | 310,498         | 120,473,309     | 323,500         | 125,518,000     | 2.35            |
| 13 | 日本   | 投資証券 | 産業ファンド投資法人         | 669   | 171,869         | 114,980,381     | 183,000         | 122,427,000     | 2.30            |
| 14 | 日本   | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人      | 1,373 | 73,326          | 100,677,353     | 84,600          | 116,155,800     | 2.18            |
| 15 | 日本   | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人      | 244   | 364,082         | 88,836,066      | 468,000         | 114,192,000     | 2.14            |
| 16 | 日本   | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人   | 1,689 | 48,709          | 82,269,585      | 65,700          | 110,967,300     | 2.08            |

|    |    |      |                     |       |         |             |         |             |      |
|----|----|------|---------------------|-------|---------|-------------|---------|-------------|------|
| 17 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人     | 157   | 637,418 | 100,074,632 | 704,000 | 110,528,000 | 2.07 |
| 18 | 日本 | 投資証券 | 大和証券オフィス投資法人        | 147   | 616,522 | 90,628,795  | 729,000 | 107,163,000 | 2.01 |
| 19 | 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人   | 301   | 292,721 | 88,109,318  | 312,000 | 93,912,000  | 1.76 |
| 20 | 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人          | 630   | 119,776 | 75,459,006  | 148,200 | 93,366,000  | 1.75 |
| 21 | 日本 | 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人     | 513   | 150,059 | 76,980,774  | 181,300 | 93,006,900  | 1.74 |
| 22 | 日本 | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人        | 2,150 | 30,948  | 66,538,931  | 43,200  | 92,880,000  | 1.74 |
| 23 | 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人         | 589   | 140,223 | 82,591,835  | 147,500 | 86,877,500  | 1.63 |
| 24 | 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人       | 529   | 157,888 | 83,522,905  | 160,700 | 85,010,300  | 1.59 |
| 25 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス商業リート投資法人     | 293   | 214,707 | 62,909,224  | 270,200 | 79,168,600  | 1.49 |
| 26 | 日本 | 投資証券 | ジャパンエクセレント投資法人      | 575   | 126,083 | 72,498,001  | 137,200 | 78,890,000  | 1.48 |
| 27 | 日本 | 投資証券 | 日本リート投資法人           | 193   | 358,568 | 69,203,799  | 396,000 | 76,428,000  | 1.43 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人  | 125   | 608,998 | 76,124,775  | 594,000 | 74,250,000  | 1.39 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人       | 415   | 141,373 | 58,669,894  | 168,300 | 69,844,500  | 1.31 |
| 30 | 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 | 134   | 478,180 | 64,076,134  | 519,000 | 69,546,000  | 1.30 |

## ロ. 種類別投資比率

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.27   |
| 合計   | 98.27   |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきんグローバルリートマザーファンド

## 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     | 3,454,719,193 | 73.20   |
|                     | カナダ      | 89,549,293    | 1.90    |
|                     | ドイツ      | 13,847,157    | 0.29    |
|                     | イタリア     | 898,739       | 0.02    |
|                     | フランス     | 112,011,016   | 2.37    |
|                     | オランダ     | 9,624,878     | 0.20    |
|                     | スペイン     | 23,163,278    | 0.49    |
|                     | ベルギー     | 65,989,061    | 1.40    |
|                     | アイルランド   | 6,123,439     | 0.13    |
|                     | イギリス     | 282,737,572   | 5.99    |
|                     | オーストラリア  | 341,186,929   | 7.23    |
|                     | ニュージーランド | 22,558,000    | 0.48    |
|                     | 香港       | 81,769,066    | 1.73    |
|                     | シンガポール   | 191,256,248   | 4.05    |
|                     | 韓国       | 5,459,069     | 0.12    |
|                     | イスラエル    | 2,891,096     | 0.06    |
|                     | 小計       | 4,703,784,034 | 99.66   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —        | 15,900,870    | 0.34    |
| 合計(純資産総額)           |          | 4,719,684,904 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                       | 数量     | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(％) |
|----|--------|------|---------------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アメリカ   | 投資証券 | PROLOGIS INC              | 25,067 | 10,246.75       | 256,855,283     | 10,772.68       | 270,038,958     | 5.72            |
| 2  | アメリカ   | 投資証券 | EQUINIX INC               | 3,021  | 74,718.18       | 225,723,645     | 67,826.81       | 204,904,801     | 4.34            |
| 3  | アメリカ   | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 11,119 | 8,192.93        | 91,097,272      | 12,199.62       | 135,647,630     | 2.87            |
| 4  | アメリカ   | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC  | 9,496  | 14,722.00       | 139,800,112     | 14,276.81       | 135,572,611     | 2.87            |
| 5  | アメリカ   | 投資証券 | PUBLIC STORAGE            | 5,162  | 22,353.93       | 115,391,025     | 25,857.00       | 133,473,834     | 2.83            |
| 6  | アメリカ   | 投資証券 | WELLTOWER INC             | 14,157 | 6,078.56        | 86,054,209      | 7,467.24        | 105,713,858     | 2.24            |
| 7  | アメリカ   | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 4,734  | 17,570.56       | 83,179,043      | 19,159.00       | 90,698,706      | 1.92            |

|    |         |      |                                          |         |           |            |           |            |      |
|----|---------|------|------------------------------------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 8  | アメリカ    | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL                       | 11,613  | 6,457.87  | 74,995,303 | 7,090.06  | 82,336,896 | 1.74 |
| 9  | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP                            | 57,009  | 1,392.94  | 79,410,298 | 1,395.44  | 79,552,781 | 1.69 |
| 10 | アメリカ    | 投資証券 | REALTY INCOME CORP                       | 11,900  | 6,392.00  | 76,064,800 | 6,543.93  | 77,872,856 | 1.65 |
| 11 | アメリカ    | 投資証券 | VENTAS INC                               | 12,693  | 4,475.24  | 56,804,348 | 5,736.43  | 72,812,601 | 1.54 |
| 12 | アメリカ    | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE<br>EQUITIES INC   | 4,198   | 17,438.81 | 73,208,135 | 17,261.37 | 72,463,252 | 1.54 |
| 13 | 香港      | 投資証券 | LINK REIT                                | 70,100  | 914.76    | 64,124,722 | 1,017.22  | 71,307,472 | 1.51 |
| 14 | アメリカ    | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC                 | 2,208   | 26,050.37 | 57,519,228 | 27,736.56 | 61,242,330 | 1.30 |
| 15 | アメリカ    | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC                      | 3,643   | 15,153.37 | 55,203,746 | 16,532.50 | 60,227,898 | 1.28 |
| 16 | アメリカ    | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC                  | 4,376   | 11,019.18 | 48,219,964 | 13,762.56 | 60,224,973 | 1.28 |
| 17 | アメリカ    | 投資証券 | INVITATION HOMES INC                     | 18,989  | 2,997.31  | 56,915,967 | 3,156.68  | 59,942,339 | 1.27 |
| 18 | アメリカ    | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC                | 18,235  | 3,011.12  | 54,907,864 | 3,164.12  | 57,697,819 | 1.22 |
| 19 | アメリカ    | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT<br>COMMUNITIES INC | 3,873   | 12,869.00 | 49,841,637 | 14,652.93 | 56,750,827 | 1.20 |
| 20 | イギリス    | 投資証券 | SEGRO PLC                                | 40,355  | 1,342.25  | 54,166,870 | 1,376.40  | 55,545,009 | 1.18 |
| 21 | アメリカ    | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC                      | 18,169  | 2,442.68  | 44,381,189 | 2,996.24  | 54,438,866 | 1.15 |
| 22 | アメリカ    | 投資証券 | DUKE REALTY CORP                         | 12,594  | 3,914.24  | 49,296,064 | 4,252.12  | 53,551,262 | 1.13 |
| 23 | アメリカ    | 投資証券 | BOSTON PROPERTIES INC                    | 4,793   | 10,121.37 | 48,511,750 | 10,914.00 | 52,310,802 | 1.11 |
| 24 | アメリカ    | 投資証券 | UDR INC                                  | 10,014  | 4,117.53  | 41,233,007 | 4,502.87  | 45,091,790 | 0.96 |
| 25 | アメリカ    | 投資証券 | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC             | 19,216  | 2,064.43  | 39,670,231 | 2,316.25  | 44,509,060 | 0.94 |
| 26 | アメリカ    | 投資証券 | WP CAREY INC                             | 5,964   | 7,278.99  | 43,411,933 | 7,432.18  | 44,325,566 | 0.94 |
| 27 | オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP                            | 176,501 | 210.05    | 37,075,177 | 244.09    | 43,083,594 | 0.91 |
| 28 | アメリカ    | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC                | 23,836  | 1,364.25  | 32,518,263 | 1,738.25  | 41,432,927 | 0.88 |
| 29 | アメリカ    | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES<br>INC       | 5,763   | 6,586.44  | 37,957,672 | 6,638.50  | 38,257,676 | 0.81 |
| 30 | フランス    | 投資証券 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD                | 4,677   | 7,296.97  | 34,127,952 | 7,896.23  | 36,930,672 | 0.78 |

## ロ.種類別投資比率

| 種類   | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 投資証券 | 99.66   |
| 合計   | 99.66   |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## しんきん短期国内債券マザーファンド

## 投資状況

| 資産の種類               | 国 / 地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|---------------------|--------|----------------|---------|
| 地方債証券               | 日本     | 43,315,522,400 | 53.76   |
| 特殊債券                | 日本     | 19,503,592,550 | 24.21   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 17,746,416,939 | 22.03   |
| 合計(純資産総額)           |        | 80,565,531,889 | 100.00  |

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

| 順位 | 国 / 地域 | 種類    | 銘柄名                      | 数量            | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|-------|--------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本     | 地方債証券 | 第102回共同発行市場公募地方債         | 8,400,000,000 | 101.03          | 8,486,973,000   | 100.58          | 8,448,804,000   | 1.03      | 2021/9/24  | 10.49           |
| 2  | 日本     | 特殊債券  | 第15回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年） | 8,000,000,000 | 100.12          | 8,010,080,000   | 100.01          | 8,000,800,000   | 0.167     | 2021/3/19  | 9.93            |
| 3  | 日本     | 地方債証券 | 第105回共同発行市場公募地方債         | 7,000,000,000 | 100.94          | 7,066,150,000   | 100.86          | 7,060,550,000   | 1.07      | 2021/12/24 | 8.76            |
| 4  | 日本     | 地方債証券 | 第103回共同発行市場公募地方債         | 6,870,000,000 | 101.01          | 6,939,643,200   | 100.64          | 6,914,448,900   | 1         | 2021/10/25 | 8.58            |
| 5  | 日本     | 地方債証券 | 第96回共同発行市場公募地方債          | 4,450,000,000 | 100.76          | 4,483,870,000   | 100.09          | 4,454,183,000   | 1.29      | 2021/3/25  | 5.53            |
| 6  | 日本     | 特殊債券  | 第211回政府保証預金保険機構債         | 2,300,000,000 | 100.16          | 2,303,680,000   | 100.07          | 2,301,679,000   | 0.1       | 2021/10/19 | 2.86            |
| 7  | 日本     | 地方債証券 | 第695回東京都公募公債             | 2,100,000,000 | 100.68          | 2,114,408,000   | 100.06          | 2,101,428,000   | 1.2       | 2021/3/19  | 2.61            |
| 8  | 日本     | 特殊債券  | 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券     | 2,000,000,000 | 100.15          | 2,003,040,000   | 100.04          | 2,000,800,000   | 0.15      | 2021/5/28  | 2.48            |
| 9  | 日本     | 地方債証券 | 第106回共同発行市場公募地方債         | 1,700,000,000 | 100.98          | 1,716,660,000   | 100.86          | 1,714,722,000   | 0.97      | 2022/1/25  | 2.13            |
| 10 | 日本     | 地方債証券 | 第694回東京都公募公債             | 1,650,000,000 | 100.76          | 1,662,689,000   | 100.07          | 1,651,254,000   | 1.35      | 2021/3/19  | 2.05            |
| 11 | 日本     | 地方債証券 | 第100回共同発行市場公募地方債         | 1,450,000,000 | 101.02          | 1,464,862,500   | 100.47          | 1,456,945,500   | 1.21      | 2021/7/23  | 1.81            |

|    |    |       |                            |               |        |               |        |               |       |            |      |
|----|----|-------|----------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 12 | 日本 | 特殊債券  | 第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,436,000,000 | 101.07 | 1,451,437,000 | 100.68 | 1,445,764,800 | 1     | 2021/10/29 | 1.79 |
| 13 | 日本 | 特殊債券  | 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 1,300,000,000 | 100.96 | 1,312,481,000 | 100.14 | 1,301,885,000 | 1.9   | 2021/3/26  | 1.62 |
| 14 | 日本 | 特殊債券  | 第137回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1,000,000,000 | 100.47 | 1,004,790,000 | 100.41 | 1,004,110,000 | 1.2   | 2021/6/30  | 1.25 |
| 15 | 日本 | 地方債証券 | 第693回東京都公募公債               | 900,000,000   | 100.81 | 907,335,000   | 100.07 | 900,702,000   | 1.38  | 2021/3/19  | 1.12 |
| 16 | 日本 | 地方債証券 | 平成22年度第9回福岡市公募公債           | 800,000,000   | 100.80 | 806,408,000   | 100.09 | 800,768,000   | 1.32  | 2021/3/25  | 0.99 |
| 17 | 日本 | 地方債証券 | 第101回共同発行市場公募地方債           | 620,000,000   | 101.01 | 626,276,000   | 100.50 | 623,149,600   | 1.05  | 2021/8/25  | 0.77 |
| 18 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第6回福岡市公募公債           | 550,000,000   | 100.98 | 555,417,500   | 100.65 | 553,602,500   | 1     | 2021/10/28 | 0.69 |
| 19 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第2回横浜市公募公債           | 510,000,000   | 101.09 | 515,574,300   | 100.44 | 512,289,900   | 1.201 | 2021/7/15  | 0.64 |
| 20 | 日本 | 特殊債券  | 第155回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 500,000,000   | 100.97 | 504,885,000   | 100.84 | 504,245,000   | 0.9   | 2022/1/31  | 0.63 |
| 21 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第3回広島県公募公債           | 500,000,000   | 100.98 | 504,930,000   | 100.63 | 503,150,000   | 1.1   | 2021/9/27  | 0.62 |
| 22 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第9回愛知県公募公債（10年）      | 500,000,000   | 101.02 | 505,145,000   | 100.59 | 502,955,000   | 1.019 | 2021/9/30  | 0.62 |
| 23 | 日本 | 地方債証券 | 第698回東京都公募公債               | 500,000,000   | 100.64 | 503,225,000   | 100.31 | 501,580,000   | 1.05  | 2021/6/18  | 0.62 |
| 24 | 日本 | 特殊債券  | 第47回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債     | 500,000,000   | 100.01 | 500,060,000   | 100.00 | 500,005,000   | 0.001 | 2021/3/26  | 0.62 |
| 25 | 日本 | 地方債証券 | 平成28年度第1回福岡市公募公債（5年）       | 500,000,000   | 99.99  | 499,955,000   | 99.99  | 499,970,000   | 0.005 | 2021/6/24  | 0.62 |
| 26 | 日本 | 地方債証券 | 第99回共同発行市場公募地方債            | 450,000,000   | 100.91 | 454,138,500   | 100.37 | 451,683,000   | 1.17  | 2021/6/25  | 0.56 |
| 27 | 日本 | 特殊債券  | 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）    | 410,000,000   | 100.64 | 412,644,500   | 100.33 | 411,389,900   | 0.576 | 2021/9/24  | 0.51 |
| 28 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第7回愛知県公募公債（10年）      | 400,000,000   | 101.03 | 404,127,000   | 100.45 | 401,824,000   | 1.11  | 2021/7/29  | 0.50 |
| 29 | 日本 | 地方債証券 | 第697回東京都公募公債               | 400,000,000   | 100.81 | 403,265,000   | 100.33 | 401,336,000   | 1.11  | 2021/6/18  | 0.50 |
| 30 | 日本 | 地方債証券 | 平成23年度第3回福岡県公募公債           | 350,000,000   | 101.01 | 353,566,500   | 100.52 | 351,820,000   | 1.07  | 2021/8/26  | 0.44 |

## ロ.種類別投資比率

| 種類    | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 地方債証券 | 53.76   |
| 特殊債券  | 24.21   |
| 合計    | 77.97   |

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

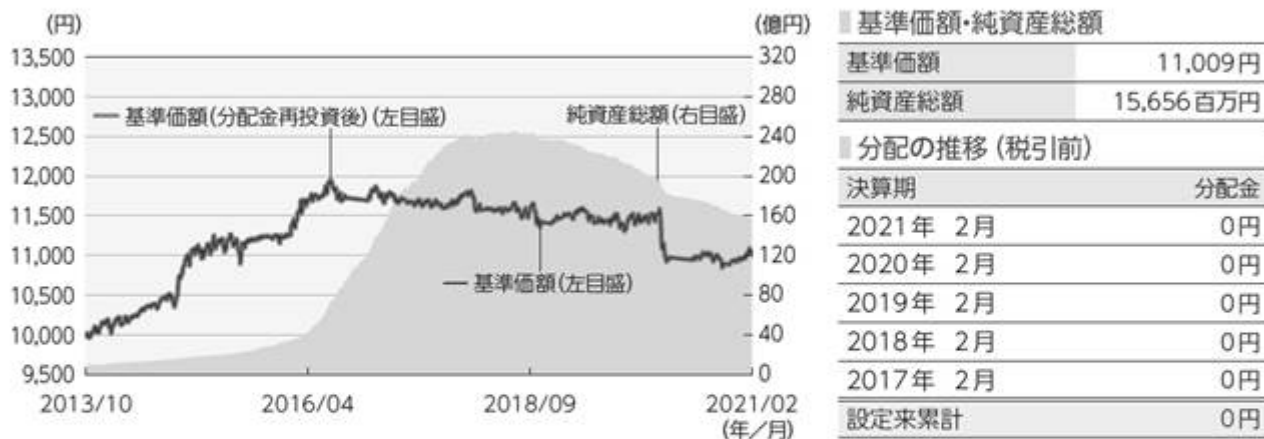
## (参考情報) 運用実績

データは2021年2月26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

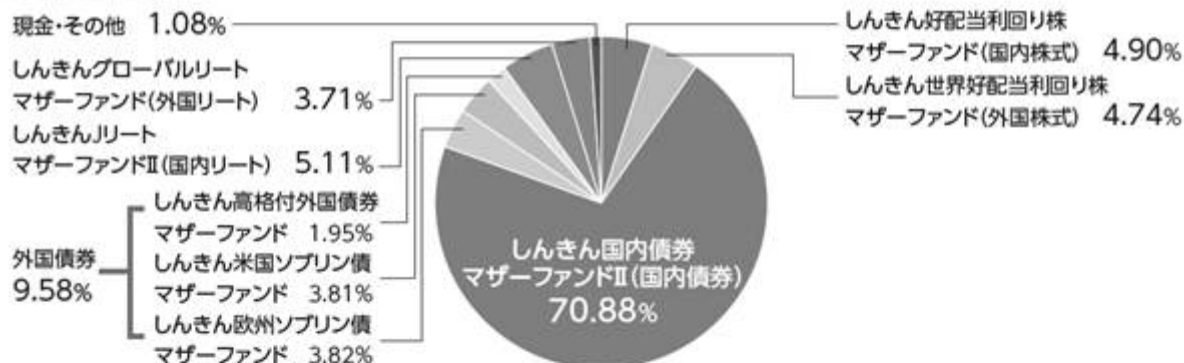


※基準価額および分配金は1万口当たりです。

※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。

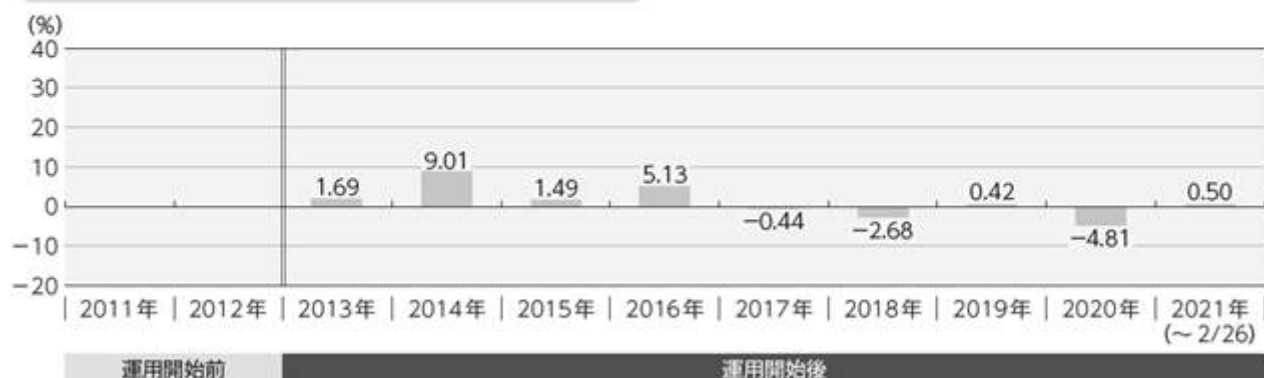
## 主要な資産の状況

### 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の純資産総額に対する比率です。

## 年間収益率の推移（期間:2011年～2021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。

※2013年は10月25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。

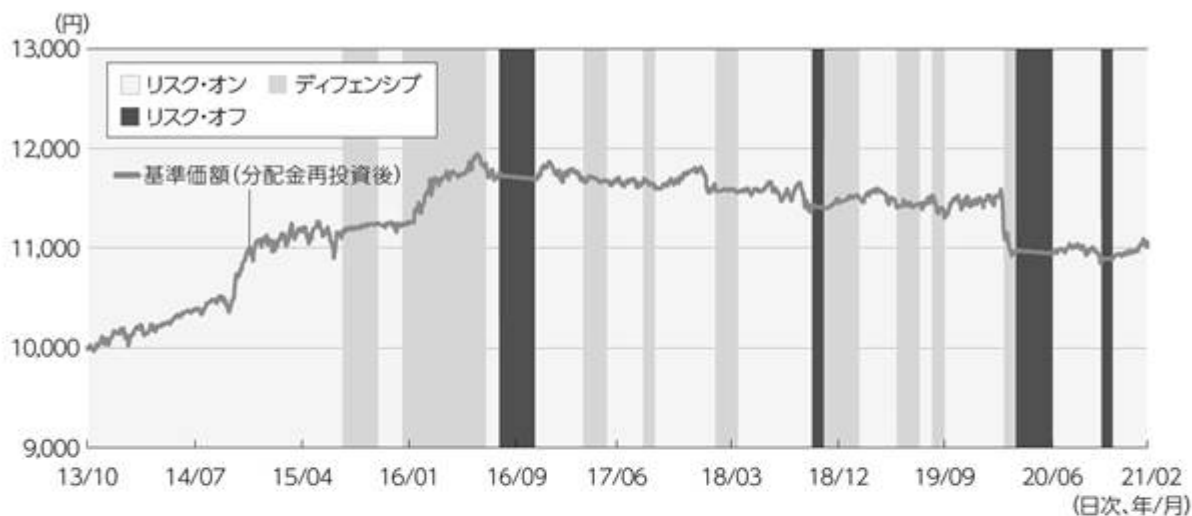
※上記の収益率は決算時の分配金を非課税で再投資したものと計算しています。

※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

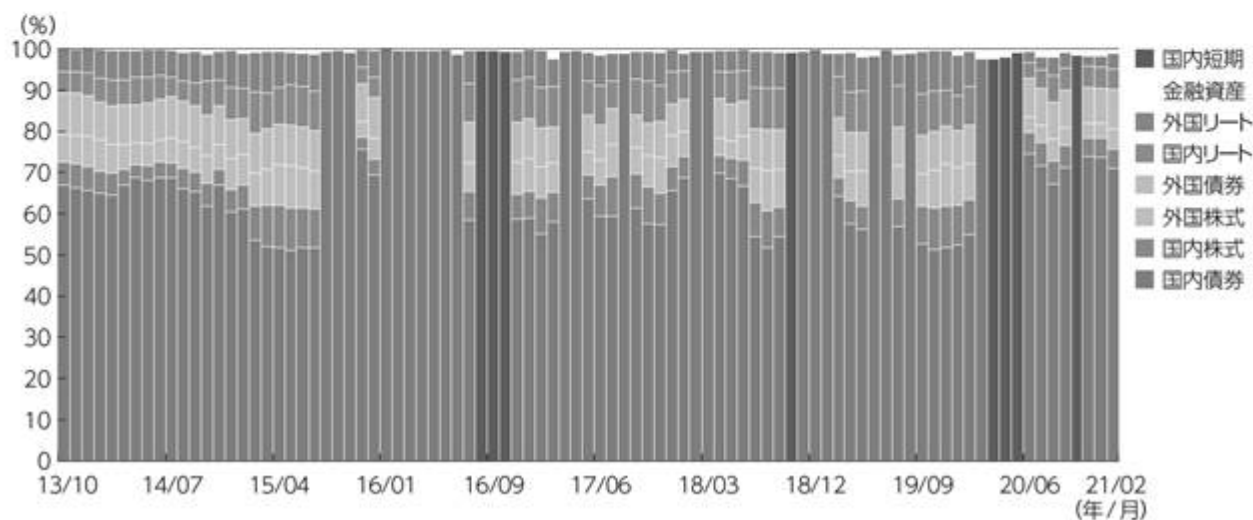
データは2021年2月26日現在です。

### ■ 基準価額と資産別配分（アロケーション）の変遷



※上記の「リスク・オン（6つの資産に分散投資）」、「ディフェンシブ（国内債券中心）」および「リスク・オフ（国内短期金融資産中心）」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（2013年10月～2021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  | 三井物産               | 卸売業     | 1.29% | REPSOL SA                   | スペイン    | エネルギー       | 3.66% |
| 2  | 九州旅客鉄道             | 陸運業     | 1.29% | INTL BUSINESS MACHINES CORP | アメリカ    | ソフトウェア・サービス | 3.57% |
| 3  | ニコン                | 精密機器    | 1.25% | INTEL CORP                  | アメリカ    | 半導体・半導体製造装置 | 3.30% |
| 4  | ENEOSホールディングス      | 石油・石炭製品 | 1.25% | NATWEST GROUP PLC           | イギリス    | 銀行          | 3.23% |
| 5  | LIXIL              | 金属製品    | 1.24% | CENTRICA PLC                | イギリス    | 公益事業        | 3.10% |
| 6  | 日本テレビホールディングス      | 情報・通信業  | 1.23% | WM MORRISON SUPERMARKETS    | イギリス    | 食品・生活必需品小売り | 3.08% |
| 7  | 出光興産               | 石油・石炭製品 | 1.23% | ENI SPA                     | イタリア    | エネルギー       | 2.98% |
| 8  | 日本精工               | 機械      | 1.22% | IMPERIAL BRANDS PLC         | イギリス    | 食品・飲料・タバコ   | 2.88% |
| 9  | 住友商事               | 卸売業     | 1.22% | SOUTH32 LTD                 | オーストラリア | 素材          | 2.72% |
| 10 | H.U.グループホールディングス   | サービス業   | 1.22% | ANGLO AMERICAN PLC          | イギリス    | 素材          | 2.71% |

|    | 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346回利付国債(10年)   | 0.1% | 2027/03/20 | 3.34% | ドイツ国債              | 4.00% | 2037/01/04 | 5.65% |
| 2  | 第174回利付国債(20年)   | 0.4% | 2040/09/20 | 2.91% | フランス国債             | 2.50% | 2030/05/25 | 5.00% |
| 3  | 第144回利付国債(5年)    | 0.1% | 2025/06/20 | 2.68% | スペイン国債             | 1.95% | 2030/07/30 | 4.65% |
| 4  | 第137回利付国債(5年)    | 0.1% | 2023/09/20 | 2.67% | フランス国債             | 4.00% | 2038/10/25 | 4.40% |
| 5  | 第132回利付国債(5年)    | 0.1% | 2022/06/20 | 2.67% | ドイツ国債              | 4.75% | 2034/07/04 | 4.19% |
| 6  | 第413回利付国債(2年)    | 0.1% | 2022/06/01 | 2.67% | フランス国債             | 2.75% | 2027/10/25 | 4.01% |
| 7  | 第355回利付国債(10年)   | 0.1% | 2029/06/20 | 2.66% | フランス国債             | 1.25% | 2034/05/25 | 4.00% |
| 8  | 第357回利付国債(10年)   | 0.1% | 2029/12/20 | 2.65% | ドイツ国債              | 4.75% | 2028/07/04 | 3.79% |
| 9  | 第360回利付国債(10年)   | 0.1% | 2030/09/20 | 2.65% | スペイン国債             | 1.95% | 2026/04/30 | 3.36% |
| 10 | 第66回利付国債(30年)    | 0.4% | 2050/03/20 | 2.42% | スペイン国債             | 4.70% | 2041/07/30 | 3.21% |

|    | 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             | 2.875% | 2025/05/31 | 5.03% | カナダ国債              | 1.50% | 2026/06/01 | 10.26% |
| 2  | アメリカ国債             | 2.750% | 2024/02/15 | 4.75% | 国際機関債              | 1.75% | 2024/11/06 | 9.15%  |
| 3  | アメリカ国債             | 2.500% | 2023/08/15 | 4.68% | オーストラリア地方債         | 3.00% | 2027/05/20 | 8.75%  |
| 4  | アメリカ国債             | 2.000% | 2023/02/15 | 4.68% | 国際機関債              | 5.50% | 2025/04/15 | 7.63%  |
| 5  | 国際機関債              | 1.875% | 2030/01/24 | 4.56% | カナダ地方債             | 2.30% | 2026/06/18 | 7.25%  |
| 6  | アメリカ国債             | 2.625% | 2026/01/31 | 4.55% | オーストラリア地方債         | 1.25% | 2025/03/20 | 6.56%  |
| 7  | アメリカ国債             | 1.375% | 2023/06/30 | 4.55% | ノルウェー国債            | 1.50% | 2026/02/19 | 5.83%  |
| 8  | アメリカ国債             | 4.750% | 2037/02/15 | 4.45% | ノルウェー国債            | 1.75% | 2025/03/13 | 5.76%  |
| 9  | アメリカ国債             | 2.000% | 2025/08/15 | 4.43% | 国際機関債              | 0.25% | 2026/07/22 | 5.65%  |
| 10 | アメリカ国債             | 3.125% | 2042/02/15 | 4.39% | オーストラリア地方債         | 5.50% | 2026/11/17 | 5.37%  |

|    | 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      | 7.30% | PROLOGIS INC              | アメリカ    | 5.72% |
| 2  | ジャパンリアルエステイト投資法人  | 6.68% | EQUINIX INC               | アメリカ    | 4.34% |
| 3  | 野村不動産マスターファンド投資法人 | 5.59% | SIMON PROPERTY GROUP INC  | アメリカ    | 2.87% |
| 4  | GLP 投資法人          | 4.63% | DIGITAL REALTY TRUST INC  | アメリカ    | 2.87% |
| 5  | 日本リートールファンド投資法人   | 4.61% | PUBLIC STORAGE            | アメリカ    | 2.83% |
| 6  | 日本プロロジスリート投資法人    | 4.49% | WELLTOWER INC             | アメリカ    | 2.24% |
| 7  | オリックス不動産投資法人      | 3.93% | AVALONBAY COMMUNITIES INC | アメリカ    | 1.92% |
| 8  | 大和ハウスリート投資法人      | 3.60% | EQUITY RESIDENTIAL        | アメリカ    | 1.74% |
| 9  | ユナイテッド・アーバン投資法人   | 3.46% | GOODMAN GROUP             | オーストラリア | 1.69% |
| 10 | 日本プライムリアルティ投資法人   | 2.78% | REALTY INCOME CORP        | アメリカ    | 1.65% |

|    | 国内短期金融資産                 |        |            |        |
|----|--------------------------|--------|------------|--------|
|    | しんきん短期国内債券マザーファンド        |        |            |        |
|    | 銘柄名                      | 利率     | 満期日        | 投資比率   |
| 1  | 第102回共同発行市場公募地方債         | 1.030% | 2021/09/24 | 10.49% |
| 2  | 第15回政府保証地方公共団体金融機構債券（6年） | 0.167% | 2021/03/19 | 9.93%  |
| 3  | 第105回共同発行市場公募地方債         | 1.070% | 2021/12/24 | 8.76%  |
| 4  | 第103回共同発行市場公募地方債         | 1.000% | 2021/10/25 | 8.58%  |
| 5  | 第96回共同発行市場公募地方債          | 1.290% | 2021/03/25 | 5.53%  |
| 6  | 第211回政府保証預金保険機構債         | 0.100% | 2021/10/19 | 2.86%  |
| 7  | 第695回東京都公募公債             | 1.200% | 2021/03/19 | 2.61%  |
| 8  | 第16回政府保証地方公共団体金融機構債券     | 0.150% | 2021/05/28 | 2.48%  |
| 9  | 第106回共同発行市場公募地方債         | 0.970% | 2022/01/25 | 2.13%  |
| 10 | 第694回東京都公募公債             | 1.350% | 2021/03/19 | 2.05%  |

## 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、取得申込みの受付けを中止することができます。取得申込みの受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あらかじ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＞<https://www.skam.co.jp>

### 2【換金（解約）手続等】

- (1) 受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行を請求することにより換金することができます。

- (2) 各営業日の午後3時までに受け付けた換金（解約）の申込みを、当日の申込受付分として取り扱います。この時刻を過ぎて行われる申込みは、翌営業日以降の取扱いとなります。
- (3) ニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの金融商品取引所の休業日またはニューヨーク、ロンドンもしくはフランクフルトの銀行が休業日の場合は、受益権の換金（解約）の申込みを受け付けません。
- (4) 受益者は、自己に帰属する受益権につき、1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。受益者が一部解約の実行を請求するときは、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。委託会社は、一部解約の実行の請求を受けた場合には、この信託契約の一部を解約します。
- (5) 解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額から当該基準価額の0.3%を信託財産留保額として控除した価額とします。
- (6) 解約時の課税に関しては、前記「ファンド情報 第1 ファンドの状況」の「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご覧ください。
- (7) 一部解約金に係る収益調整金（注）は、原則として、受益者ごとの信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。
- (8) 委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、(5)の規定に準じて算定した価額とします。
- (9) 解約代金の支払いは、原則として、上記解約請求日から起算して5営業日目から販売会社の営業所等で支払われます。
- (10) 受託会社は、一部解約代金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払い込みます。受託会社は、委託会社に一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。
- (11) 換金の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、振替法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の計算方法

- ・基準価額は、委託会社によって毎営業日算出されます。
- ・基準価額とは、投資信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

- ・基準価額は、委託会社および販売会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として日本経済新聞朝刊に掲載されます。

#### ファンドの主要な投資対象資産の評価方法

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は2028年2月14日までとします。ただし、後記「(5)その他」の「ファンドの繰上償還条項」により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めたときは、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】

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

各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、約款に定める信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### ファンドの繰上償還条項

- 1) 委託会社は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、信託契約の一部を解約することにより、受益権の総口数が3億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 2) 委託会社は、前項の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および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信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- 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) 2)から4)までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面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。
- 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) 受託会社がその任務を辞任する場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この約款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します。
- 2) 委託会社は、前項の事項（前項の変更事項にあっては、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っては、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、書面決議の日および重大な約款の変更等の内容ならびに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) 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っても、当該併合に係る一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

#### 販売会社との契約の更改等

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

#### 投資顧問会社との契約更改等

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

委託会社が受益者に対して行う公告は、日本経済新聞に掲載されます。

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

### （1）収益分配金に対する請求権

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

販売会社は、受益者が自己に帰属する受益権について、あらかじめ収益分配金の再投資に係る受益権の取得申込みを中止することを申し出た場合には、当該受益権に帰属する収益分配金を当該計算期間終了のつど受益者に支払います。

受益者が収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

## （２） 償還金に対する請求権

受益者は、ファンドに係る償還金を持分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了日後１か月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して５営業日目まで)から信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（信託終了日以前において一部解約が行われた受益権に係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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対し委託会社がこの信託の償還をするのと引換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、振替法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録を行います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。

受益者が償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

## （３） 換金（解約）請求権

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

## （４） 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（2020年2月15日から2021年2月15日まで）の財務諸表について、P w C 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

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

|                 | 前期<br>(2020年2月14日現在) | 当期<br>(2021年2月15日現在) |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| <b>資産の部</b>     |                      |                      |
| 流動資産            |                      |                      |
| 金銭信託            | 254,456,256          | -                    |
| コール・ローン         | 249,987,090          | 467,434,551          |
| 親投資信託受益証券       | 19,253,607,157       | 15,551,815,642       |
| 流動資産合計          | 19,758,050,503       | 16,019,250,193       |
| 資産合計            | 19,758,050,503       | 16,019,250,193       |
| <b>負債の部</b>     |                      |                      |
| 流動負債            |                      |                      |
| 未払解約金           | 33,285,831           | 57,753,387           |
| 未払受託者報酬         | 5,744,504            | 4,609,670            |
| 未払委託者報酬         | 114,890,003          | 92,193,394           |
| 未払利息            | 732                  | 1,193                |
| その他未払費用         | 4,227                | 882                  |
| 流動負債合計          | 153,925,297          | 154,558,526          |
| 負債合計            | 153,925,297          | 154,558,526          |
| <b>純資産の部</b>    |                      |                      |
| 元本等             |                      |                      |
| 元本              | 1, 2 17,024,251,179  | 1, 2 14,346,869,864  |
| 剰余金             |                      |                      |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,579,874,027        | 1,517,821,803        |
| （分配準備積立金）       | 263,721,192          | 221,607,146          |
| 元本等合計           | 19,604,125,206       | 15,864,691,667       |
| 純資産合計           | 19,604,125,206       | 15,864,691,667       |
| 負債純資産合計         | 19,758,050,503       | 16,019,250,193       |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 前期<br>(自 2019年 2月15日<br>至 2020年 2月14日) | 当期<br>(自 2020年 2月15日<br>至 2021年 2月15日) |
|-------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                        |                                        |
| 有価証券売買等損益                                 | 239,186,753                            | 603,630,267                            |
| 営業収益合計                                    | 239,186,753                            | 603,630,267                            |
| 営業費用                                      |                                        |                                        |
| 支払利息                                      | 325,318                                | 312,186                                |
| 受託者報酬                                     | 11,792,260                             | 9,542,079                              |
| 委託者報酬                                     | 1 235,845,055                          | 1 190,841,523                          |
| その他費用                                     | 74,997                                 | 129,020                                |
| 営業費用合計                                    | 248,037,630                            | 200,824,808                            |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 8,850,877                              | 804,455,075                            |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 8,850,877                              | 804,455,075                            |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 8,850,877                              | 804,455,075                            |
| 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（ ） | 23,014,417                             | 169,373,297                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 3,054,849,490                          | 2,579,874,027                          |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 210,779,501                            | 62,907,305                             |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 210,779,501                            | 62,907,305                             |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 699,918,504                            | 489,877,751                            |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 699,918,504                            | 489,877,751                            |
| 分配金                                       | 2 -                                    | 2 -                                    |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 2,579,874,027                          | 1,517,821,803                          |

## (3)【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         | 親投資信託受益証券<br>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。              |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 計算期間の取扱い<br>当計算期間は、当期末が休日のため、2020年2月15日から2021年2月15日までとなっております。 |

## (貸借対照表に関する注記)

| 区分                                  | 前期<br>(2020年2月14日現在)                                                                   | 当期<br>(2021年2月15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<br>20,295,124,480円<br>期中追加設定元本額<br>1,436,508,682円<br>期中一部解約元本額<br>4,707,381,983円 | 期首元本額<br>17,024,251,179円<br>期中追加設定元本額<br>630,137,428円<br>期中一部解約元本額<br>3,307,518,743円 |
| 2 計算期間末日における受益権の総数                  | 17,024,251,179口                                                                        | 14,346,869,864口                                                                      |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 前期<br>(自 2019年2月15日<br>至 2020年2月14日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 当期<br>(自 2020年2月15日<br>至 2021年2月15日)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。<br/>「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。</p> <p>2 分配金の計算過程</p> <p>A 費用控除後の配当等収益額 49,208,470円</p> <p>B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円</p> <p>C 収益調整金額 2,316,152,835円</p> <p>D 分配準備積立金額 214,512,722円</p> <p>E 当ファンドの分配対象収益額 2,579,874,027円</p> <p>F 当ファンドの期末残存口数 17,024,251,179口</p> <p>G 10,000口当たり収益分配対象額 1,515円</p> <p>H 10,000口当たり分配金額 0円</p> <p>I 収益分配金金額 0円</p> | <p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>同左</p> <p>2 分配金の計算過程</p> <p>A 費用控除後の配当等収益額 0円</p> <p>B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円</p> <p>C 収益調整金額 1,582,115,463円</p> <p>D 分配準備積立金額 221,607,146円</p> <p>E 当ファンドの分配対象収益額 1,803,722,609円</p> <p>F 当ファンドの期末残存口数 14,346,869,864口</p> <p>G 10,000口当たり収益分配対象額 1,257円</p> <p>H 10,000口当たり分配金額 0円</p> <p>I 収益分配金金額 0円</p> |

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

| 区分                      | 前期<br>(自 2019年 2月15日<br>至 2020年 2月14日)                                                                                                                                                                         | 当期<br>(自 2020年 2月15日<br>至 2021年 2月15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。 | 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。運用リスク管理状況は、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                  | 前期<br>(2020年 2月14日現在)                                                                                                                                                                              | 当期<br>(2021年 2月15日現在)                                                                  |
|---------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                | 同左                                                                                     |
| 2．時価の算定方法           | <p>(1)有価証券<br/>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1)有価証券<br/>同左</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>同左</p> |

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

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|           | 前期<br>(2020年2月14日現在) | 当期<br>(2021年2月15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 | 403,726,510円         | 280,447,101円         |
| 合計        | 403,726,510円         | 280,447,101円         |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

| 前期<br>(2020年2月14日現在) | 当期<br>(2021年2月15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<br>(自 2019年2月15日<br>至 2020年2月14日) | 当期<br>(自 2020年2月15日<br>至 2021年2月15日) |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 該当事項はありません。                          | 同左                                   |

## （1口当たり情報）

| 前期<br>(2020年2月14日現在)                      | 当期<br>(2021年2月15日現在)                      |
|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 1口当たり純資産額 1.1515円<br>(1万口当たり純資産額 11,515円) | 1口当たり純資産額 1.1058円<br>(1万口当たり純資産額 11,058円) |

## (4)【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

| 種類           | 銘柄                   | 券面総額(円)        | 評価額(円)         | 備考 |
|--------------|----------------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券    | しんきん好配当利回り株マザーファンド   | 345,453,598    | 787,668,748    |    |
| 親投資信託受益証券    | しんきんJリートマザーファンド      | 314,421,004    | 800,861,739    |    |
| 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   | 353,540,427    | 601,301,558    |    |
| 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   | 353,023,343    | 601,904,799    |    |
| 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 | 305,983,193    | 712,267,676    |    |
| 親投資信託受益証券    | しんきん国内債券マザーファンド      | 8,418,930,450  | 11,170,236,921 |    |
| 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   | 222,449,725    | 305,823,881    |    |
| 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  | 328,818,910    | 571,750,320    |    |
| 親投資信託受益証券 合計 |                      | 10,642,620,650 | 15,551,815,642 |    |
| 合計           |                      | 10,642,620,650 | 15,551,815,642 |    |

## 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」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」、「しんきん高格付外国債券マザーファンド」、「しんきんJリートマザーファンド」及び「しんきんグローバルリートマザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、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          |          | 2021年２月15日現在   |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| コール・ローン     |          | 84,849,185     |
| 株式          |          | 29,839,145,640 |
| 未収入金        |          | 104,845,092    |
| 未収配当金       |          | 88,681,600     |
| 流動資産合計      |          | 30,117,521,517 |
| 資産合計        |          | 30,117,521,517 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払解約金       |          | 76,000,000     |
| 未払利息        |          | 216            |
| その他未払費用     |          | 200            |
| 流動負債合計      |          | 76,000,416     |
| 負債合計        |          | 76,000,416     |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 13,175,781,287 |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 16,865,739,814 |
| 元本等合計       |          | 30,041,521,101 |
| 純資産合計       |          | 30,041,521,101 |
| 負債純資産合計     |          | 30,117,521,517 |

## ( 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<br>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                                  | 2021年 2 月15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<br>14,006,279,717円<br>期中追加設定元本額<br>4,733,544,732円<br>期中一部解約元本額<br>5,564,043,162円                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 元本の内訳                               | しんきん3資産ファンド（毎月決算型）<br>9,024,004,456円<br>しんきん好配当利回り株ファンド（3ヵ月決算型）<br>1,554,393,661円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）<br>1,162,076,005円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>345,453,598円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>608,951,319円<br>しんきん3資産ファンド（1年決算型）<br>186,651,007円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）<br>58,775,562円<br>しんきん好配当利回り株スペシャル（適格機関投資家限定）<br>235,475,679円<br>合計 13,175,781,287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 | 13,175,781,287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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2 月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|    | 2021年 2 月15日現在  |
|----|-----------------|
| 種類 | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 株式 | 6,437,122,659円  |
| 合計 | 6,437,122,659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）

|                |
|----------------|
| 2021年 2 月15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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15日 |
| 該当事項はありません。                      |

## （ 1 口当たり情報）

|                                              |
|----------------------------------------------|
| 2021年 2 月15日現在                               |
| 1 口当たり純資産額 2.2801円<br>( 1 万口当たり純資産額 22,801円) |

## （ 3 ）附属明細表

## 第 1 有価証券明細表

## 株式

| 銘柄                | 株式数<br>( 株 ) | 評価額       |             | 備考 |
|-------------------|--------------|-----------|-------------|----|
|                   |              | 単価 ( 円 )  | 金額 ( 円 )    |    |
| ホクト               | 150,700      | 2,149.00  | 323,854,300 |    |
| 大林組               | 334,200      | 943.00    | 315,150,600 |    |
| 大東建託              | 28,900       | 11,800.00 | 341,020,000 |    |
| 積水ハウス             | 154,000      | 2,140.00  | 329,560,000 |    |
| 麒麟ホールディングス        | 135,000      | 2,211.00  | 298,485,000 |    |
| 日本たばこ産業           | 146,000      | 1,951.00  | 284,846,000 |    |
| 帝人                | 165,500      | 1,892.00  | 313,126,000 |    |
| クラレ               | 281,900      | 1,234.00  | 347,864,600 |    |
| 三菱ケミカルホールディングス    | 476,900      | 741.80    | 353,764,420 |    |
| 三洋化成工業            | 59,200       | 5,390.00  | 319,088,000 |    |
| 太陽ホールディングス        | 50,700       | 6,000.00  | 304,200,000 |    |
| マンダム              | 188,900      | 1,789.00  | 337,942,100 |    |
| 日東電工              | 34,900       | 10,020.00 | 349,698,000 |    |
| 武田薬品工業            | 83,400       | 3,715.00  | 309,831,000 |    |
| アステラス製薬           | 196,100      | 1,784.50  | 349,940,450 |    |
| 大塚ホールディングス        | 72,500       | 4,530.00  | 328,425,000 |    |
| 出光興産              | 132,800      | 2,741.00  | 364,004,800 |    |
| E N E O Sホールディングス | 775,600      | 454.10    | 352,199,960 |    |
| 横浜ゴム              | 190,700      | 1,822.00  | 347,455,400 |    |
| ブリヂストン            | 82,400       | 4,396.00  | 362,230,400 |    |
| A G C             | 86,000       | 3,705.00  | 318,630,000 |    |
| 丸一鋼管              | 137,600      | 2,505.00  | 344,688,000 |    |
| 三井金属鉱業            | 81,800       | 3,765.00  | 307,977,000 |    |
| 住友電気工業            | 221,500      | 1,601.50  | 354,732,250 |    |

|               |         |           |             |  |
|---------------|---------|-----------|-------------|--|
| 三和ホールディングス    | 245,600 | 1,355.00  | 332,788,000 |  |
| L I X I L     | 121,600 | 2,977.00  | 362,003,200 |  |
| アマダ           | 276,100 | 1,310.00  | 361,691,000 |  |
| ナブテスコ         | 66,900  | 5,020.00  | 335,838,000 |  |
| 小松製作所         | 109,700 | 3,262.00  | 357,841,400 |  |
| S A N K Y O   | 115,500 | 2,957.00  | 341,533,500 |  |
| マックス          | 219,400 | 1,636.00  | 358,938,400 |  |
| 日本精工          | 341,700 | 1,044.00  | 356,734,800 |  |
| 三菱重工業         | 99,400  | 3,043.00  | 302,474,200 |  |
| スター精密         | 204,900 | 1,623.00  | 332,552,700 |  |
| 日清紡ホールディングス   | 409,300 | 819.00    | 335,216,700 |  |
| コニカミノルタ       | 639,200 | 572.00    | 365,622,400 |  |
| 日立製作所         | 72,100  | 4,846.00  | 349,396,600 |  |
| 三菱電機          | 196,800 | 1,710.00  | 336,528,000 |  |
| マブチモーター       | 67,100  | 5,400.00  | 362,340,000 |  |
| I D E C       | 167,300 | 1,831.00  | 306,326,300 |  |
| パナソニック        | 243,300 | 1,498.00  | 364,463,400 |  |
| カシオ計算機        | 163,600 | 1,996.00  | 326,545,600 |  |
| キヤノン          | 148,600 | 2,364.50  | 351,364,700 |  |
| 東京エレクトロン      | 7,600   | 43,560.00 | 331,056,000 |  |
| デンソー          | 52,700  | 6,934.00  | 365,421,800 |  |
| トヨタ自動車        | 42,100  | 8,456.00  | 355,997,600 |  |
| アイシン精機        | 98,500  | 3,675.00  | 361,987,500 |  |
| 本田技研工業        | 107,400 | 3,052.00  | 327,784,800 |  |
| S U B A R U   | 149,600 | 2,126.00  | 318,049,600 |  |
| ニコン           | 399,600 | 905.00    | 361,638,000 |  |
| トッパン・フォームズ    | 288,600 | 1,114.00  | 321,500,400 |  |
| 大日本印刷         | 158,600 | 1,958.00  | 310,538,800 |  |
| 中部電力          | 247,400 | 1,328.50  | 328,670,900 |  |
| 中国電力          | 242,300 | 1,300.00  | 314,990,000 |  |
| 日本通運          | 44,200  | 7,700.00  | 340,340,000 |  |
| 九州旅客鉄道        | 136,200 | 2,632.00  | 358,478,400 |  |
| 住友倉庫          | 225,800 | 1,436.00  | 324,248,800 |  |
| トレンドマイクロ      | 54,900  | 6,090.00  | 334,341,000 |  |
| 日本テレビホールディングス | 252,500 | 1,393.00  | 351,732,500 |  |
| 日本電信電話        | 119,800 | 2,850.00  | 341,430,000 |  |
| ソフトバンク        | 244,600 | 1,435.00  | 351,001,000 |  |
| S C S K       | 50,300  | 6,720.00  | 338,016,000 |  |
| T K C         | 43,900  | 6,890.00  | 302,471,000 |  |
| 伊藤忠商事         | 105,600 | 3,140.00  | 331,584,000 |  |
| 三井物産          | 165,500 | 2,057.50  | 340,516,250 |  |
| 住友商事          | 230,300 | 1,501.00  | 345,680,300 |  |
| サンゲツ          | 209,300 | 1,636.00  | 342,414,800 |  |

|                           |            |          |                |  |
|---------------------------|------------|----------|----------------|--|
| リョーサン                     | 151,400    | 2,335.00 | 353,519,000    |  |
| 因幡電機産業                    | 128,000    | 2,550.00 | 326,400,000    |  |
| ローソン                      | 65,700     | 5,300.00 | 348,210,000    |  |
| セブン＆アイ・ホールディングス           | 81,000     | 4,225.00 | 342,225,000    |  |
| ヤマダホールディングス               | 596,400    | 545.00   | 325,038,000    |  |
| あおぞら銀行                    | 162,200    | 2,265.00 | 367,383,000    |  |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ         | 660,600    | 541.50   | 357,714,900    |  |
| りそなホールディングス               | 841,600    | 431.40   | 363,066,240    |  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス         | 98,000     | 3,536.00 | 346,528,000    |  |
| 三井住友フィナンシャルグループ           | 93,400     | 3,688.00 | 344,459,200    |  |
| みずほフィナンシャルグループ            | 230,300    | 1,552.50 | 357,540,750    |  |
| 大和証券グループ本社                | 639,300    | 539.00   | 344,582,700    |  |
| 野村ホールディングス                | 561,000    | 647.90   | 363,471,900    |  |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス | 99,900     | 3,199.00 | 319,580,100    |  |
| 東京海上ホールディングス              | 58,700     | 5,560.00 | 326,372,000    |  |
| Ｔ＆Ｄホールディングス               | 239,400    | 1,443.00 | 345,454,200    |  |
| 野村不動産ホールディングス             | 145,200    | 2,499.00 | 362,854,800    |  |
| Ｈ．Ｕ．グループホールディングス          | 108,900    | 3,330.00 | 362,637,000    |  |
| ユー・エス・エス                  | 141,900    | 2,069.00 | 293,591,100    |  |
| 日本郵政                      | 380,400    | 905.30   | 344,376,120    |  |
| メイテック                     | 62,000     | 5,570.00 | 345,340,000    |  |
| 合計                        | 17,397,900 |          | 29,839,145,640 |  |

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          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 預金          |          | 117,454,679    |
| コール・ローン     |          | 179,002,120    |
| 株式          |          | 23,876,835,359 |
| 派生商品評価勘定    |          | 20,757         |
| 未収入金        |          | 16,258,777     |
| 未収配当金       |          | 23,170,168     |
| 流動資産合計      |          | 24,212,741,860 |
| 資産合計        |          | 24,212,741,860 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 派生商品評価勘定    |          | 49,758         |
| 未払解約金       |          | 20,000,000     |
| 未払利息        |          | 457            |
| その他未払費用     |          | 178            |
| 流動負債合計      |          | 20,050,393     |
| 負債合計        |          | 20,050,393     |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 10,393,090,430 |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 13,799,601,037 |
| 元本等合計       |          | 24,192,691,467 |
| 純資産合計       |          | 24,192,691,467 |
| 負債純資産合計     |          | 24,212,741,860 |

## ( 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<br>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<br>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<br>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                                  | 2021年 2月15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<br>9,933,297,248円<br>期中追加設定元本額<br>4,219,885,879円<br>期中一部解約元本額<br>3,760,092,697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）<br>8,105,602,246円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）<br>1,138,751,172円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>305,983,193円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>576,216,985円<br>しんきん世界好配当利回り株ファンド（1年決算型）<br>209,313,543円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）<br>57,223,291円<br>合計 10,393,090,430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 | 10,393,090,430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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2 月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>（デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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。また、デリバティブ取引に関する契約額等はあくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。          |

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

|    | 2021年2月15日現在    |
|----|-----------------|
| 種類 | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 株式 | 3,803,617,558円  |
| 合計 | 3,803,617,558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）

## 取引の時価等に関する事項

## （通貨関連）

| 2021年2月15日現在 |           |            |       |            |         |
|--------------|-----------|------------|-------|------------|---------|
| 区分           | 種類        | 契約額（円）     | うち1年超 | 時価（円）      | 評価損益（円） |
| 市場取引以外の取引    | 為替予約取引    |            |       |            |         |
|              | 買建        | 16,234,900 | —     | 16,216,705 | 18,195  |
|              | 米ドル       | 16,234,900 | —     | 16,216,705 | 18,195  |
|              | 売建        | 16,234,900 | —     | 16,245,706 | 10,806  |
|              | ノルウェークローネ | 16,234,900 | —     | 16,245,706 | 10,806  |
| 合計           |           | 32,469,800 | —     | 32,462,411 | 29,001  |

## （注）時価の算定方法

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

|                              |
|------------------------------|
| 自 2020年2月15日<br>至 2021年2月15日 |
| 該当事項はありません。                  |

## （１口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年２月15日現在         |
| １口当たり純資産額 ２.3278円    |
| （１万口当たり純資産額 23,278円） |

## （３）附属明細表

## 第１ 有価証券明細表

## 株式

| 通貨     | 銘柄                           | 株式数(株)    | 評価額    |                                  | 備考 |
|--------|------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|----|
|        |                              |           | 単価     | 金額                               |    |
| 米ドル    | HOLLYFRONTIER CORP           | 128,376   | 31.75  | 4,075,938.00                     |    |
| 米ドル    | OMNICOM GROUP                | 78,973    | 66.25  | 5,231,961.25                     |    |
| 米ドル    | MOLSON COORS BREWING CO -B   | 98,066    | 44.01  | 4,315,884.66                     |    |
| 米ドル    | VIATRIS INC                  | 18,210    | 18.24  | 332,150.40                       |    |
| 米ドル    | PFIZER INC                   | 146,766   | 34.72  | 5,095,715.52                     |    |
| 米ドル    | CITIGROUP INC                | 63,038    | 63.63  | 4,011,107.94                     |    |
| 米ドル    | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 100,812   | 41.40  | 4,173,616.80                     |    |
| 米ドル    | INTL BUSINESS MACHINES CORP  | 68,807    | 120.80 | 8,311,885.60                     |    |
| 米ドル    | WESTERN UNION CO             | 242,924   | 23.99  | 5,827,746.76                     |    |
| 米ドル    | CISCO SYSTEMS INC            | 83,324    | 47.29  | 3,940,391.96                     |    |
| 米ドル    | HP INC                       | 267,487   | 27.49  | 7,353,217.63                     |    |
| 米ドル    | XEROX HOLDINGS CORPORATION   | 99,492    | 23.71  | 2,358,955.32                     |    |
| 米ドル    | INTEL CORP                   | 129,011   | 61.81  | 7,974,169.91                     |    |
| 米ドル 小計 |                              | 1,525,286 |        | 63,002,741.75<br>(6,622,848,212) |    |
| ユーロ    | ENI SPA                      | 599,180   | 8.87   | 5,320,119.22                     |    |
| ユーロ    | REPSOL SA                    | 669,533   | 8.87   | 5,941,435.84                     |    |
| ユーロ    | SOCIETE BIC SA               | 83,357    | 47.40  | 3,951,121.80                     |    |
| ユーロ    | CONTINENTAL AG               | 32,825    | 122.65 | 4,025,986.25                     |    |
| ユーロ    | Schaeffler AG Preference NPV | 399,008   | 6.94   | 2,771,110.56                     |    |
| ユーロ    | PUBLICIS GROUPE SA           | 99,207    | 47.00  | 4,662,729.00                     |    |
| ユーロ    | RTL GROUP S.A.               | 120,014   | 48.78  | 5,854,282.92                     |    |
| ユーロ    | TELEVISION FRANCAISE (T.F.1) | 435,058   | 7.25   | 3,154,170.50                     |    |
| ユーロ    | BAYER AG                     | 94,362    | 53.95  | 5,090,829.90                     |    |
| ユーロ    | SANOFI                       | 61,063    | 78.16  | 4,772,684.08                     |    |
| ユーロ    | BNP PARIBAS                  | 60,422    | 46.48  | 2,808,414.56                     |    |
| ユーロ    | ING GROEP NV                 | 294,109   | 8.34   | 2,455,516.04                     |    |
| ユーロ    | INTESA SANPAOLOA             | 2,006,157 | 2.09   | 4,204,905.07                     |    |
| ユーロ    | UNICREDIT SPA                | 262,771   | 8.39   | 2,206,225.31                     |    |
| ユーロ    | AGEAS                        | 108,707   | 45.43  | 4,938,559.01                     |    |
| ユーロ 小計 |                              | 5,325,773 |        | 62,158,090.06<br>(7,921,426,997) |    |

|              |                              |            |        |                                    |  |
|--------------|------------------------------|------------|--------|------------------------------------|--|
| 英ポンド         | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS  | 245,473    | 13.00  | 3,192,621.83                       |  |
| 英ポンド         | ANGLO AMERICAN PLC           | 155,072    | 26.63  | 4,129,567.36                       |  |
| 英ポンド         | PEARSON PLC                  | 589,305    | 7.63   | 4,498,754.37                       |  |
| 英ポンド         | WPP PLC                      | 393,283    | 8.25   | 3,245,371.31                       |  |
| 英ポンド         | TESCO PLC                    | 1,941,527  | 2.40   | 4,671,313.96                       |  |
| 英ポンド         | WM MORRISON SUPERMARKETS     | 3,014,908  | 1.71   | 5,155,492.68                       |  |
| 英ポンド         | IMPERIAL BRANDS PLC          | 348,371    | 14.93  | 5,202,920.88                       |  |
| 英ポンド         | GLAXOSMITHKLINE PLC          | 310,145    | 12.78  | 3,963,653.10                       |  |
| 英ポンド         | BARCLAYS PLC                 | 1,584,478  | 1.45   | 2,311,753.40                       |  |
| 英ポンド         | HSBC HOLDINGS PLC            | 556,926    | 4.01   | 2,237,728.66                       |  |
| 英ポンド         | NATWEST GROUP PLC            | 2,952,750  | 1.71   | 5,059,537.12                       |  |
| 英ポンド         | STANDARD CHARTERED PLC       | 940,397    | 4.62   | 4,353,097.71                       |  |
| 英ポンド         | CENTRICA PLC                 | 10,083,749 | 0.53   | 5,372,621.46                       |  |
| 英ポンド 小計      |                              | 23,116,384 |        | 53,394,433.84<br>(7,787,578,175)   |  |
| スイスフラン       | SWATCH GROUP AG              | 12,776     | 265.00 | 3,385,640.00                       |  |
| スイスフラン 小計    |                              | 12,776     |        | 3,385,640.00<br>(398,997,674)      |  |
| ノルウェークローネ    | TGS NOPEC GEOPHYSICAL CO ASA | 31,113     | 132.35 | 4,117,805.55                       |  |
| ノルウェークローネ 小計 |                              | 31,113     |        | 4,117,805.55<br>(51,225,501)       |  |
| オーストラリアドル    | SOUTH32 LTD                  | 2,863,954  | 2.59   | 7,417,640.86                       |  |
| オーストラリアドル 小計 |                              | 2,863,954  |        | 7,417,640.86<br>(605,279,494)      |  |
| シンガポールドル     | GENTING SINGAPORE LTD        | 7,171,900  | 0.86   | 6,167,834.00                       |  |
| シンガポールドル 小計  |                              | 7,171,900  |        | 6,167,834.00<br>(489,479,306)      |  |
| 合計           |                              | 40,047,186 |        | 23,876,835,359<br>(23,876,835,359) |  |

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13銘柄  | 100.0%   | 27.7%      |
| ユーロ       | 株式15銘柄  | 100.0%   | 33.2%      |
| 英ポンド      | 株式13銘柄  | 100.0%   | 32.6%      |
| スイスフラン    | 株式 1 銘柄 | 100.0%   | 1.7%       |
| ノルウェークローネ | 株式 1 銘柄 | 100.0%   | 0.2%       |
| オーストラリアドル | 株式 1 銘柄 | 100.0%   | 2.5%       |
| シンガポールドル  | 株式 1 銘柄 | 100.0%   | 2.1%       |

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。

## 「しんきん国内債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

## しんきん国内債券マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| コール・ローン     |          | 130,039,256    |
| 国債証券        |          | 12,206,494,900 |
| 地方債証券       |          | 1,410,104,000  |
| 特殊債券        |          | 201,302,000    |
| 社債券         |          | 1,103,029,000  |
| 未収利息        |          | 23,743,055     |
| 前払費用        |          | 4,577,932      |
| 流動資産合計      |          | 15,079,290,143 |
| 資産合計        |          | 15,079,290,143 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 332            |
| その他未払費用     |          | 232            |
| 流動負債合計      |          | 564            |
| 負債合計        |          | 564            |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 11,365,150,678 |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 3,714,138,901  |
| 元本等合計       |          | 15,079,289,579 |
| 純資産合計       |          | 15,079,289,579 |
| 負債純資産合計     |          | 15,079,290,143 |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

|                 |                                                                                                                                                             |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 2 月15日現在                                                                                                                                                                                          |
|-------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | <p>期首元本額 14,332,401,792円</p> <p>期中追加設定元本額 35,171,199,200円</p> <p>期中一部解約元本額 38,138,450,314円</p>                                                                                                          |
| 元本の内訳                               | <p>しんきんグローバル6 資産ファンド（毎月決算型） 1,882,838,760円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 8,418,930,450円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 964,946,976円</p> <p>しんきんグローバル6 資産ファンド（1年決算型） 98,434,492円</p> <p>合計 11,365,150,678円</p> |
| 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 | 11,365,150,678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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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 | 2021年 2 月15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                 | <p>(1) 有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|       |                 |
|-------|-----------------|
|       | 2021年2月15日現在    |
| 種類    | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 国債証券  | 92,879,900円     |
| 地方債証券 | 3,023,000円      |
| 特殊債券  | 296,000円        |
| 社債券   | 1,909,000円      |
| 合計    | 94,289,900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）

|              |
|--------------|
| 2021年2月15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）

|                                      |
|--------------------------------------|
| <p>自 2020年2月15日<br/>至 2021年2月15日</p> |
| 該当事項はありません。                          |

## （１口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年２月15日現在         |
| １口当たり純資産額 1.3268円    |
| （１万口当たり純資産額 13,268円） |

## （３）附属明細表

## 第１ 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類   | 銘柄             | 券面総額（円）     | 評価額（円）      | 備考 |
|------|----------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 第４１３回利付国債（２年）  | 400,000,000 | 401,184,000 |    |
| 国債証券 | 第４１８回利付国債（２年）  | 350,000,000 | 351,435,000 |    |
| 国債証券 | 第４１９回利付国債（２年）  | 250,000,000 | 251,052,500 |    |
| 国債証券 | 第１３２回利付国債（５年）  | 400,000,000 | 401,232,000 |    |
| 国債証券 | 第１３７回利付国債（５年）  | 400,000,000 | 402,340,000 |    |
| 国債証券 | 第１３８回利付国債（５年）  | 350,000,000 | 352,345,000 |    |
| 国債証券 | 第１４１回利付国債（５年）  | 350,000,000 | 352,775,500 |    |
| 国債証券 | 第１４２回利付国債（５年）  | 350,000,000 | 352,901,500 |    |
| 国債証券 | 第１４３回利付国債（５年）  | 350,000,000 | 353,090,500 |    |
| 国債証券 | 第１４４回利付国債（５年）  | 400,000,000 | 403,660,000 |    |
| 国債証券 | 第１４５回利付国債（５年）  | 350,000,000 | 353,391,500 |    |
| 国債証券 | 第３３３回利付国債（１０年） | 350,000,000 | 357,864,500 |    |
| 国債証券 | 第３４６回利付国債（１０年） | 500,000,000 | 505,350,000 |    |
| 国債証券 | 第３５４回利付国債（１０年） | 300,000,000 | 302,547,000 |    |
| 国債証券 | 第３５５回利付国債（１０年） | 400,000,000 | 403,164,000 |    |
| 国債証券 | 第３５７回利付国債（１０年） | 400,000,000 | 402,468,000 |    |
| 国債証券 | 第３６０回利付国債（１０年） | 400,000,000 | 401,332,000 |    |
| 国債証券 | 第３２回利付国債（３０年）  | 150,000,000 | 200,362,500 |    |
| 国債証券 | 第３４回利付国債（３０年）  | 100,000,000 | 132,728,000 |    |
| 国債証券 | 第３６回利付国債（３０年）  | 100,000,000 | 129,728,000 |    |
| 国債証券 | 第３８回利付国債（３０年）  | 100,000,000 | 126,360,000 |    |
| 国債証券 | 第４２回利付国債（３０年）  | 280,000,000 | 349,543,600 |    |
| 国債証券 | 第４６回利付国債（３０年）  | 100,000,000 | 120,848,000 |    |
| 国債証券 | 第５０回利付国債（３０年）  | 150,000,000 | 157,227,000 |    |
| 国債証券 | 第５４回利付国債（３０年）  | 300,000,000 | 313,533,000 |    |
| 国債証券 | 第５８回利付国債（３０年）  | 300,000,000 | 312,522,000 |    |
| 国債証券 | 第６２回利付国債（３０年）  | 200,000,000 | 192,188,000 |    |
| 国債証券 | 第６６回利付国債（３０年）  | 400,000,000 | 371,896,000 |    |
| 国債証券 | 第１１６回利付国債（２０年） | 150,000,000 | 179,337,000 |    |
| 国債証券 | 第１２５回利付国債（２０年） | 200,000,000 | 242,428,000 |    |
| 国債証券 | 第１４４回利付国債（２０年） | 250,000,000 | 289,552,500 |    |

|          |                                         |                |                |  |
|----------|-----------------------------------------|----------------|----------------|--|
| 国債証券     | 第 1 4 5 回利付国債（ 2 0 年）                   | 250,000,000    | 296,050,000    |  |
| 国債証券     | 第 1 4 6 回利付国債（ 2 0 年）                   | 300,000,000    | 355,926,000    |  |
| 国債証券     | 第 1 4 8 回利付国債（ 2 0 年）                   | 250,000,000    | 291,262,500    |  |
| 国債証券     | 第 1 5 0 回利付国債（ 2 0 年）                   | 250,000,000    | 288,740,000    |  |
| 国債証券     | 第 1 5 2 回利付国債（ 2 0 年）                   | 120,000,000    | 135,604,800    |  |
| 国債証券     | 第 1 6 0 回利付国債（ 2 0 年）                   | 300,000,000    | 316,713,000    |  |
| 国債証券     | 第 1 6 1 回利付国債（ 2 0 年）                   | 350,000,000    | 363,520,500    |  |
| 国債証券     | 第 1 6 8 回利付国債（ 2 0 年）                   | 250,000,000    | 248,740,000    |  |
| 国債証券     | 第 1 7 4 回利付国債（ 2 0 年）                   | 450,000,000    | 443,551,500    |  |
| 国債証券 合計  |                                         | 11,600,000,000 | 12,206,494,900 |  |
| 地方債証券    | 第 8 回東京都公募公債（ 7 年）                      | 100,000,000    | 100,355,000    |  |
| 地方債証券    | 第 7 1 9 回東京都公募公債                        | 100,000,000    | 101,765,000    |  |
| 地方債証券    | 第 7 2 9 回東京都公募公債                        | 100,000,000    | 102,083,000    |  |
| 地方債証券    | 平成 2 9 年度第 1 6 回愛知県公募公債（ 1 0 年）         | 200,000,000    | 202,082,000    |  |
| 地方債証券    | 平成 2 5 年度第 4 回広島県公募公債                   | 100,000,000    | 101,823,000    |  |
| 地方債証券    | 平成 2 8 年度第 3 回埼玉県公募公債                   | 300,000,000    | 300,078,000    |  |
| 地方債証券    | 平成 2 8 年度第 6 回福岡県公募公債                   | 100,000,000    | 100,582,000    |  |
| 地方債証券    | 第 4 9 6 回名古屋市公募公債（ 1 0 年）               | 200,000,000    | 199,946,000    |  |
| 地方債証券    | 平成 2 8 年度第 4 回福井県公募公債                   | 200,000,000    | 201,390,000    |  |
| 地方債証券 合計 |                                         | 1,400,000,000  | 1,410,104,000  |  |
| 特殊債券     | 第 3 2 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券          | 200,000,000    | 201,302,000    |  |
| 特殊債券 合計  |                                         | 200,000,000    | 201,302,000    |  |
| 社債券      | 第 1 3 回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）             | 100,000,000    | 100,146,000    |  |
| 社債券      | 第 6 回ヒューリック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）       | 100,000,000    | 99,909,000     |  |
| 社債券      | 第 3 7 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    | 98,961,000     |  |
| 社債券      | 第 1 4 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    | 100,118,000    |  |
| 社債券      | 第 1 4 回株式会社ブリヂストン無担保社債                  | 100,000,000    | 100,142,000    |  |
| 社債券      | 第 5 3 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    | 100,012,000    |  |
| 社債券      | 第 1 8 回パナソニック株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）     | 100,000,000    | 99,895,000     |  |
| 社債券      | 第 1 5 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    | 99,595,000     |  |
| 社債券      | 第 5 1 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    | 100,137,000    |  |
| 社債券      | 第 1 0 0 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    | 204,114,000    |  |
| 社債券 合計   |                                         | 1,100,000,000  | 1,103,029,000  |  |
| 合計       |                                         | 14,300,000,000 | 14,920,929,900 |  |

## 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          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 預金          |          | 51,661,677     |
| コール・ローン     |          | 54,474,721     |
| 国債証券        |          | 12,231,115,680 |
| 未収利息        |          | 106,968,712    |
| 前払費用        |          | 9,752,774      |
| 流動資産合計      |          | 12,453,973,564 |
| 資産合計        |          | 12,453,973,564 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 139            |
| その他未払費用     |          | 131            |
| 流動負債合計      |          | 270            |
| 負債合計        |          | 270            |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 7,322,270,843  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 5,131,702,451  |
| 元本等合計       |          | 12,453,973,294 |
| 純資産合計       |          | 12,453,973,294 |
| 負債純資産合計     |          | 12,453,973,564 |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 2 月15日現在                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | <p>期首元本額 8,169,968,755円</p> <p>期中追加設定元本額 2,565,738,806円</p> <p>期中一部解約元本額 3,413,436,718円</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 元本の内訳                               | <p>しんきん海外ソブリン債セレクション<br/>欧州ソブリン債ポートフォリオ 167,707,405円</p> <p>しんきん海外ソブリン債セレクション<br/>欧米ソブリン債ポートフォリオ 170,712,890円</p> <p>しんきん 3 資産ファンド（毎月決算型） 5,694,856,418円</p> <p>しんきんグローバル 6 資産ファンド（毎月決算型） 492,281,379円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 353,540,427円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 300,872,571円</p> <p>しんきん 3 資産ファンド（1 年決算型） 116,788,885円</p> <p>しんきんグローバル 6 資産ファンド（1 年決算型） 25,510,868円</p> <p>合計 7,322,270,843円</p> |

|                                     |                |
|-------------------------------------|----------------|
| 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 | 7,322,270,843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 2020年 2月15日<br>至 2021年 2月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|      | 2021年 2 月15日現在  |
|------|-----------------|
| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 国債証券 | 29,992,877円     |
| 合計   | 29,992,877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）

| 2021年 2 月15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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15日 |
| 該当事項はありません。                      |

## （1口当たり情報）

| 2021年 2 月15日現在                            |
|-------------------------------------------|
| 1口当たり純資産額 1.7008円<br>(1万口当たり純資産額 17,008円) |

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式  
該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類   | 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 | 1,059,400.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 0.800 06/22/27 | 1,300,000.00 | 1,394,120.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 0.900 06/22/29 | 1,800,000.00 | 1,964,340.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 1.600 06/22/47 | 1,200,000.00 | 1,508,760.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 2.600 06/22/24 | 400,000.00   | 442,600.00   |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 4.000 03/28/22 | 900,000.00   | 933,660.00   |    |
| 国債証券 | ユーロ | BGB 5.000 03/28/35 | 1,800,000.00 | 3,053,520.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 0.250 02/15/29 | 2,900,000.00 | 3,092,154.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 0.500 02/15/26 | 2,000,000.00 | 2,122,780.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 1.000 08/15/25 | 1,000,000.00 | 1,078,640.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 1.500 02/15/23 | 1,900,000.00 | 1,985,424.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 1.750 02/15/24 | 800,000.00   | 860,664.00   |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 4.000 01/04/37 | 3,400,000.00 | 5,734,542.00 |    |
| 国債証券 | ユーロ | DBR 4.750 07/04/28 | 2,700,000.00 | 3,801,249.00 |    |

|         |     |                       |               |                                    |  |
|---------|-----|-----------------------|---------------|------------------------------------|--|
| 国債証券    | ユーロ | DBR 4.750 07/04/34    | 2,500,000.00  | 4,243,875.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 0.500 05/25/25   | 2,300,000.00  | 2,410,400.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 1.250 05/25/34   | 3,500,000.00  | 4,072,950.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 2.250 05/25/24   | 2,600,000.00  | 2,850,120.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 2.250 10/25/22   | 600,000.00    | 629,886.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 2.500 05/25/30   | 4,000,000.00  | 5,054,400.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 2.750 10/25/27   | 3,300,000.00  | 4,024,185.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 3.250 05/25/45   | 1,900,000.00  | 3,165,780.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 4.000 10/25/38   | 2,700,000.00  | 4,501,440.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 4.250 10/25/23   | 2,700,000.00  | 3,062,475.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | FRTR 5.750 10/25/32   | 500,000.00    | 847,050.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 0.250 07/15/25 | 800,000.00    | 833,040.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 0.250 07/15/29 | 1,400,000.00  | 1,484,560.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 0.500 01/15/40 | 600,000.00    | 660,300.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 0.750 07/15/27 | 800,000.00    | 869,280.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 1.750 07/15/23 | 700,000.00    | 741,965.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | NETHER 2.500 01/15/33 | 1,800,000.00  | 2,412,360.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 0.500 04/20/27   | 1,000,000.00  | 1,065,300.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 0.750 02/20/28   | 400,000.00    | 434,600.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 1.200 10/20/25   | 1,000,000.00  | 1,086,300.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 1.500 02/20/47   | 1,200,000.00  | 1,569,120.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 1.750 10/20/23   | 800,000.00    | 851,920.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 2.400 05/23/34   | 1,100,000.00  | 1,464,650.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | RAGB 3.650 04/20/22   | 200,000.00    | 210,140.00                         |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 1.500 04/30/27   | 1,700,000.00  | 1,882,920.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 1.950 04/30/26   | 3,000,000.00  | 3,356,250.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 1.950 07/30/30   | 4,000,000.00  | 4,706,400.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 2.150 10/31/25   | 1,400,000.00  | 1,568,700.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 3.800 04/30/24   | 1,000,000.00  | 1,139,150.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 4.200 01/31/37   | 1,200,000.00  | 1,871,880.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 4.700 07/30/41   | 1,900,000.00  | 3,313,790.00                       |  |
| 国債証券    | ユーロ | SPGB 5.400 01/31/23   | 500,000.00    | 558,445.00                         |  |
| ユーロ 小計  |     |                       | 76,200,000.00 | 95,975,484.00<br>(12,231,115,680)  |  |
| 国債証券 合計 |     |                       |               | 12,231,115,680<br>(12,231,115,680) |  |
| 合計      |     |                       |               | 12,231,115,680<br>(12,231,115,680) |  |

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46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          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 預金          |          | 28,732,069     |
| コール・ローン     |          | 50,756,861     |
| 国債証券        |          | 10,700,983,603 |
| 特殊債券        |          | 1,569,989,275  |
| 未収利息        |          | 92,174,571     |
| 前払費用        |          | 4,248,781      |
| 流動資産合計      |          | 12,446,885,160 |
| 資産合計        |          | 12,446,885,160 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 129            |
| その他未払費用     |          | 160            |
| 流動負債合計      |          | 289            |
| 負債合計        |          | 289            |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 7,300,298,643  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 5,146,586,228  |
| 元本等合計       |          | 12,446,884,871 |
| 純資産合計       |          | 12,446,884,871 |
| 負債純資産合計     |          | 12,446,885,160 |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 2 月15日現在                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | <p>期首元本額 7,817,926,649円</p> <p>期中追加設定元本額 2,700,734,922円</p> <p>期中一部解約元本額 3,218,362,928円</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 元本の内訳                               | <p>しんきん海外ソブリン債セレクション<br/>米国ソブリン債ポートフォリオ 194,301,242円</p> <p>しんきん海外ソブリン債セレクション<br/>欧米ソブリン債ポートフォリオ 161,437,258円</p> <p>しんきん 3 資産ファンド（毎月決算型） 5,659,991,126円</p> <p>しんきんグローバル 6 資産ファンド（毎月決算型） 489,918,363円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 353,023,343円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 299,972,683円</p> <p>しんきん 3 資産ファンド（1 年決算型） 116,106,784円</p> <p>しんきんグローバル 6 資産ファンド（1 年決算型） 25,547,844円</p> <p>合計 7,300,298,643円</p> |

|                                                 |                |
|-------------------------------------------------|----------------|
| 2 本報告書における開示<br>対象ファンドの計算期<br>間末日における受益権<br>の総数 | 7,300,298,643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 2020年 2月15日<br>至 2021年 2月15日                                                                                                                                                                      |
|-------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．金融商品に対する取組<br>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<br>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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|      | 2021年 2 月15日現在  |
|------|-----------------|
| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 国債証券 | 19,283,770円     |
| 特殊債券 | 623,362円        |
| 合計   | 19,907,132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）

|                |
|----------------|
| 2021年 2 月15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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15日 |
| 該当事項はありません。                      |

## （1口当たり情報）

|                                             |
|---------------------------------------------|
| 2021年 2 月15日現在                              |
| 1 口当たり純資産額 1.7050円<br>(1 万口当たり純資産額 17,050円) |

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類   | 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 | 3,200,000.00 | 3,556,500.00 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 3.125 02/15/42 | 4,500,000.00 | 5,547,304.71 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 3.125 05/15/48 | 2,300,000.00 | 2,871,765.62 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 3.500 02/15/39 | 400,000.00   | 515,718.75   |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 3.625 02/15/44 | 2,200,000.00 | 2,923,937.50 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 4.375 05/15/40 | 2,700,000.00 | 3,883,570.32 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 4.750 02/15/37 | 3,800,000.00 | 5,539,984.39 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 5.250 02/15/29 | 1,100,000.00 | 1,465,492.19 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 6.250 08/15/23 | 1,100,000.00 | 1,268,179.69 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-BOND 6.500 11/15/26 | 1,000,000.00 | 1,332,421.88 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-NOTE 1.375 06/30/23 | 5,300,000.00 | 5,454,445.33 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-NOTE 1.500 02/15/30 | 2,000,000.00 | 2,070,156.26 |    |
| 国債証券 | 米ドル | T-NOTE 1.625 02/15/26 | 300,000.00   | 316,734.37   |    |

|         |     |                       |               |                                    |  |
|---------|-----|-----------------------|---------------|------------------------------------|--|
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 1.625 05/15/26 | 4,200,000.00  | 4,438,218.75                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 1.625 08/15/29 | 3,800,000.00  | 3,984,953.14                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 1.750 05/15/23 | 5,000,000.00  | 5,180,078.15                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.000 02/15/23 | 5,400,000.00  | 5,601,234.40                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.000 08/15/25 | 5,000,000.00  | 5,355,468.75                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.375 03/15/22 | 4,500,000.00  | 4,609,687.50                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.500 08/15/23 | 5,300,000.00  | 5,610,546.87                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.625 01/31/26 | 5,000,000.00  | 5,524,218.75                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.625 02/15/29 | 3,700,000.00  | 4,172,328.12                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.750 02/15/24 | 5,300,000.00  | 5,706,195.33                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.750 11/15/23 | 4,400,000.00  | 4,712,125.00                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 2.875 05/31/25 | 5,500,000.00  | 6,083,945.34                       |  |
| 国債証券    | 米ドル | T-NOTE 3.125 11/15/28 | 3,500,000.00  | 4,072,578.12                       |  |
| 米ドル 小計  |     |                       | 90,500,000.00 | 101,797,789.23<br>(10,700,983,603) |  |
| 国債証券 合計 |     |                       |               | 10,700,983,603<br>(10,700,983,603) |  |
| 特殊債券    | 米ドル | ASIA 1.875 01/24/30   | 5,300,000.00  | 5,587,790.00                       |  |
| 特殊債券    | 米ドル | IADB 2.125 01/15/25   | 2,000,000.00  | 2,132,300.00                       |  |
| 特殊債券    | 米ドル | IBRD 0.750 11/24/27   | 4,500,000.00  | 4,446,900.00                       |  |
| 特殊債券    | 米ドル | IBRD 1.875 10/27/26   | 2,600,000.00  | 2,768,220.00                       |  |
| 米ドル 小計  |     |                       | 14,400,000.00 | 14,935,210.00<br>(1,569,989,275)   |  |
| 特殊債券 合計 |     |                       |               | 1,569,989,275<br>(1,569,989,275)   |  |
| 合計      |     |                       |               | 12,270,972,878<br>(12,270,972,878) |  |

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26銘柄  | 87.2%    | 87.2%      |
|     | 特殊債券 4 銘柄 | 12.8%    | 12.8%      |

## 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          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 預金          |          | 3,646,153      |
| コール・ローン     |          | 9,773,087      |
| 国債証券        |          | 803,495,808    |
| 地方債証券       |          | 824,900,966    |
| 特殊債券        |          | 668,641,971    |
| 未収利息        |          | 15,557,024     |
| 前払費用        |          | 5,072,119      |
| 流動資産合計      |          | 2,331,087,128  |
| 資産合計        |          | 2,331,087,128  |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 24             |
| その他未払費用     |          | 41             |
| 流動負債合計      |          | 65             |
| 負債合計        |          | 65             |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 1,695,625,341  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 635,461,722    |
| 元本等合計       |          | 2,331,087,063  |
| 純資産合計       |          | 2,331,087,063  |
| 負債純資産合計     |          | 2,331,087,128  |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 2 月15日現在                                                                                                                                                                                                                                   |
|-------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中一部解約元本額 | <p>期首元本額 1,800,277,157円</p> <p>期中追加設定元本額 955,987,300円</p> <p>期中一部解約元本額 1,060,639,116円</p>                                                                                                                                                        |
| 元本の内訳                               | <p>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型） 631,224,416円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 222,449,725円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 189,909,165円</p> <p>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 32,030,660円</p> <p>しんきん高格付外国債券スペシャル（適格機関投資家限定） 620,011,375円</p> <p>合計 1,695,625,341円</p> |
| 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 | 1,695,625,341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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2 月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|       | 2021年 2 月15日現在  |
|-------|-----------------|
| 種類    | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 国債証券  | 15,320,159円     |
| 地方債証券 | 3,371,903円      |
| 特殊債券  | 12,357,085円     |
| 合計    | 31,049,147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）

| 2021年 2 月15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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15日 |
|----------------------------------|
| 該当事項はありません。                      |

## （1口当たり情報）

| 2021年 2 月15日現在                            |
|-------------------------------------------|
| 1口当たり純資産額 1.3748円<br>(1万口当たり純資産額 13,748円) |

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類       | 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 | 2,760,000.00  | 2,897,586.00                  |    |
| カナダドル 小計 |               |                    | 2,760,000.00  | 2,897,586.00<br>(240,036,024) |    |
| 国債証券     | 英ポンド          | UKT 1.625 10/22/28 | 480,000.00    | 526,992.00                    |    |
| 国債証券     | 英ポンド          | UKT 4.250 12/07/27 | 660,000.00    | 837,738.00                    |    |
| 英ポンド 小計  |               |                    | 1,140,000.00  | 1,364,730.00<br>(199,045,870) |    |
| 国債証券     | ノルウェー<br>クローネ | NGB 1.500 02/19/26 | 10,660,000.00 | 11,020,308.00                 |    |
| 国債証券     | ノルウェー<br>クローネ | NGB 1.750 02/17/27 | 7,100,000.00  | 7,439,735.00                  |    |
| 国債証券     | ノルウェー<br>クローネ | NGB 1.750 03/13/25 | 10,400,000.00 | 10,833,680.00                 |    |

|              |           |                       |               |                                  |  |
|--------------|-----------|-----------------------|---------------|----------------------------------|--|
| ノルウェークローネ 小計 |           |                       | 28,160,000.00 | 29,293,723.00<br>(364,413,914)   |  |
| 国債証券 合計      |           |                       |               | 803,495,808<br>(803,495,808)     |  |
| 地方債証券        | カナダドル     | BRCOL 2.300 06/18/26  | 1,910,000.00  | 2,050,251.30                     |  |
| 地方債証券        | カナダドル     | BRCOL 2.550 06/18/27  | 850,000.00    | 928,013.00                       |  |
| カナダドル 小計     |           |                       | 2,760,000.00  | 2,978,264.30<br>(246,719,414)    |  |
| 地方債証券        | オーストラリアドル | NSWTC 1.250 03/20/25  | 1,780,000.00  | 1,847,689.84                     |  |
| 地方債証券        | オーストラリアドル | NSWTC 3.000 05/20/27  | 2,200,000.00  | 2,507,509.40                     |  |
| 地方債証券        | オーストラリアドル | TCV 5.500 11/17/26    | 1,200,000.00  | 1,531,194.00                     |  |
| 地方債証券        | オーストラリアドル | TCV 5.500 12/17/24    | 1,000,000.00  | 1,199,165.00                     |  |
| オーストラリアドル 小計 |           |                       | 6,180,000.00  | 7,085,558.24<br>(578,181,552)    |  |
| 地方債証券 合計     |           |                       |               | 824,900,966<br>(824,900,966)     |  |
| 特殊債券         | カナダドル     | CANHOU 2.650 12/15/28 | 960,000.00    | 1,071,494.40                     |  |
| カナダドル 小計     |           |                       | 960,000.00    | 1,071,494.40<br>(88,762,596)     |  |
| 特殊債券         | 英ポンド      | EIB 5.500 04/15/25    | 990,000.00    | 1,204,137.00                     |  |
| 特殊債券         | 英ポンド      | IBRD 0.250 07/22/26   | 900,000.00    | 893,700.00                       |  |
| 特殊債券         | 英ポンド      | IBRD 1.000 12/21/29   | 400,000.00    | 411,040.00                       |  |
| 英ポンド 小計      |           |                       | 2,290,000.00  | 2,508,877.00<br>(365,919,710)    |  |
| 特殊債券         | ノルウェークローネ | IBRD 1.750 11/06/24   | 16,700,000.00 | 17,199,330.00                    |  |
| ノルウェークローネ 小計 |           |                       | 16,700,000.00 | 17,199,330.00<br>(213,959,665)   |  |
| 特殊債券 合計      |           |                       |               | 668,641,971<br>(668,641,971)     |  |
| 合計           |           |                       |               | 2,297,038,745<br>(2,297,038,745) |  |

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 1 銘柄  | 41.7%    | 10.4%      |
|           | 地方債証券 2 銘柄 | 42.9%    | 10.7%      |
|           | 特殊債券 1 銘柄  | 15.4%    | 3.9%       |
| 英ポンド      | 国債証券 2 銘柄  | 35.2%    | 8.7%       |
|           | 特殊債券 3 銘柄  | 64.8%    | 15.9%      |
| ノルウェークローネ | 国債証券 3 銘柄  | 63.0%    | 15.9%      |
|           | 特殊債券 1 銘柄  | 37.0%    | 9.3%       |
| オーストラリアドル | 地方債証券 4 銘柄 | 100.0%   | 25.2%      |

## 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J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Jリートマザーファンド

#### (1) 貸借対照表

| 区分          |          | 2021年2月15日現在  |
|-------------|----------|---------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）         |
| 資産の部        |          |               |
| 流動資産        |          |               |
| コール・ローン     |          | 41,539,829    |
| 投資証券        |          | 5,326,050,400 |
| 未収入金        |          | 39,585,280    |
| 未収配当金       |          | 35,606,501    |
| 流動資産合計      |          | 5,442,782,010 |
| 資産合計        |          | 5,442,782,010 |
| 負債の部        |          |               |
| 流動負債        |          |               |
| 未払解約金       |          | 50,000,000    |
| 未払利息        |          | 106           |
| その他未払費用     |          | 80            |
| 流動負債合計      |          | 50,000,186    |
| 負債合計        |          | 50,000,186    |
| 純資産の部       |          |               |
| 元本等         |          |               |
| 元本          | 1, 2     | 2,117,254,107 |
| 剰余金         |          |               |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 3,275,527,717 |
| 元本等合計       |          | 5,392,781,824 |
| 純資産合計       |          | 5,392,781,824 |
| 負債純資産合計     |          | 5,442,782,010 |

## ( 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<br>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                                  | 2021年 2 月15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<br>2,292,593,837円<br>期中追加設定元本額<br>2,498,491,900円<br>期中一部解約元本額<br>2,673,831,630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）<br>1,053,994,115円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>314,421,004円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>530,624,108円<br>しんきん3 資産ファンド（1 年決算型）<br>164,795,789円<br>しんきんグローバル6 資産ファンド（1 年決算型）<br>53,419,091円<br>合計 2,117,254,107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 | 2,117,254,107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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                         | 2021年2月15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                 | <p>(1) 有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|      | 2021年2月15日現在    |
|------|-----------------|
| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 投資証券 | 709,661,678円    |
| 合計   | 709,661,678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）

|              |
|--------------|
| 2021年2月15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 2020年2月15日<br>至 2021年2月15日 |
| 該当事項はありません。                  |

## （1口当たり情報）

|                                           |
|-------------------------------------------|
| 2021年2月15日現在                              |
| 1口当たり純資産額 2,5471円<br>(1万口当たり純資産額 25,471円) |

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式  
該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 券面総額（円） | 評価額（円） | 備考 |
|----|----|---------|--------|----|
|----|----|---------|--------|----|

|      |                              |       |             |  |
|------|------------------------------|-------|-------------|--|
| 投資証券 | エスコンジャパンリート投資法人              | 332   | 42,263,600  |  |
| 投資証券 | サンケイリアルエステート投資法人             | 173   | 19,722,000  |  |
| 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人           | 125   | 74,875,000  |  |
| 投資証券 | M C U B S M i d C i t y 投資法人 | 640   | 70,720,000  |  |
| 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人                  | 599   | 87,394,100  |  |
| 投資証券 | 産業ファンド投資法人                   | 669   | 127,176,900 |  |
| 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人              | 388   | 125,518,000 |  |
| 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      | 291   | 55,493,700  |  |
| 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人           | 314   | 142,085,000 |  |
| 投資証券 | G L P 投資法人                   | 1,429 | 253,790,400 |  |
| 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人           | 126   | 39,816,000  |  |
| 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人               | 735   | 249,900,000 |  |
| 投資証券 | 星野リゾート・リート投資法人               | 90    | 50,400,000  |  |
| 投資証券 | O n e リート投資法人                | 63    | 18,862,200  |  |
| 投資証券 | イオンリート投資法人                   | 665   | 96,757,500  |  |
| 投資証券 | ヒューリックリート投資法人                | 415   | 72,791,000  |  |
| 投資証券 | 日本リート投資法人                    | 199   | 81,689,500  |  |
| 投資証券 | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人        | 3,270 | 54,739,800  |  |
| 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人                | 1,373 | 112,997,900 |  |
| 投資証券 | ケネディクス商業リート投資法人              | 305   | 81,648,500  |  |
| 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人            | 1,882 | 321,633,800 |  |
| 投資証券 | ラサールロジポート投資法人                | 529   | 87,761,100  |  |
| 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人          | 134   | 68,876,000  |  |
| 投資証券 | 森トラスト・ホテルリート投資法人             | 123   | 15,842,400  |  |
| 投資証券 | 三菱地所物流リート投資法人                | 72    | 30,492,000  |  |
| 投資証券 | C R E ロジスティクスファンド投資法人        | 82    | 12,726,400  |  |
| 投資証券 | タカラレーベン不動産投資法人               | 160   | 18,192,000  |  |
| 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人                 | 598   | 383,318,000 |  |
| 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人             | 551   | 358,701,000 |  |
| 投資証券 | 日本リテールファンド投資法人               | 1,180 | 259,482,000 |  |
| 投資証券 | オリックス不動産投資法人                 | 1,166 | 222,239,600 |  |
| 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人              | 388   | 151,708,000 |  |
| 投資証券 | プレミアム投資法人                    | 351   | 48,718,800  |  |
| 投資証券 | 東急リアル・エステート投資法人              | 527   | 93,964,100  |  |
| 投資証券 | グローバル・ワン不動産投資法人              | 261   | 30,276,000  |  |
| 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人              | 1,280 | 188,160,000 |  |
| 投資証券 | 森トラスト総合リート投資法人               | 276   | 40,848,000  |  |
| 投資証券 | インヴィンシブル投資法人                 | 2,150 | 85,140,000  |  |
| 投資証券 | フロンティア不動産投資法人                | 252   | 117,558,000 |  |
| 投資証券 | 平和不動産リート投資法人                 | 260   | 37,310,000  |  |
| 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人            | 301   | 94,062,500  |  |
| 投資証券 | 福岡リート投資法人                    | 360   | 62,280,000  |  |
| 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人              | 160   | 111,360,000 |  |

|         |                  |        |               |  |
|---------|------------------|--------|---------------|--|
| 投資証券    | いちごオフィスリート投資法人   | 368    | 32,604,800    |  |
| 投資証券    | 大和証券オフィス投資法人     | 150    | 104,550,000   |  |
| 投資証券    | 阪急阪神リート投資法人      | 239    | 34,487,700    |  |
| 投資証券    | スタートプロシード投資法人    | 58     | 12,278,600    |  |
| 投資証券    | 大和ハウスリート投資法人     | 687    | 199,642,200   |  |
| 投資証券    | ジャパン・ホテル・リート投資法人 | 1,689  | 102,015,600   |  |
| 投資証券    | 大和証券リビング投資法人     | 573    | 57,471,900    |  |
| 投資証券    | ジャパンエクセレント投資法人   | 592    | 83,708,800    |  |
| 投資証券 合計 |                  | 29,600 | 5,326,050,400 |  |
| 合計      |                  | 29,600 | 5,326,050,400 |  |

## 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          |          | 2021年 2 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 預金          |          | 2,816,077      |
| コール・ローン     |          | 1,036,798      |
| 投資証券        |          | 4,643,964,285  |
| 未収入金        |          | 199,974        |
| 未収配当金       |          | 8,132,796      |
| 流動資産合計      |          | 4,656,149,930  |
| 資産合計        |          | 4,656,149,930  |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 2              |
| その他未払費用     |          | 41             |
| 流動負債合計      |          | 43             |
| 負債合計        |          | 43             |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 2,677,720,619  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 1,978,429,268  |
| 元本等合計       |          | 4,656,149,887  |
| 純資産合計       |          | 4,656,149,887  |
| 負債純資産合計     |          | 4,656,149,930  |

## ( 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<br>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<br>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<br>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                                  | 2021年 2 月15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<br>2,835,288,650円<br>期中追加設定元本額<br>3,232,578,549円<br>期中一部解約元本額<br>3,390,146,580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）<br>1,508,222,294円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>328,818,910円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>764,835,510円<br>しんきんグローバル6 資産ファンド（1 年決算型）<br>75,843,905円<br>合計 2,677,720,619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 | 2,677,720,619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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15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・分析およ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。運用リスク管理状況は、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                        | 2021年 2 月15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                 | <p>(1)有価証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引<br/>該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品<br/>有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> |
| 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

|      | 2021年 2 月15日現在  |
|------|-----------------|
| 種類   | 当期間の損益に含まれた評価差額 |
| 投資証券 | 393,850,352円    |
| 合計   | 393,850,352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）

| 2021年 2 月15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 2020年 2 月15日<br>至 2021年 2 月15日 |
|----------------------------------|
| 該当事項はありません。                      |

## （1口当たり情報）

| 2021年 2 月15日現在                            |
|-------------------------------------------|
| 1口当たり純資産額 1.7388円<br>(1万口当たり純資産額 17,388円) |

## （3）附属明細表

## 第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

## 株式以外の有価証券

| 種類   | 通貨  | 銘柄                                  | 券面総額  | 評価額        | 備考 |
|------|-----|-------------------------------------|-------|------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ACADIA REALTY TRUST                 | 2,871 | 51,563.16  |    |
| 投資証券 | 米ドル | AGREE REALTY CORP                   | 1,985 | 129,163.95 |    |
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDER & BALDWIN INC             | 2,502 | 43,534.80  |    |
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDER'S INC                     | 71    | 19,047.88  |    |
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 4,211 | 728,755.66 |    |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN ASSETS TRUST INC           | 1,708 | 51,376.64  |    |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC     | 4,680 | 203,392.80 |    |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN FINANCE TRUST INC          | 3,611 | 30,404.62  |    |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN HOMES 4 RENT- A            | 9,123 | 296,315.04 |    |
| 投資証券 | 米ドル | AMERICOLD REALTY TRUST              | 6,966 | 248,268.24 |    |
| 投資証券 | 米ドル | APARTMENT INCOME REIT CORP          | 5,062 | 214,527.56 |    |
| 投資証券 | 米ドル | APARTMENT INVT & MGMT CO -A         | 4,933 | 24,171.70  |    |
| 投資証券 | 米ドル | APPLE HOSPITALITY REIT INC          | 7,008 | 95,729.28  |    |
| 投資証券 | 米ドル | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC       | 1,928 | 22,962.48  |    |

|      |     |                                       |        |              |  |
|------|-----|---------------------------------------|--------|--------------|--|
| 投資証券 | 米ドル | AVALONBAY COMMUNITIES INC             | 4,747  | 852,133.97   |  |
| 投資証券 | 米ドル | BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT      | 819    | 9,246.51     |  |
| 投資証券 | 米ドル | BOSTON PROPERTIES INC                 | 4,817  | 453,279.70   |  |
| 投資証券 | 米ドル | BRANDYWINE REALTY TRUST               | 5,871  | 70,393.29    |  |
| 投資証券 | 米ドル | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC            | 10,082 | 194,885.06   |  |
| 投資証券 | 米ドル | BROOKFIELD PROPERTY REIT INC          | 1,281  | 23,634.45    |  |
| 投資証券 | 米ドル | BRT APARTMENTS CORP                   | 334    | 5,036.72     |  |
| 投資証券 | 米ドル | CAMDEN PROPERTY TRUST                 | 3,312  | 352,860.48   |  |
| 投資証券 | 米ドル | CARETRUST REIT INC                    | 3,096  | 71,362.80    |  |
| 投資証券 | 米ドル | CENTERSPACE                           | 458    | 33,205.00    |  |
| 投資証券 | 米ドル | CHATHAM LODGING TRUST                 | 1,563  | 19,084.23    |  |
| 投資証券 | 米ドル | CIM COMMERCIAL TRUST CORP             | 320    | 3,817.60     |  |
| 投資証券 | 米ドル | CITY OFFICE REIT INC                  | 1,444  | 14,541.08    |  |
| 投資証券 | 米ドル | CLIPPER REALTY INC                    | 406    | 3,142.44     |  |
| 投資証券 | 米ドル | COLONY CAPITAL INC                    | 16,378 | 90,242.78    |  |
| 投資証券 | 米ドル | COLUMBIA PROPERTY TRUST INC           | 3,969  | 56,677.32    |  |
| 投資証券 | 米ドル | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC        | 755    | 35,432.15    |  |
| 投資証券 | 米ドル | COREPOINT LODGING INC                 | 1,297  | 10,674.31    |  |
| 投資証券 | 米ドル | CORESITE REALTY CORP                  | 1,454  | 178,943.78   |  |
| 投資証券 | 米ドル | CORPORATE OFFICE PROPERTIES TRUST     | 3,736  | 98,182.08    |  |
| 投資証券 | 米ドル | COUSINS PROPERTIES INC                | 5,052  | 170,100.84   |  |
| 投資証券 | 米ドル | CTO REALTY GROWTH INC                 | 178    | 8,652.58     |  |
| 投資証券 | 米ドル | CUBESMART                             | 6,640  | 238,176.80   |  |
| 投資証券 | 米ドル | CYRUSONE INC                          | 4,095  | 296,928.45   |  |
| 投資証券 | 米ドル | DIAMONDROCK HOSPITALITY CO            | 6,639  | 59,684.61    |  |
| 投資証券 | 米ドル | DIGITAL REALTY TRUST INC              | 9,512  | 1,332,250.72 |  |
| 投資証券 | 米ドル | DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST          | 7,921  | 35,486.08    |  |
| 投資証券 | 米ドル | DOUGLAS EMMETT INC                    | 5,606  | 166,666.38   |  |
| 投資証券 | 米ドル | DUKE REALTY CORP                      | 12,648 | 525,903.84   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EAGLE HOSPITALITY TRUST               | 9,100  | 1,246.70     |  |
| 投資証券 | 米ドル | EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES, INC.  | 2,742  | 62,325.66    |  |
| 投資証券 | 米ドル | EASTGROUP PROPERTIES INC              | 1,345  | 196,881.10   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EMPIRE STATE REALTY TRUST INC         | 4,842  | 48,565.26    |  |
| 投資証券 | 米ドル | EPR PROPERTIES                        | 2,560  | 105,548.80   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EQUINIX INC                           | 3,027  | 2,148,594.87 |  |
| 投資証券 | 米ドル | EQUITY COMMONWEALTH                   | 4,090  | 118,364.60   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC       | 5,763  | 361,801.14   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EQUITY RESIDENTIAL                    | 11,646 | 785,872.08   |  |
| 投資証券 | 米ドル | ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC | 3,559  | 82,248.49    |  |
| 投資証券 | 米ドル | ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 2,217  | 597,148.95   |  |
| 投資証券 | 米ドル | EXTRA SPACE STORAGE INC               | 4,395  | 513,687.60   |  |

|      |     |                                          |        |            |  |
|------|-----|------------------------------------------|--------|------------|--|
| 投資証券 | 米ドル | FARMLAND PARTNERS INC                    | 967    | 11,294.56  |  |
| 投資証券 | 米ドル | FEDERAL REALTY INVS TRUST                | 2,341  | 239,554.53 |  |
| 投資証券 | 米ドル | FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC        | 4,388  | 191,755.60 |  |
| 投資証券 | 米ドル | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST              | 2,420  | 67,106.60  |  |
| 投資証券 | 米ドル | FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP          | 3,214  | 13,948.76  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC        | 7,349  | 323,649.96 |  |
| 投資証券 | 米ドル | GEO GROUP INC/THE                        | 3,888  | 34,369.92  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GETTY REALTY CORP                        | 1,172  | 33,132.44  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GLADSTONE COMMERCIAL CORP                | 1,133  | 21,866.90  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GLADSTONE LAND CORP                      | 790    | 14,694.00  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GLOBAL MEDICAL REIT INC                  | 1,553  | 20,965.50  |  |
| 投資証券 | 米ドル | GLOBAL NET LEASE INC                     | 3,067  | 56,800.84  |  |
| 投資証券 | 米ドル | HEALTHCARE REALTY TRUST INC              | 4,637  | 143,561.52 |  |
| 投資証券 | 米ドル | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC          | 7,432  | 215,453.68 |  |
| 投資証券 | 米ドル | HEALTHPEAK PROPERTIES INC                | 18,307 | 566,418.58 |  |
| 投資証券 | 米ドル | HERSHA HOSPITALITY TRUST                 | 1,213  | 10,359.02  |  |
| 投資証券 | 米ドル | HIGHWOODS PROPERTIES INC                 | 3,533  | 141,531.98 |  |
| 投資証券 | 米ドル | HOST HOTELS & RESORTS INC                | 23,985 | 357,376.50 |  |
| 投資証券 | 米ドル | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC            | 5,174  | 126,038.64 |  |
| 投資証券 | 米ドル | INDEPENDENCE REALTY TRUST INC            | 3,288  | 47,873.28  |  |
| 投資証券 | 米ドル | INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST    | 2,236  | 50,824.28  |  |
| 投資証券 | 米ドル | INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC     | 754    | 161,657.60 |  |
| 投資証券 | 米ドル | INVITATION HOMES INC                     | 19,061 | 590,891.00 |  |
| 投資証券 | 米ドル | IRON MOUNTAIN INC                        | 9,799  | 325,032.83 |  |
| 投資証券 | 米ドル | JBG SMITH PROPERTIES                     | 3,789  | 124,127.64 |  |
| 投資証券 | 米ドル | KEPPEL PACIFIC OAK US REIT               | 22,700 | 15,549.50  |  |
| 投資証券 | 米ドル | KILROY REALTY CORP                       | 3,566  | 214,994.14 |  |
| 投資証券 | 米ドル | KIMCO REALTY CORP                        | 14,707 | 265,167.21 |  |
| 投資証券 | 米ドル | KITE REALTY GROUP TRUST                  | 2,878  | 51,947.90  |  |
| 投資証券 | 米ドル | LEXINGTON REALTY TRUST                   | 9,418  | 105,199.06 |  |
| 投資証券 | 米ドル | LIFE STORAGE INC                         | 2,479  | 203,823.38 |  |
| 投資証券 | 米ドル | LTC PROPERTIES INC                       | 1,341  | 56,670.66  |  |
| 投資証券 | 米ドル | MACERICH CO/THE                          | 3,730  | 48,117.00  |  |
| 投資証券 | 米ドル | MACK-CALI REALTY CORP                    | 2,865  | 39,938.10  |  |
| 投資証券 | 米ドル | MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 49,468 | 35,616.96  |  |
| 投資証券 | 米ドル | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC             | 19,315 | 434,587.50 |  |
| 投資証券 | 米ドル | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC    | 3,889  | 537,226.46 |  |
| 投資証券 | 米ドル | MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP     | 3,335  | 60,030.00  |  |
| 投資証券 | 米ドル | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC           | 5,908  | 249,908.40 |  |
| 投資証券 | 米ドル | NATIONAL STORAGE AFFILIATES              | 2,096  | 79,124.00  |  |

|      |     |                                     |        |              |  |
|------|-----|-------------------------------------|--------|--------------|--|
| 投資証券 | 米ドル | NATL HEALTH INVESTORS INC           | 1,505  | 105,470.40   |  |
| 投資証券 | 米ドル | NETSTREIT CORP                      | 459    | 8,271.18     |  |
| 投資証券 | 米ドル | NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC     | 2,569  | 14,001.05    |  |
| 投資証券 | 米ドル | NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST          | 781    | 33,223.74    |  |
| 投資証券 | 米ドル | OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST      | 1,695  | 42,697.05    |  |
| 投資証券 | 米ドル | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC      | 7,719  | 289,076.55   |  |
| 投資証券 | 米ドル | ONE LIBERTY PROPERTIES INC          | 531    | 11,198.79    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PARAMOUNT GROUP INC                 | 5,615  | 50,591.15    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PARK HOTELS & RESORTS INC           | 8,012  | 157,676.16   |  |
| 投資証券 | 米ドル | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST             | 4,452  | 96,118.68    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PHYSICIANS REALTY TRUST             | 6,997  | 127,275.43   |  |
| 投資証券 | 米ドル | PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC    | 4,333  | 74,917.57    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC        | 789    | 12,000.69    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 1,651  | 13,571.22    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PRIME US REIT                       | 15,000 | 12,150.00    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PROLOGIS INC                        | 25,117 | 2,704,347.39 |  |
| 投資証券 | 米ドル | PS BUSINESS PARKS INC               | 682    | 98,944.56    |  |
| 投資証券 | 米ドル | PUBLIC STORAGE                      | 5,162  | 1,196,861.32 |  |
| 投資証券 | 米ドル | QTS REALTY TRUST INC                | 2,187  | 139,290.03   |  |
| 投資証券 | 米ドル | REALTY INCOME CORP                  | 11,936 | 745,522.56   |  |
| 投資証券 | 米ドル | REGENCY CENTERS CORP                | 5,366  | 282,358.92   |  |
| 投資証券 | 米ドル | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP | 4,077  | 63,988.51    |  |
| 投資証券 | 米ドル | RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC    | 7,129  | 76,066.43    |  |
| 投資証券 | 米ドル | RETAIL VALUE INC                    | 546    | 9,423.96     |  |
| 投資証券 | 米ドル | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC       | 4,439  | 228,608.50   |  |
| 投資証券 | 米ドル | RLJ LODGING TRUST                   | 5,613  | 79,816.86    |  |
| 投資証券 | 米ドル | RPT REALTY                          | 2,694  | 28,529.46    |  |
| 投資証券 | 米ドル | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES        | 1,848  | 135,828.00   |  |
| 投資証券 | 米ドル | SABRA HEALTH CARE REIT INC          | 7,048  | 125,806.80   |  |
| 投資証券 | 米ドル | SAFEHOLD INC                        | 488    | 40,064.80    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SAUL CENTERS INC                    | 425    | 14,394.75    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SERITAGE GROWTH PROPERTIES          | 1,196  | 21,827.00    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SERVICE PROPERTIES TRUST            | 5,627  | 67,467.73    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SIMON PROPERTY GROUP INC            | 11,150 | 1,218,249.00 |  |
| 投資証券 | 米ドル | SITE CENTERS CORP                   | 5,208  | 64,162.56    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SL GREEN REALTY CORP                | 2,468  | 160,395.32   |  |
| 投資証券 | 米ドル | SPIRIT REALTY CAPITAL INC           | 3,885  | 160,139.70   |  |
| 投資証券 | 米ドル | STAG INDUSTRIAL INC                 | 5,075  | 165,242.00   |  |
| 投資証券 | 米ドル | STORE CAPITAL CORP                  | 8,037  | 264,658.41   |  |
| 投資証券 | 米ドル | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC         | 3,517  | 34,079.73    |  |
| 投資証券 | 米ドル | SUN COMMUNITIES INC                 | 3,658  | 544,273.82   |  |
| 投資証券 | 米ドル | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC        | 7,333  | 87,482.69    |  |

|        |       |                                            |         |                                  |  |
|--------|-------|--------------------------------------------|---------|----------------------------------|--|
| 投資証券   | 米ドル   | TANGER FACTORY OUTLET CENTERS              | 3,260   | 46,129.00                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | TERRENO REALTY CORP                        | 2,334   | 142,654.08                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | UDR INC                                    | 10,014  | 427,697.94                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | UMH PROPERTIES INC                         | 1,279   | 21,141.87                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME               | 426     | 27,051.00                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | URBAN EDGE PROPERTIES                      | 3,736   | 60,037.52                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | URSTADT BIDDLE - CLASS A                   | 998     | 15,119.70                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | VENTAS INC                                 | 12,737  | 646,020.64                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | VEREIT INC                                 | 7,425   | 280,665.00                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | VICI PROPERTIES INC                        | 18,250  | 497,495.00                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | VORNADO REALTY TRUST                       | 5,333   | 204,733.87                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WASHINGTON PRIME GROUP INC                 | 822     | 9,929.76                         |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WASHINGTON REIT                            | 2,838   | 65,955.12                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WEINGARTEN REALTY INVESTORS                | 4,096   | 104,284.16                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WELLTOWER INC                              | 14,157  | 955,739.07                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WHITESTONE REIT                            | 1,325   | 11,726.25                        |  |
| 投資証券   | 米ドル   | WP CAREY INC                               | 5,964   | 419,805.96                       |  |
| 投資証券   | 米ドル   | XENIA HOTELS & RESORTS INC                 | 3,784   | 61,603.52                        |  |
| 米ドル 小計 |       |                                            | 822,357 | 32,684,171.47<br>(3,435,760,104) |  |
| 投資証券   | カナダドル | ALLIED PROPERTIES REIT                     | 2,079   | 75,093.48                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST         | 2,213   | 23,634.84                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E               | 710     | 7,873.90                         |  |
| 投資証券   | カナダドル | BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST     | 759     | 27,020.40                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | CAN APARTMENT PROP REIT                    | 2,869   | 147,610.05                       |  |
| 投資証券   | カナダドル | CHOICE PROPERTIES REIT                     | 5,542   | 70,771.34                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | COMINAR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST       | 2,975   | 26,537.00                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST       | 1,524   | 21,930.36                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST            | 1,705   | 26,393.40                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT    | 2,837   | 36,795.89                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT        | 902     | 17,534.88                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,747   | 55,642.95                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST       | 1,035   | 78,784.20                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS               | 4,835   | 63,241.80                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | INTERRENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST     | 2,247   | 30,334.50                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE               | 1,672   | 30,045.84                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | MINTO APARTMENT REIT                       | 591     | 11,861.37                        |  |
| 投資証券   | カナダドル | MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT   | 636     | 9,381.00                         |  |
| 投資証券   | カナダドル | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REIT       | 2,865   | 37,187.70                        |  |

|          |       |                                       |         |                               |  |
|----------|-------|---------------------------------------|---------|-------------------------------|--|
| 投資証券     | カナダドル | PLAZA RETAIL REIT                     | 1,919   | 7,023.54                      |  |
| 投資証券     | カナダドル | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST   | 5,332   | 95,922.68                     |  |
| 投資証券     | カナダドル | SLATE GROCERY REIT                    | 762     | 8,877.30                      |  |
| 投資証券     | カナダドル | SLATE OFFICE REIT                     | 1,235   | 5,322.85                      |  |
| 投資証券     | カナダドル | SMARTCENTRES REIT VAR VT UN           | 2,427   | 60,820.62                     |  |
| 投資証券     | カナダドル | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT         | 2,868   | 39,377.64                     |  |
| 投資証券     | カナダドル | TRUE NORTH COMMERCIAL REIT            | 1,506   | 9,563.10                      |  |
| 投資証券     | カナダドル | WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 1,358   | 27,689.62                     |  |
| カナダドル 小計 |       |                                       | 59,150  | 1,052,272.25<br>(87,170,233)  |  |
| 投資証券     | ユーロ   | AEDIFICA                              | 1,109   | 111,121.80                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | ALSTRIA OFFICE REIT-AG                | 6,095   | 83,135.80                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | ALTAREA                               | 121     | 16,915.80                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | BEFIMMO                               | 890     | 30,482.50                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | CARE PROPERTY INVEST                  | 802     | 20,170.30                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | CARMILA                               | 1,563   | 18,255.84                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | COFINIMMO                             | 922     | 120,966.40                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | COVIVIO                               | 1,639   | 107,518.40                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | CROMWELL EUROPEAN REIT                | 44,100  | 22,270.50                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV          | 1,188   | 18,651.60                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | GECINA SA                             | 1,845   | 217,710.00                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | HAMBORNER REIT AG                     | 2,334   | 20,585.88                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | HIBERNIA REIT PLC                     | 22,774  | 24,595.92                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | ICADE                                 | 1,052   | 62,804.40                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE      | 1,952   | 7,505.44                      |  |
| 投資証券     | ユーロ   | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA       | 8,684   | 67,561.52                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES          | 764     | 16,884.40                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES          | 14,221  | 21,331.50                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | KLEPIERRE                             | 6,936   | 131,367.84                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA      | 2,041   | 9,031.42                      |  |
| 投資証券     | ユーロ   | MERCIALYS                             | 1,316   | 10,185.84                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA           | 11,241  | 87,792.21                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | MONTEA                                | 355     | 35,145.00                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | NSI NV                                | 576     | 18,489.60                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | RETAIL ESTATES                        | 361     | 21,840.50                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD             | 4,709   | 274,346.34                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | VASTNED RETAIL NV                     | 633     | 14,052.60                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | WAREHOUSES DE PAUW SCA                | 4,456   | 129,491.36                    |  |
| 投資証券     | ユーロ   | WERELDHAVE NV                         | 1,340   | 15,865.60                     |  |
| 投資証券     | ユーロ   | XIOR STUDENT HOUSING NV               | 486     | 24,227.10                     |  |
| ユーロ 小計   |       |                                       | 146,505 | 1,760,303.41<br>(224,333,066) |  |

|        |           |                                       |         |                               |  |
|--------|-----------|---------------------------------------|---------|-------------------------------|--|
| 投資証券   | 英債券       | AEW UK REIT PLC                       | 6,239   | 5,153.41                      |  |
| 投資証券   | 英債券       | ASSURA PLC                            | 90,454  | 65,307.78                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | BIG YELLOW GROUP PLC                  | 5,571   | 62,228.07                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LIMITED | 26,599  | 19,177.87                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | BRITISH LAND CO PLC                   | 31,896  | 146,721.60                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE          | 29,589  | 47,342.40                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC            | 20,713  | 22,287.18                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | CUSTODIAN REIT PLC                    | 13,977  | 12,691.11                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | DERWENT LONDON PLC                    | 3,807   | 119,159.10                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC          | 20,038  | 13,826.22                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | GCP STUDENT LIVING PLC                | 15,141  | 22,045.29                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | GREAT PORTLAND ESTATES PLC            | 8,690   | 56,241.68                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | HAMMERSON PLC                         | 133,651 | 28,347.37                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC            | 10,613  | 12,045.75                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | LAND SECURITIES GROUP PLC             | 25,548  | 155,076.36                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | LONDONMETRIC PROPERTY PLC             | 30,887  | 69,001.55                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | LXI REIT PLC                          | 17,351  | 22,035.77                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | NEWRIVER REIT PLC                     | 10,189  | 7,804.77                      |  |
| 投資証券   | 英債券       | PICTON PROPERTY INCOME LTD            | 18,222  | 15,670.92                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC         | 44,334  | 64,904.97                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | RDI REIT PLC                          | 8,800   | 8,008.00                      |  |
| 投資証券   | 英債券       | REGIONAL REIT LTD                     | 14,359  | 10,927.19                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | SAFESTORE HOLDINGS PLC                | 7,162   | 55,541.31                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | SCHRODER REIT LTD                     | 18,823  | 7,453.90                      |  |
| 投資証券   | 英債券       | SEGRO PLC                             | 40,355  | 390,636.40                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | SHAFTESBURY PLC                       | 10,246  | 57,941.13                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | STANDARD LIFE INV PROP INC            | 14,393  | 8,851.69                      |  |
| 投資証券   | 英債券       | SUPERMARKET INCOME REIT PLC           | 22,159  | 24,153.31                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC  | 13,106  | 14,023.42                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | TRITAX BIG BOX REIT PLC               | 58,046  | 106,282.22                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT           | 24,646  | 16,340.29                     |  |
| 投資証券   | 英債券       | UNITE GROUP PLC                       | 13,539  | 129,500.53                    |  |
| 投資証券   | 英債券       | WORKSPACE GROUP PLC                   | 4,408   | 30,856.00                     |  |
| 英債券 小計 |           |                                       | 813,551 | 1,827,584.56<br>(266,553,208) |  |
| 投資証券   | オーストラリアドル | ABACUS PROPERTY GROUP                 | 13,133  | 34,933.78                     |  |
| 投資証券   | オーストラリアドル | APN INDUSTRIA REIT                    | 4,469   | 12,736.65                     |  |
| 投資証券   | オーストラリアドル | ARENA REIT                            | 11,327  | 34,887.16                     |  |
| 投資証券   | オーストラリアドル | AVENTUS GROUP                         | 13,283  | 36,926.74                     |  |

|      |               |                                                |         |              |  |
|------|---------------|------------------------------------------------|---------|--------------|--|
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | BWP TRUST                                      | 16,654  | 65,450.22    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CENTURIA CAPITAL GROUP                         | 16,679  | 40,863.55    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CENTURIA INDUSTRIAL REIT                       | 16,109  | 49,615.72    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CENTURIA OFFICE REIT                           | 12,670  | 25,149.95    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CHARTER HALL GROUP                             | 15,839  | 225,705.75   |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CHARTER HALL LONG WALE REIT                    | 17,488  | 84,292.16    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CHARTER HALL RETAIL REIT                       | 17,588  | 61,558.00    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE             | 10,912  | 34,045.44    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | CROMWELL PROPERTY GROUP                        | 65,988  | 54,440.10    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | DEXUS                                          | 37,034  | 322,936.48   |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | GDI PROPERTY GROUP                             | 16,901  | 19,267.14    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | GOODMAN GROUP                                  | 57,169  | 1,026,755.24 |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | GPT GROUP                                      | 66,240  | 273,571.20   |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA               | 9,760   | 31,036.80    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | HOME CONSORTIUM                                | 4,747   | 20,079.81    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | HOME CO DAILY NEEDS REIT                       | 10,559  | 14,149.06    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD                 | 6,038   | 18,778.18    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | INGENIA COMMUNITIES GROUP                      | 10,303  | 55,430.14    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | IRONGATE GROUP                                 | 17,900  | 22,554.00    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | MIRVAC GROUP                                   | 133,898 | 310,643.36   |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | NATIONAL STORAGE REIT                          | 31,853  | 61,157.76    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | RURAL FUNDS GROUP                              | 11,259  | 28,034.91    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | SCENTRE GROUP                                  | 176,501 | 474,787.69   |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA<br>PROPERTY GROUP | 36,873  | 88,863.93    |  |
| 投資証券 | オーストラ<br>リアドル | STOCKLAND                                      | 81,174  | 380,706.06   |  |

|               |            |                                        |           |                               |  |
|---------------|------------|----------------------------------------|-----------|-------------------------------|--|
| 投資証券          | オーストラリアドル  | VICINITY CENTRES                       | 131,582   | 201,978.37                    |  |
| 投資証券          | オーストラリアドル  | WAYPOINT REIT LTD                      | 26,708    | 66,502.92                     |  |
| オーストラリアドル 小計  |            |                                        | 1,098,638 | 4,177,838.27<br>(340,911,602) |  |
| 投資証券          | ニュージーランドドル | ARGOSY PROPERTY LTD                    | 27,638    | 42,977.09                     |  |
| 投資証券          | ニュージーランドドル | GOODMAN PROPERTY TRUST                 | 37,920    | 84,751.20                     |  |
| 投資証券          | ニュージーランドドル | KIWI PROPERTY GROUP INC                | 54,565    | 68,206.25                     |  |
| 投資証券          | ニュージーランドドル | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND LTD    | 37,595    | 62,407.70                     |  |
| 投資証券          | ニュージーランドドル | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST        | 13,443    | 43,152.03                     |  |
| ニュージーランドドル 小計 |            |                                        | 171,161   | 301,494.27<br>(22,883,415)    |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | CHAMPION REIT                          | 69,000    | 303,600.00                    |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | FORTUNE REIT                           | 49,000    | 352,310.00                    |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | LINK REIT                              | 70,100    | 4,717,730.00                  |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | PROSPERITY REIT                        | 41,000    | 99,220.00                     |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 34,000    | 132,260.00                    |  |
| 投資証券          | 香港ドル       | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST    | 55,000    | 206,250.00                    |  |
| 香港ドル 小計       |            |                                        | 318,100   | 5,811,370.00<br>(78,802,177)  |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | AIMS APAC REIT                         | 15,015    | 19,819.80                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | ARA LOGOS LOGISTICS TRUST              | 39,377    | 28,351.44                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 107,650   | 330,485.50                    |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | ASCOTT RESIDENCE TRUST                 | 63,689    | 63,689.00                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | CAPITALAND CHINA TRUST                 | 32,408    | 45,371.20                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 153,875   | 329,292.50                    |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | CDL HOSPITALITY TRUSTS                 | 25,050    | 30,060.00                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | EC WORLD REIT                          | 10,700    | 7,650.50                      |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | ESR-REIT                               | 78,849    | 30,751.11                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | FAR EAST HOSPITALITY TRUST             | 33,800    | 19,773.00                     |  |
| 投資証券          | シンガポールドル   | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST     | 22,700    | 4,653.50                      |  |

|             |          |                                          |           |                               |  |
|-------------|----------|------------------------------------------|-----------|-------------------------------|--|
| 投資証券        | シンガポールドル | FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST       | 22,246    | 22.24                         |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | FRASERS CENTREPOINT TRUST                | 45,879    | 115,615.08                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | FRASERS HOSPITALITY TRUST                | 24,800    | 12,400.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST     | 90,403    | 129,276.29                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | IREIT GLOBAL                             | 15,747    | 10,471.75                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | KEPPEL DC REIT                           | 43,840    | 128,012.80                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | KEPPEL REIT                              | 57,550    | 67,333.50                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT         | 29,100    | 22,989.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST       | 193,380   | 11,989.56                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST               | 74,209    | 154,354.72                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST               | 56,680    | 159,270.80                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | MAPLETREE LOGISTICS TRUST                | 95,570    | 184,450.10                    |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST    | 71,100    | 68,611.50                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | QUE COMMERCIAL REIT                      | 78,800    | 29,550.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | PARKWAYLIFE REAL ESTATE                  | 12,900    | 53,535.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | SABANA SHARIAH COMP IND REIT             | 26,456    | 10,053.28                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | SASSEUR REIT                             | 16,700    | 13,694.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT            | 29,360    | 15,560.80                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | SPH REIT                                 | 33,000    | 27,390.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | STARHILL GLOBAL REIT                     | 45,800    | 23,816.00                     |  |
| 投資証券        | シンガポールドル | SUNTEC REIT                              | 72,700    | 108,323.00                    |  |
| シンガポールドル 小計 |          |                                          | 1,719,333 | 2,256,616.97<br>(179,085,122) |  |
| 投資証券        | 韓国ウォン    | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD              | 780       | 3,849,300.00                  |  |
| 投資証券        | 韓国ウォン    | JR REIT XXVII                            | 3,554     | 18,409,720.00                 |  |
| 投資証券        | 韓国ウォン    | LOTTE REIT CO LTD                        | 2,861     | 14,533,880.00                 |  |
| 投資証券        | 韓国ウォン    | MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTAT | 2,688     | 10,698,240.00                 |  |

|               |            |                           |        |                                  |  |
|---------------|------------|---------------------------|--------|----------------------------------|--|
| 投資証券          | 韓国ウォン      | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD | 1,410  | 10,011,000.00                    |  |
| 韓国ウォン 小計      |            |                           | 11,293 | 57,502,140.00<br>(5,479,953)     |  |
| 投資証券          | イスラエル・シェケル | REIT 1 LTD                | 5,923  | 92,398.80                        |  |
| イスラエル・シェケル 小計 |            |                           | 5,923  | 92,398.80<br>(2,985,405)         |  |
| 投資証券 合計       |            |                           |        | 4,643,964,285<br>(4,643,964,285) |  |
| 合計            |            |                           |        | 4,643,964,285<br>(4,643,964,285) |  |

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155銘柄 | 100.0%     | 74.0%      |
| カナダドル      | 投資証券 27銘柄 | 100.0%     | 1.9%       |
| ユーロ        | 投資証券 30銘柄 | 100.0%     | 4.8%       |
| 英ポンド       | 投資証券 33銘柄 | 100.0%     | 5.7%       |
| オーストラリアドル  | 投資証券 31銘柄 | 100.0%     | 7.3%       |
| ニュージーランドドル | 投資証券 5 銘柄 | 100.0%     | 0.5%       |
| 香港ドル       | 投資証券 6 銘柄 | 100.0%     | 1.7%       |
| シンガポールドル   | 投資証券 32銘柄 | 100.0%     | 3.9%       |
| 韓国ウォン      | 投資証券 5 銘柄 | 100.0%     | 0.1%       |
| 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】（2021年2月26日現在）

## しんきん世界アロケーションファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 15,690,618,441 円 |
| 負債総額           | 34,733,070 円     |
| 純資産総額（ — ）     | 15,655,885,371 円 |
| 発行済数量          | 14,221,452,746 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1009 円         |

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

## しんきん好配当利回り株マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 28,963,276,491 円 |
| 負債総額           | 6,001,201 円      |
| 純資産総額（ — ）     | 28,957,275,290 円 |
| 発行済数量          | 13,041,031,428 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.2205 円         |

## しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 25,148,568,581 円 |
| 負債総額           | 41,561,188 円     |
| 純資産総額（ — ）     | 25,107,007,393 円 |
| 発行済数量          | 10,349,365,007 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.4259 円         |

## しんきん国内債券マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 15,049,036,425 円 |
| 負債総額           | 1,763 円          |
| 純資産総額（ — ）     | 15,049,034,662 円 |
| 発行済数量          | 11,418,258,559 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3180 円         |

## しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 12,787,834,644 円 |
| 負債総額           | 1,948 円          |
| 純資産総額（ ― ）     | 12,787,832,696 円 |
| 発行済数量          | 7,559,065,133 口  |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6917 円         |

## しんきん米国ソブリン債マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 12,705,253,684 円 |
| 負債総額           | 1,844 円          |
| 純資産総額（ ― ）     | 12,705,251,840 円 |
| 発行済数量          | 7,517,874,858 口  |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.6900 円         |

## しんきん高格付外国債券マザーファンド

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 2,324,565,668 円 |
| 負債総額           | 103 円           |
| 純資産総額（ ― ）     | 2,324,565,565 円 |
| 発行済数量          | 1,694,175,855 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3721 円        |

## しんきんJリートマザーファンド

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 5,361,078,738 円 |
| 負債総額           | 30,000,393 円    |
| 純資産総額（ ― ）     | 5,331,078,345 円 |
| 発行済数量          | 2,094,183,541 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5457 円        |

## しんきんグローバルリートマザーファンド

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 4,719,684,955 円 |
| 負債総額           | 51 円            |
| 純資産総額（ ― ）     | 4,719,684,904 円 |
| 発行済数量          | 2,671,982,396 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.7664 円        |

## しんきん短期国内債券マザーファンド

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 80,565,647,742 円 |
| 負債総額           | 115,853 円        |
| 純資産総額（ ― ）     | 80,565,531,889 円 |
| 発行済数量          | 80,437,857,900 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0016 円         |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

（２）受益者名簿  
該当事項はありません。

（３）受益者に対する特典  
該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

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

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

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認め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）に支払います。

（８）質権口記載また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け、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

###### 商品企画体制

###### ・投資政策委員会

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

###### 運用体制

###### ・投資政策委員会

当委員会において、経済環境、資産別市場見通しならびに投資環境等を検討し、基本的な運用方針、運用戦略について協議し、委員長がこれを決定します。また、基本的な投資方針等に基づいて、ファンド運用についての具体的なガイドライン、方策を審議、決定するとともに、個別銘柄についての分析を行い、投資対象銘柄を選定します。経営管理部は、各ファンドの運用成績、ポートフォリオの運用内容等について考査し、当委員会に報告を行います。

###### ・コンプライアンス・運用管理委員会

当委員会において、事務局である経営管理部は、信託財産の運用リスク管理状況ならびに運用に関する法令・諸規則および諸決定事項の遵守状況等の報告を行います。また、トレーディング部は、取引先リスク等の報告を行います。

## コンプライアンス管理体制

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

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

上記の内容は、今後変更となる場合があります。

## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である当社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行います。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部および投資助言業務を行います。

当社の運用する証券投資信託は、2021年2月26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  | 84  | 863,854   |
| 単位型公社債投資信託 | 16  | 60,882    |
| 単位型株式投資信託  | 47  | 105,916   |
| 合計         | 147 | 1,030,653 |

（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（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表ならびに中間会計期間（2020年4月1日から2020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】

| 科 目      | 注記<br>番号 | 前事業年度<br>( 2019年3月31日現在 ) |           | 当事業年度<br>( 2020年3月31日現在 ) |           |
|----------|----------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
|          |          | 金 額                       |           | 金 額                       |           |
| (資産の部)   |          | 千円                        | 千円        | 千円                        | 千円        |
| 流動資産     |          |                           |           |                           |           |
| 現金・預金    | *2       |                           | 5,096,449 |                           | 6,105,781 |
| 前払費用     |          |                           | 22,449    |                           | 18,738    |
| 未収委託者報酬  |          |                           | 534,748   |                           | 472,704   |
| 未収運用受託報酬 | *2       |                           | 13,102    |                           | 7,811     |
| 未収収益     |          |                           | 49        |                           | 50        |
| その他の流動資産 |          |                           | 1,313     |                           | 2,890     |
| 流動資産計    |          |                           | 5,668,112 |                           | 6,607,976 |
| 固定資産     |          |                           |           |                           |           |
| 有形固定資産   | *1       |                           | 90,589    |                           | 82,167    |
| 建物       |          | 71,717                    |           | 64,512                    |           |
| 器具備品     |          | 18,871                    |           | 17,654                    |           |
| 無形固定資産   |          |                           | 26,964    |                           | 27,614    |
| ソフトウェア   |          | 25,565                    |           | 26,308                    |           |
| 電話加入権    |          | 959                       |           | 959                       |           |
| その他      |          | 439                       |           | 346                       |           |
| 投資その他の資産 |          |                           | 46,552    |                           | 44,757    |
| 投資有価証券   |          | 2,018                     |           | 2,479                     |           |
| 長期前払費用   |          | 4,870                     |           | 4,648                     |           |
| 繰延税金資産   |          | 39,662                    |           | 37,628                    |           |
| 固定資産計    |          |                           | 164,106   |                           | 154,539   |
| 資産合計     |          |                           | 5,832,218 |                           | 6,762,516 |

|                  |          | 前事業年度<br>( 2019年3月31日現在 ) |           | 当事業年度<br>( 2020年3月31日現在 ) |           |
|------------------|----------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
| 科 目              | 注記<br>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              |          |                           | 382,042   |                           | 348,153   |
| 未払手数料            | *2       | 319,565                   |           | 298,154                   |           |
| その他未払金           |          | 62,477                    |           | 49,999                    |           |
| 未払法人税等           |          |                           | 206,238   |                           | 236,742   |
| 未払消費税等           |          |                           | 38,518    |                           | 60,459    |
| 未払事業所税           |          |                           | 2,007     |                           | 2,020     |
| 賞与引当金            |          |                           | 71,011    |                           | 71,102    |
| その他の流動負債         |          |                           | 3,620     |                           | 4,016     |
| 流動負債計            |          |                           | 703,438   |                           | 722,494   |
| 固定負債             |          |                           |           |                           |           |
| 退職給付引当金          |          |                           | 102,601   |                           | 109,538   |
| 役員退職慰労引当金        |          |                           | 18,487    |                           | 17,951    |
| 固定負債計            |          |                           | 121,089   |                           | 127,489   |
| 負債合計             |          |                           | 824,528   |                           | 849,984   |
| (純資産の部)          |          | 千円                        | 千円        | 千円                        | 千円        |
| 株主資本             |          |                           | 5,007,677 |                           | 5,912,551 |
| 資本金              |          |                           | 200,000   |                           | 200,000   |
| 利益剰余金            |          |                           | 4,807,677 |                           | 5,712,551 |
| 利益準備金            |          | 2,000                     |           | 2,000                     |           |
| その他利益剰余金         |          | 4,805,677                 |           | 5,710,551                 |           |
| 別途積立金            |          | 3,830,000                 |           | 4,650,000                 |           |
| 繰越利益剰余金          |          | 975,677                   |           | 1,060,551                 |           |
| 評価・換算差額等         |          |                           | 13        |                           | 20        |
| その他有価証券評価差<br>額金 |          | 13                        |           | 20                        |           |
| 純資産合計            |          |                           | 5,007,690 |                           | 5,912,531 |
| 負債・純資産合計         |          |                           | 5,832,218 |                           | 6,762,516 |

## ( 2 ) 【損益計算書】

|             |          | 前事業年度<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 |           | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |           |
|-------------|----------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|
| 科 目         | 注記<br>番号 | 金 額                                   |           | 金 額                                   |           |
| 営業収益        |          | 千円                                    | 千円        | 千円                                    | 千円        |
| 委託者報酬       |          |                                       | 5,202,260 |                                       | 5,673,201 |
| 運用受託報酬      | *1       |                                       | 192,056   |                                       | 132,189   |
| 営業収益計       |          |                                       | 5,394,317 |                                       | 5,805,390 |
| 営業費用        |          |                                       |           |                                       |           |
| 支払手数料       | *1       |                                       | 2,566,470 |                                       | 2,798,780 |
| 広告宣伝費       |          |                                       | 32,074    |                                       | 37,672    |
| 調査費         |          |                                       | 555,537   |                                       | 590,453   |
| 調査研究費       |          | 375,631                               |           | 389,905                               |           |
| 委託調査費       |          | 179,906                               |           | 200,547                               |           |
| 営業雑経費       |          |                                       | 68,770    |                                       | 67,426    |
| 印刷費         |          | 61,381                                |           | 59,367                                |           |
| 郵便料         |          | 99                                    |           | 169                                   |           |
| 電信電話料       |          | 2,404                                 |           | 2,424                                 |           |
| 協会費         |          | 4,885                                 |           | 5,464                                 |           |
| 営業費用計       |          |                                       | 3,222,852 |                                       | 3,494,332 |
| 一般管理費       |          |                                       |           |                                       |           |
| 給料          |          |                                       | 578,701   |                                       | 587,623   |
| 役員報酬        |          | 41,693                                |           | 53,299                                |           |
| 給料・手当       |          | 385,731                               |           | 386,160                               |           |
| 賞与          |          | 67,757                                |           | 62,682                                |           |
| 法定福利費       |          | 75,923                                |           | 77,704                                |           |
| 福利厚生費       |          | 4,080                                 |           | 4,833                                 |           |
| その他給料       |          | 3,513                                 |           | 2,943                                 |           |
| 賞与引当金繰入     |          |                                       | 71,011    |                                       | 71,102    |
| 退職給付費用      |          |                                       | 64,269    |                                       | 62,160    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |          |                                       | 6,718     |                                       | 10,803    |
| 交際費         |          |                                       | 3,260     |                                       | 3,715     |
| 旅費交通費       |          |                                       | 9,400     |                                       | 10,463    |
| 租税公課        |          |                                       | 25,155    |                                       | 26,856    |
| 不動産賃借料      |          |                                       | 62,753    |                                       | 62,753    |
| 固定資産減価償却費   |          |                                       | 33,479    |                                       | 30,023    |
| 諸経費         |          |                                       | 135,925   |                                       | 131,389   |
| 一般管理費計      |          |                                       | 990,674   |                                       | 996,891   |
| 営業利益        |          |                                       | 1,180,790 |                                       | 1,314,166 |
| 営業外収益       |          |                                       |           |                                       |           |
| 受取利息        | *1       |                                       | 136       |                                       | 145       |
| 受取配当金       |          |                                       | -         |                                       | 17        |
| その他営業外収益    |          |                                       | 280       |                                       | 263       |
| 営業外収益計      |          |                                       | 416       |                                       | 426       |

|        |  |  |           |  |           |
|--------|--|--|-----------|--|-----------|
| 営業外費用  |  |  |           |  |           |
| 雑損失    |  |  | 904       |  | 938       |
| 営業外費用計 |  |  | 904       |  | 938       |
| 経常利益   |  |  | 1,180,302 |  | 1,313,653 |

|               |          | 前事業年度<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 |           | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |           |
|---------------|----------|---------------------------------------|-----------|---------------------------------------|-----------|
| 科 目           | 注記<br>番号 | 金 額                                   |           | 金 額                                   |           |
|               |          | 千円                                    | 千円        | 千円                                    | 千円        |
| 税引前当期純利益      |          |                                       | 1,180,302 |                                       | 1,313,653 |
| 法人税、住民税および事業税 |          |                                       | 365,355   |                                       | 406,739   |
| 法人税等調整額       |          |                                       | 4,600     |                                       | 2,040     |
| 当期純利益         |          |                                       | 819,547   |                                       | 904,874   |

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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<br>合計 |
|                         |         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益<br>剰余金<br>合計 |            |
|                         |         |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>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<br>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<br>評価差額金 | 評価・換算差額等<br>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<br>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 |

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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<br>合計 |
|                         |         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益<br>剰余金<br>合計 |            |
|                         |         |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |                 |            |
| 当期首残高                   | 200,000 | 2,000     | 3,830,000 | 975,677     | 4,807,677       | 5,007,677  |
| 当期変動額                   |         |           |           |             |                 |            |
| 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                | —       | —         | —         | —           | —               | —          |
| 当期純利益                   | —       | —         | —         | 904,874     | 904,874         | 904,874    |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | —       | —         | —         | —           | —               | —          |
| 当期変動額合計                 | —       | —         | 820,000   | 84,874      | 904,874         | 904,874    |
| 当期末残高                   | 200,000 | 2,000     | 4,650,000 | 1,060,551   | 5,712,551       | 5,912,551  |

|                         | 評価・換算差額等         |                | 純資産合計     |
|-------------------------|------------------|----------------|-----------|
|                         | その他有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算差額等<br>合計 |           |
| 当期首残高                   | 13               | 13             | 5,007,690 |
| 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                   | —                | —              | 904,874   |
| 株主資本以外の項目の当期<br>変動額（純額） | 33               | 33             | 33        |
| 当期変動額合計                 | 33               | 33             | 904,840   |
| 当期末残高                   | 20               | 20             | 5,912,531 |

## 重要な会計方針

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020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<br>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<br>(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<br>定額法を採用しております。<br>主な耐用年数は以下のとおりです。<br>建 物 3年 ～ 50年<br>器 具 備 品 3年 ～ 20年<br><br>(2)無形固定資産<br>定額法を採用しております。<br>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<br>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。<br><br>(2)退職給付引当金<br>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。<br>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。<br><br>(3)役員退職慰労引当金<br>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<br>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。<br>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。                                                                                                                                                                                            |

## 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<br>(2019年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2020年3月31日現在) |
|------|-------------------------|-------------------------|
| 建 物  | 63,831千円                | 70,422千円                |
| 器具備品 | 40,573千円                | 48,310千円                |

## \* 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<br>(2019年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2020年3月31日現在) |
|----------|-------------------------|-------------------------|
| 普通預金     | 3,907,610千円             | 4,911,204千円             |
| 定期預金     | 1,000,000千円             | 1,000,000千円             |
| 未収運用受託報酬 | 5,548千円                 | 2,655千円                 |
| 未払手数料    | 166,032千円               | 135,102千円               |

## （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<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 運用受託報酬 | 171,273千円                             | 123,017千円                             |
| 受取利息   | 134千円                                 | 143千円                                 |
| 支払手数料  | 2,086,194千円                           | 2,333,403千円                           |

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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      |

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 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 | —    |

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

2020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    | 6,105,781 | 6,105,781 | —  |
| (2)未収委託者報酬  | 472,704   | 472,704   | —  |
| (3)未収運用受託報酬 | 7,811     | 7,811     | —  |
| (4)投資有価証券   | 2,479     | 2,479     | —  |
| 資産計         | 6,588,776 | 6,588,776 | —  |
| (5)未払手数料    | 298,154   | 298,154   | —  |
| (6)その他未払金   | 49,999    | 49,999    | —  |
| (7)未払法人税等   | 236,742   | 236,742   | —  |
| (8)未払消費税等   | 60,459    | 60,459    | —  |
| (9)未払事業所税   | 2,020     | 2,020     | —  |
| 負債計         | 647,375   | 647,375   | —  |

### (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 | 6,105,476 | 6,105,476 | —   |

|             |           |           |   |
|-------------|-----------|-----------|---|
| (2)未収委託者報酬  | 472,704   | 472,704   | — |
| (3)未収運用受託報酬 | 7,811     | 7,811     | — |
| 合計          | 6,585,991 | 6,585,991 | — |

## （有価証券関係）

## １．その他有価証券

前事業年度（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<br>取得原価を超えるもの<br>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<br>取得原価を超えないもの<br>投資信託 | 986      | 1,000 | 13 |
| 小計                               | 986      | 1,000 | 13 |
| 合計                               | 2,018    | 2,000 | 18 |

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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<br>取得原価を超えるもの<br>投資信託  | 1,071    | 1,000 | 71 |
| 小計                               | 1,071    | 1,000 | 71 |
| 貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの<br>投資信託 | 1,408    | 1,500 | 91 |
| 小計                               | 1,408    | 1,500 | 91 |
| 合計                               | 2,479    | 2,500 | 20 |

## ２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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<br>(2019年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2020年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
|              | 千円                      | 千円                      |
| 退職給付引当金の期首残高 | 103,292                 | 102,601                 |
| 退職給付費用       | 14,918                  | 15,713                  |
| 退職給付の支払額     | 15,609                  | 8,777                   |
| 制度への拠出額      | —                       | —                       |
| 退職給付引当金の期末残高 | 102,601                 | 109,538                 |

### （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<br>(2019年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2020年3月31日現在) |
|---------------------|-------------------------|-------------------------|
|                     | 千円                      | 千円                      |
| 非積立型制度の退職給付債務       | 102,601                 | 109,538                 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 102,601                 | 109,538                 |
| 退職給付引当金             | 102,601                 | 109,538                 |
| 貸借対照表に計上された負債と資産の純額 | 102,601                 | 109,538                 |

### （３）退職給付費用

|                | 前事業年度<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
|                | 千円                                    | 千円                                    |
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 14,918                                | 15,713                                |

## 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 39,525千円、当事業年度 40,250千円であります。

|                   | 前事業年度<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|-------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| (１) 直近の積立状況に関する事項 | (2018年3月31日現在)                        | (2019年3月31日現在)                        |
|                   | 千円                                    | 千円                                    |

|                                      |                                                                                                                                            |                                                                                                                                            |
|--------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 年金資産の額                               | 1,669,710,596                                                                                                                              | 1,650,650,110                                                                                                                              |
| 年金財政計算上の数理債務の額と<br>最低責任準備金の額との合計額(注) | 1,806,457,984                                                                                                                              | 1,782,453,404                                                                                                                              |
| 差引額                                  | <u>136,747,387</u>                                                                                                                         | <u>131,803,293</u>                                                                                                                         |
| (2) 掛金に占める当社の拠出割合                    | (2018年3月分)<br>0.0676%                                                                                                                      | (2019年3月分)<br>0.0746%                                                                                                                      |
| (3) 補足説明                             | <p>上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高197,854,570千円および年金財政計算上の別途積立金61,107,182千円であります。</p> <p>本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。</p> | <p>上記(1)の差引額の主な要因は、年金財政計算上の過去の勤務債務残高180,752,834千円および年金財政計算上の別途積立金48,949,540千円であります。</p> <p>本制度における過去勤務債務の償却方法は、期間19年0か月の元利均等定率償却であります。</p> |

## （税効果会計関係）

## 1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

|                | 前事業年度<br>(2019年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2020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   | 21,743                  | 21,771                  |
| 役員退職慰労引当金      | 5,660                   | 5,496                   |
| 退職給付引当金繰入限度超過額 | 31,416                  | 33,540                  |
| 未払事業税          | 10,663                  | 12,019                  |
| 未払事業所税         | 614                     | 618                     |
| その他有価証券評価差額金   | —                       | 6                       |
| その他            | 3,174                   | 3,219                   |
| 繰延税金資産 小計      | 73,273                  | 76,671                  |
| 評価性引当額         | 33,605                  | 39,043                  |
| 繰延税金資産 合計      | 39,668                  | 37,628                  |
| 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      | 39,662                  | 37,628                  |

## 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## １．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## ２．関連情報

## （１）製品・サービスごとの情報

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

## （２）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## （３）主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称または氏名 | 営業収益    |
|------------|---------|
| 信金中央金庫     | 171,273 |

なお、営業収益の金額は、運用受託報酬について表示しております。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## １．セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## ２．関連情報

## （１）製品・サービスごとの情報

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

## （２）地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称または氏名 | 営業収益    |
|------------|---------|
| 信金中央金庫     | 123,017 |

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 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<br>百万円 | 信用金庫<br>連合会事業 | 直接<br>(被所有)<br>100% | 兼任1<br>人 | 証券投資<br>信託受益<br>証券の募<br>集販売 | 投資信託<br>の代行手<br>数料<br><br>運用受託<br>報酬<br><br>出向者<br>人件費<br><br>事務所<br>賃借料 | 2,086,194<br>千円<br><br>171,273<br>千円<br><br>111,204<br>千円<br><br>49,958<br>千円 | 未払<br>手数料 | 166,032<br>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<br>百万円 | 証券業   | —              | なし     | 証券投資<br>信託受益<br>証券の募<br>集販売 | 投資信託<br>の代行手<br>数料 | 445,847<br>千円 | 未払<br>手数料 | 90,195<br>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 2019年4月1日 至 2020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<br>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<br>運用受託報酬<br>出向者人件費<br>事務所賃借料 | 2,333,403<br>千円<br>123,017<br>千円<br>73,481<br>千円<br>49,958<br>千円 | 未払手数料 | 135,102<br>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<br>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 | 424,462<br>千円 | 未払手数料 | 85,994<br>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<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 1,251,922円67銭                         | 1,478,132円90銭                         |
| 1株当たり当期純利益金額 | 204,886円98銭                           | 226,218円53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<br>自 2018年4月 1日<br>至 2019年3月31日 | 当事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額        | 819,547千円                             | 904,874千円                             |
| 普通株主に帰属しない金額   | —千円                                   | —千円                                   |
| 普通株式に係る当期純利益金額 | 819,547千円                             | 904,874千円                             |
| 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<br>2020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                  |        | 6,369,593 |
| 前払費用                   |        | 31,093    |
| 未収委託者報酬                |        | 478,906   |
| 未収運用受託報酬               |        | 4,954     |
| 未収収益                   |        | 43        |
| その他の流動資産               |        | 2,837     |
| 流動資産計                  |        | 6,887,429 |
| 固定資産                   |        |           |
| 有形固定資産     * 1         |        | 74,611    |
| 建物                     | 61,062 |           |
| 器具備品                   | 13,549 |           |
| 無形固定資産                 |        | 24,740    |
| ソフトウェア                 | 23,405 |           |
| 電話加入権                  | 959    |           |
| その他                    | 374    |           |
| 投資その他の資産               |        | 33,620    |
| 投資有価証券                 | 1,375  |           |
| 長期前払費用                 | 3,652  |           |
| 繰延税金資産                 | 28,592 |           |
| 固定資産計                  |        | 132,972   |
| 資産合計                   |        | 7,020,402 |

| 当中間会計期間末<br>2020年9月30日 |           |           |
|------------------------|-----------|-----------|
| 科 目                    | 金 額       |           |
|                        | 千円        | 千円        |
| ( 負債の部 )               |           |           |
| 流動負債                   |           |           |
| 未払金                    |           | 348,464   |
| 未払手数料                  | 293,940   |           |
| その他未払金                 | 54,524    |           |
| 未払法人税等                 |           | 152,591   |
| 未払消費税等                 |           | 26,698    |
| 未払事業所税                 |           | 1,049     |
| 前受収益                   |           | 47,000    |
| 賞与引当金                  |           | 57,183    |
| その他の流動負債               |           | 3,852     |
| 流動負債計                  |           | 636,840   |
| 固定負債                   |           |           |
| 退職給付引当金                |           | 112,112   |
| 役員退職慰労引当金              |           | 27,955    |
| 固定負債計                  |           | 140,067   |
| 負債合計                   |           | 776,907   |
| ( 純資産の部 )              |           |           |
| 株主資本                   |           | 6,243,618 |
| 資本金                    |           | 200,000   |
| 利益剰余金                  |           | 6,043,618 |
| 利益準備金                  | 2,000     |           |
| その他利益剰余金               | 6,041,618 |           |
| 別途積立金                  | 5,560,000 |           |
| 繰越利益剰余金                | 481,618   |           |
| 評価・換算差額等               |           | 124       |
| その他有価証券評価差額金           | 124       |           |
| 純資産合計                  |           | 6,243,494 |
| 負債・純資産合計               |           | 7,020,402 |

## ( 2 ) 中間損益計算書

| 当中間会計期間<br>自 2020年4月 1日<br>至 2020年9月30日 |         |           |
|-----------------------------------------|---------|-----------|
| 科 目                                     | 金 額     |           |
|                                         | 千円      | 千円        |
| 営業収益                                    |         |           |
| 委託者報酬                                   |         | 2,500,993 |
| 運用受託報酬                                  |         | 49,702    |
| 営業収益計                                   |         | 2,550,695 |
| 営業費用                                    |         |           |
| 支払手数料                                   |         | 1,226,854 |
| 広告宣伝費                                   |         | 6,025     |
| 調査費                                     |         | 298,181   |
| 調査研究費                                   | 206,062 |           |
| 委託調査費                                   | 92,118  |           |
| 営業雑経費                                   |         | 32,947    |
| 印刷費                                     | 28,720  |           |
| 郵便料                                     | 74      |           |
| 電信電話料                                   | 1,379   |           |
| 協会費                                     | 2,772   |           |
| 営業費用計                                   |         | 1,564,009 |
| 一般管理費                                   |         |           |
| 給料                                      |         | 277,335   |
| 役員報酬                                    | 31,074  |           |
| 給料・手当                                   | 198,391 |           |
| 賞与                                      | 1,353   |           |
| 法定福利費                                   | 42,233  |           |
| 福利厚生費                                   | 4,281   |           |
| 賞与引当金繰入                                 |         | 57,183    |
| 退職給付費用                                  |         | 31,573    |
| 役員退職慰労引当金繰入                             |         | 10,003    |
| 交際費                                     |         | 345       |
| 旅費交通費                                   |         | 544       |
| 租税公課                                    |         | 11,569    |
| 不動産賃借料                                  |         | 31,514    |
| 固定資産減価償却費 * 1                           |         | 14,115    |
| 諸経費                                     |         | 69,113    |
| 一般管理費計                                  |         | 503,298   |
| 営業利益                                    |         | 483,387   |
| 営業外収益                                   |         |           |
| 受取利息                                    |         | 69        |
| 受取配当金                                   |         | 133       |
| その他営業外収益                                |         | 289       |
| 営業外収益計                                  |         | 492       |

|        |  |         |
|--------|--|---------|
| 営業外費用  |  |         |
| 雑損失    |  | 679     |
| 営業外費用計 |  | 679     |
| 経常利益   |  | 483,200 |

| 当中間会計期間<br>自 2020年4月 1日<br>至 2020年9月30日 |     |         |
|-----------------------------------------|-----|---------|
| 科 目                                     | 金 額 |         |
|                                         | 千円  | 千円      |
| 税引前中間純利益                                |     | 483,200 |
| 法人税、住民税および事業税                           |     | 143,096 |
| 法人税等調整額                                 |     | 9,036   |
| 中間純利益                                   |     | 331,067 |

## ( 3 ) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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<br>合計 |
|                           |         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             | 利益<br>剰余金<br>合計 |            |
|                           |         |           | 別途<br>積立金 | 繰越利益<br>剰余金 |                 |            |
| 当期首残高                     | 200,000 | 2,000     | 4,650,000 | 1,060,551   | 5,712,551       | 5,912,551  |
| 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                  | —       | —         | 910,000   | 910,000     | —               | —          |
| 別途積立金の取崩                  | —       | —         | —         | —           | —               | —          |
| 中間純利益                     | —       | —         | —         | 331,067     | 331,067         | 331,067    |
| 株主資本以外の項目の当中<br>間期変動額（純額） | —       | —         | —         | —           | —               | —          |
| 当中間期変動額合計                 | —       | —         | 910,000   | 578,932     | 331,067         | 331,067    |
| 当中間期末残高                   | 200,000 | 2,000     | 5,560,000 | 481,618     | 6,043,618       | 6,243,618  |

|                           | 評価・換算差額等         |                | 純資産合計     |
|---------------------------|------------------|----------------|-----------|
|                           | その他有価証券<br>評価差額金 | 評価・換算差額等<br>合計 |           |
| 当期首残高                     | 20               | 20             | 5,912,531 |
| 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                     | —                | —              | 331,067   |
| 株主資本以外の項目の当中間期変<br>動額（純額） | 104              | 104            | 104       |
| 当中間期変動額合計                 | 104              | 104            | 330,962   |
| 当中間期末残高                   | 124              | 124            | 6,243,494 |

## 重要な会計方針

| 項 目                                                                                                      | 当中間会計期間<br>自 2020年4月 1日<br>至 2020年9月30日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 有価証券の評価基準および評価方法</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>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</p> | <p>その他有価証券<br/>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）</p> <p>(1)有形固定資産<br/>定額法を採用しております。<br/>主な耐用年数は以下のとおりです。<br/>建 物 3年～50年<br/>器具備品 3年～20年</p> <p>(2)無形固定資産<br/>定額法を採用しております。<br/>なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づいております。</p> <p>(1)賞与引当金<br/>従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。</p> <p>(2)退職給付引当金<br/>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。<br/>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。</p> <p>(3)役員退職慰労引当金<br/>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。</p> <p>消費税等の会計処理<br/>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。<br/>なお、仮払消費税等および仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。</p> |

## 注記事項

## （中間貸借対照表関係）

| 項 目                | 当中間会計期間末<br>2020年9月30日 |          |
|--------------------|------------------------|----------|
| * 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 建物                     | 73,677千円 |
|                    | 器具備品                   | 44,203千円 |

## （中間損益計算書関係）

| 項 目         | 当中間会計期間<br>自 2020年4月 1日<br>至 2020年9月30日 |         |
|-------------|-----------------------------------------|---------|
| * 1 減価償却実施額 | 有形固定資産                                  | 7,555千円 |
|             | 無形固定資産                                  | 6,559千円 |

## （中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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（2020年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020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    | 6,369,593  | 6,369,593 | —  |
| (2)未収委託者報酬  | 478,906    | 478,906   | —  |
| (3)未収運用受託報酬 | 4,954      | 4,954     | —  |
| (4)投資有価証券   | 1,375      | 1,375     | —  |
| 資産計         | 6,854,829  | 6,854,829 | —  |
| (5)未払手数料    | 293,940    | 293,940   | —  |
| (6)その他未払金   | 54,524     | 54,524    | —  |
| (7)未払法人税等   | 152,591    | 152,591   | —  |
| (8)未払消費税等   | 26,698     | 26,698    | —  |
| (9)未払事業所税   | 1,049      | 1,049     | —  |
| 負債計         | 528,804    | 528,804   | —  |

## （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（2020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<br>投資信託  | 552        | 500   | 52  |
| 小計                             | 552        | 500   | 52  |
| 中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの<br>投資信託 | 823        | 1,000 | 176 |
| 小計                             | 823        | 1,000 | 176 |
| 合計                             | 1,375      | 1,500 | 124 |

## （セグメント情報等）

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020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

## 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。

## 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    | 45,198 |

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<br>自 2020年4月 1日<br>至 2020年9月30日      |               |
|----------------------------------------------|---------------|
| 1株当たり純資産額                                    | 1,560,873円56銭 |
| 1株当たり中間純利益                                   | 82,766円79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                                        | 331,067千円     |
| 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                                 | 331,067千円     |
| 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（2020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（2020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（2020年3月末現在）
- ・事業の内容  
銀行業および信託業務を営んでいます。

#### （参考）マザーファンドの投資顧問会社の概要

しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

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

しんきんグローバルリートマザーファンド

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

### 2【関係業務の概要】

- (1) 信金中央金庫（販売会社）  
委託会社の指定する登録金融機関として、当該受益権の募集の取扱い、償還金等の支払を行います。
- (2) 三菱UFJ信託銀行株式会社（受託会社）  
投資信託財産の保管・管理業務を行い、分配金、解約金および償還金の委託会社への交付等を行います。

### 3【資本関係】

信金中央金庫は、委託会社の発行済株式総数4,000株を全て保有します。

### 第3【その他】

#### 1 目論見書の表紙および裏表紙の記載等について

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

#### 2 目論見書の表紙裏の記載について

次の事項を記載することがあります。

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

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

#### 4 請求目論見書に投資信託約款の全文を記載します。

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

## 独立監査人の監査報告書

2020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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員 公認会計士 小松崎 謙 印

### 監査意見

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。

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2020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、全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。

### 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

### 財務諸表に対する経営者並びに監査役の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
  - ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。
- 監査人は、監査役に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の監査報告書

2021年3月31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

東京事務所

指定有限責任社員

公認会計士 大畑 茂

業務執行社員

## 監査意見

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の2020年2月15日から2021年2月15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。

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の2021年2月15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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 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

2020年12月14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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員 公認会計士 小松崎 謙 印

#### 中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第31期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020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。

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2020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（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

#### 中間財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、

重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

- ・ 中間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、監査人は、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。
- ・ 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。