

## 【表紙】

|            |                                        |
|------------|----------------------------------------|
| 【提出書類】     | 半期報告書                                  |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                                |
| 【提出日】      | 2021年11月12日                            |
| 【計算期間】     | 第9期中（自 2021年2月16日 至 2021年8月15日）        |
| 【ファンド名】    | 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)） |
| 【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 花岡 隆司                          |
| 【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                                   |
| 【連絡場所】     | 東京都中央区京橋三丁目8番1号                        |
| 【電話番号】     | 03 - 5524 - 8161                       |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                            |

## 1【ファンドの運用状況】

以下は2021年8月31日現在の運用状況です。

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

投資比率の内訳と合計は、端数処理の関係で一致しない場合があります。

## (1)【投資状況】

| 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   | 14,503,328,299 | 98.56   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 212,597,267    | 1.44    |
| 合計(純資産総額)           |      | 14,715,925,566 | 100.00  |

## (2)【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 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        | —      |
| 3月末日                 | 15,600,763,230 | —              | 11,215        | —      |
| 4月末日                 | 15,420,080,886 | —              | 11,265        | —      |
| 5月末日                 | 15,368,885,027 | —              | 11,334        | —      |
| 6月末日                 | 15,133,343,709 | —              | 11,380        | —      |
| 7月末日                 | 14,931,364,330 | —              | 11,412        | —      |
| 8月末日                 | 14,715,925,566 | —              | 11,419        | —      |

## 【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   |
| 第9期（中間） | 2021年 2月16日～2021年 8月15日 | 3.33   |

（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。

## （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   | 28,571,440,200 | 99.21   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 228,372,763    | 0.79    |
| 合計(純資産総額)           |      | 28,799,812,963 | 100.00  |

## 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    | 6,470,117,732  | 27.06   |
|                     | ドイツ     | 2,063,493,418  | 8.63    |
|                     | イタリア    | 1,647,884,033  | 6.89    |
|                     | フランス    | 2,083,235,411  | 8.71    |
|                     | オランダ    | 432,191,691    | 1.81    |
|                     | スペイン    | 677,872,677    | 2.84    |
|                     | ベルギー    | 514,509,530    | 2.15    |
|                     | イギリス    | 7,620,644,455  | 31.87   |
|                     | オーストラリア | 688,951,162    | 2.88    |
|                     | シンガポール  | 448,385,493    | 1.88    |
|                     | 小計      | 22,647,285,602 | 94.72   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —       | 1,263,363,208  | 5.28    |
| 合計(純資産総額)           |         | 23,910,648,810 | 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 | —    | 20,522,434 | 0.09    |
|        | 売建 | —    | 20,508,288 | 0.09    |

(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   | 11,359,680,600 | 79.77   |
| 地方債証券               | 日本   | 1,411,984,000  | 9.92    |
| 特殊債券                | 日本   | 201,678,000    | 1.42    |
| 社債券                 | 日本   | 1,109,216,000  | 7.79    |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 157,154,611    | 1.10    |
| 合計(純資産総額)           |      | 14,239,713,211 | 100.00  |

## 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    | 2,877,338,861  | 21.95   |
|                     | フランス   | 4,301,663,019  | 32.82   |
|                     | オランダ   | 963,353,013    | 7.35    |
|                     | スペイン   | 2,490,591,003  | 19.00   |
|                     | ベルギー   | 1,355,825,741  | 10.35   |
|                     | オーストリア | 922,963,941    | 7.04    |
|                     | 小計     | 12,911,735,578 | 98.52   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 194,182,994    | 1.48    |
| 合計(純資産総額)           |        | 13,105,918,572 | 100.00  |

## 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   | 11,473,062,433 | 86.65   |
| 特殊債券                | 国際機関   | 1,629,721,650  | 12.31   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 138,416,575    | 1.05    |
| 合計(純資産総額)           |        | 13,241,200,658 | 100.00  |

## 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     | 228,943,217 | 9.85    |
|       | イギリス    | 254,904,063 | 10.97   |
|       | ノルウェー   | 410,448,298 | 17.66   |
|       | 小計      | 894,295,578 | 38.47   |
| 地方債証券 | カナダ     | 255,505,549 | 10.99   |
|       | オーストラリア | 567,372,586 | 24.41   |
|       | 小計      | 822,878,135 | 35.40   |
| 特殊債券  | カナダ     | 91,144,565  | 3.92    |
|       | 国際機関    | 481,131,683 | 20.70   |

|                     |    |               |        |
|---------------------|----|---------------|--------|
|                     | 小計 | 572,276,248   | 24.62  |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —  | 34,971,629    | 1.50   |
| 合計(純資産総額)           |    | 2,324,421,590 | 100.00 |

## しんきん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   | 5,484,205,850 | 98.20   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —    | 100,456,989   | 1.80    |
| 合計(純資産総額)           |      | 5,584,662,839 | 100.00  |

## 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     | 3,577,462,606 | 74.75   |
|                     | カナダ      | 92,499,617    | 1.93    |
|                     | ドイツ      | 13,711,407    | 0.29    |
|                     | イタリア     | 762,795       | 0.02    |
|                     | フランス     | 106,202,910   | 2.22    |
|                     | オランダ     | 8,542,916     | 0.18    |
|                     | スペイン     | 21,448,275    | 0.45    |
|                     | ベルギー     | 68,154,917    | 1.42    |
|                     | アイルランド   | 5,529,595     | 0.12    |
|                     | イギリス     | 281,701,840   | 5.89    |
|                     | オーストラリア  | 324,526,507   | 6.78    |
|                     | ニュージーランド | 20,356,965    | 0.43    |
|                     | 香港       | 72,933,884    | 1.52    |
|                     | シンガポール   | 165,954,513   | 3.47    |
|                     | 韓国       | 8,417,172     | 0.18    |
|                     | イスラエル    | 3,154,575     | 0.07    |
|                     | 小計       | 4,771,360,494 | 99.69   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —        | 14,684,758    | 0.31    |
| 合計(純資産総額)           |          | 4,786,045,252 | 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 | — | 9,903,966 | 0.21 |
|--------|----|---|-----------|------|

(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     | 50,791,426,460 | 59.52   |
| 特殊債券                | 日本     | 17,811,634,670 | 20.87   |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | —      | 16,736,131,010 | 19.61   |
| 合計(純資産総額)           |        | 85,339,192,140 | 100.00  |

## 2【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 |
| 第9期（中間） | 2021年 2月16日～2021年 8月15日 | 261,715,929    | 1,613,258,704 |

(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。

### 3【ファンドの経理状況】

- 1．当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- 2．当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間（2021年2月16日から2021年8月15日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表  
しんきん世界アロケーションファンド  
( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位：円 )

|                     | 前計算期間末<br>( 2021年 2 月15日現在 ) | 当中間計算期間末<br>( 2021年 8 月15日現在 ) |
|---------------------|------------------------------|--------------------------------|
| <b>資産の部</b>         |                              |                                |
| 流動資産                |                              |                                |
| 金銭信託                | -                            | 164,335,262                    |
| コール・ローン             | 467,434,551                  | 290,318,438                    |
| 親投資信託受益証券           | 15,551,815,642               | 14,505,395,174                 |
| 流動資産合計              | 16,019,250,193               | 14,960,048,874                 |
| 資産合計                | 16,019,250,193               | 14,960,048,874                 |
| <b>負債の部</b>         |                              |                                |
| 流動負債                |                              |                                |
| 未払解約金               | 57,753,387                   | 23,419,781                     |
| 未払受託者報酬             | 4,609,670                    | 4,191,700                      |
| 未払委託者報酬             | 92,193,394                   | 83,834,025                     |
| 未払利息                | 1,193                        | 2,476                          |
| その他未払費用             | 882                          | 1,436                          |
| 流動負債合計              | 154,558,526                  | 111,449,418                    |
| 負債合計                | 154,558,526                  | 111,449,418                    |
| <b>純資産の部</b>        |                              |                                |
| 元本等                 |                              |                                |
| 元本                  | 1, 2 14,346,869,864          | 1, 2 12,995,327,089            |
| 剰余金                 |                              |                                |
| 中間剰余金又は中間欠損金 (    ) | 1,517,821,803                | 1,853,272,367                  |
| ( 分配準備積立金 )         | 221,607,146                  | 199,313,418                    |
| 元本等合計               | 15,864,691,667               | 14,848,599,456                 |
| 純資産合計               | 15,864,691,667               | 14,848,599,456                 |
| 負債純資産合計             | 16,019,250,193               | 14,960,048,874                 |

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 前中間計算期間<br>(自 2020年 2月15日<br>至 2020年 8月14日) | 当中間計算期間<br>(自 2021年 2月16日<br>至 2021年 8月15日) |
|-------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                             |                                             |
| 有価証券売買等損益                                 | 744,155,075                                 | 589,579,532                                 |
| 営業収益合計                                    | 744,155,075                                 | 589,579,532                                 |
| 営業費用                                      |                                             |                                             |
| 支払利息                                      | 132,600                                     | 148,787                                     |
| 受託者報酬                                     | 4,932,409                                   | 4,191,700                                   |
| 委託者報酬                                     | 1 98,648,129                                | 1 83,834,025                                |
| その他費用                                     | 90,322                                      | 20,143                                      |
| 営業費用合計                                    | 103,803,460                                 | 88,194,655                                  |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 847,958,535                                 | 501,384,877                                 |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 847,958,535                                 | 501,384,877                                 |
| 中間純利益又は中間純損失（ ）                           | 847,958,535                                 | 501,384,877                                 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ） | 66,920,269                                  | 30,392,818                                  |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 2,579,874,027                               | 1,517,821,803                               |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 32,315,913                                  | 32,959,014                                  |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 32,315,913                                  | 32,959,014                                  |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 217,129,992                                 | 168,500,509                                 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 217,129,992                                 | 168,500,509                                 |
| 分配金                                       | -                                           | -                                           |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ）                           | 1,614,021,682                               | 1,853,272,367                               |

## （３）【中間注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                 |                                                   |
|-----------------|---------------------------------------------------|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券<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。 |
|-----------------|---------------------------------------------------|

## （中間貸借対照表に関する注記）

| 区分                                  | 前計算期間末<br>(2021年2月15日現在)                                                             | 当中間計算期間末<br>(2021年8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>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 | 期首元本額<br>14,346,869,864円<br>期中追加設定元本額<br>261,715,929円<br>期中一部解約元本額<br>1,613,258,704円 |
| 2 中間計算期間末日における受益権の総数                | 14,346,869,864口                                                                      | 12,995,327,089口                                                                      |

## （中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

| 前中間計算期間<br>(自 2020年2月15日<br>至 2020年8月14日)                                                                                                                                                                                                               | 当中間計算期間<br>(自 2021年2月16日<br>至 2021年8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。</p> <p>「しんきんグローバルリートマザーファンド」の純資産総額のうち当ファンドに帰属する部分に対して、年率0.5%以下を乗じた金額を委託者報酬の中から支弁しております。</p> | <p>1 当信託財産の主要投資対象である親投資信託において、信託財産の運用の指図に係わる権限の全部又は一部を委託するために要する費用</p> <p>同左</p> |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 前計算期間末<br>(2021年2月15日現在)                                                                                                                                                                              | 当中間計算期間末<br>(2021年8月15日現在)                                                                |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額     | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                               | 同左                                                                                        |
| 2. 時価の算定方法                 | <p>(1) 有価証券<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                                                                                        |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

| 前計算期間末<br>(2021年2月15日現在) | 当中間計算期間末<br>(2021年8月15日現在) |
|--------------------------|----------------------------|
| 該当事項はありません。              | 同左                         |

## （1口当たり情報）

| 前計算期間末<br>(2021年2月15日現在)                  | 当中間計算期間末<br>(2021年8月15日現在)                |
|-------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 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) | 1口当たり純資産額 1.1426円<br>(1万口当たり純資産額 11,426円) |

## （参考情報）

当ファンドは、「しんきん好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」、「しんきん国内債券マザーファンド」、「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」、「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」、「しんきん高格付外国債券マザーファンド」、「しんきんJリートマザーファンド」及び「しんきんグローバルリートマザーファンド」受益証券を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次のとおりであります。

「しんきん好配当利回り株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

## しんきん好配当利回り株マザーファンド

## （１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 金銭信託        |          | 32,209,425     |
| コール・ローン     |          | 56,901,907     |
| 株式          |          | 29,004,481,410 |
| 未収配当金       |          | 68,865,900     |
| 流動資産合計      |          | 29,162,458,642 |
| 資産合計        |          | 29,162,458,642 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払解約金       |          | 4,000,000      |
| 未払利息        |          | 161            |
| その他未払費用     |          | 789            |
| 流動負債合計      |          | 4,000,950      |
| 負債合計        |          | 4,000,950      |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 12,189,268,117 |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 16,969,189,575 |
| 元本等合計       |          | 29,158,457,692 |
| 純資産合計       |          | 29,158,457,692 |
| 負債純資産合計     |          | 29,162,458,642 |

## （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 8 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>13,175,781,287円<br>期中追加設定元本額<br>539,748,874円<br>期中一部解約元本額<br>1,526,262,044円                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 元本の内訳                                 | しんきん 3 資産ファンド（毎月決算型）<br>8,741,521,564円<br>しんきん好配当利回り株ファンド（3 ヶ月決算型）<br>1,169,503,772円<br>しんきんグローバル 6 資産ファンド（毎月決算型）<br>1,141,653,985円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>249,295,717円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>485,738,221円<br>しんきん 3 資産ファンド（1 年決算型）<br>228,211,616円<br>しんきんグローバル 6 資産ファンド（1 年決算型）<br>73,901,304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>99,441,938円<br>合計 12,189,268,117円 |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 12,189,268,117口                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 2021年 8 月15日現在                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                            |
| 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。                                                                              |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|                |
|----------------|
| 2021年 8 月15日現在 |
| 該当事項はありません。    |

## （1口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年 8 月15日現在       |
| 1口当たり純資産額 2,392円     |
| (1万口当たり純資産額 23,921円) |

「しんきん世界好配当利回り株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

### しんきん世界好配当利回り株マザーファンド

#### （１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 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          |          | 229,336,137    |
| 金銭信託        |          | 64,061,681     |
| コール・ローン     |          | 113,172,832    |
| 株式          |          | 23,737,701,817 |
| 未収入金        |          | 17,941,968     |
| 未収配当金       |          | 44,974,171     |
| 流動資産合計      |          | 24,207,188,606 |
| 資産合計        |          | 24,207,188,606 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 派生商品評価勘定    |          | 5,153          |
| 未払金         |          | 68,619,090     |
| 未払利息        |          | 321            |
| その他未払費用     |          | 853            |
| 流動負債合計      |          | 68,625,417     |
| 負債合計        |          | 68,625,417     |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 8,762,255,219  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 15,376,307,970 |
| 元本等合計       |          | 24,138,563,189 |
| 純資産合計       |          | 24,138,563,189 |
| 負債純資産合計     |          | 24,207,188,606 |

## ( 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中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。                                                                                                                               |
| 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 8 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>10,393,090,430円<br>期中追加設定元本額<br>179,738,825円<br>期中一部解約元本額<br>1,810,574,036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>6,777,293,078円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）<br>988,999,268円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>267,681,497円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>423,099,182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>239,869,481円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）<br>65,312,713円<br>合計 8,762,255,219円 |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 8,762,255,219口                                                                                                                                                                                                                                                                  |

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                         | 2021年 8月15日現在                                                                                                                                                                                                         |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                                               |
| 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。             |

(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 8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     | 10,560,833 | —     | 10,555,916 | 4,917   |
|               | 米ドル    | 10,560,833 | —     | 10,555,916 | 4,917   |
|               | 売建     | 10,560,833 | —     | 10,561,069 | 236     |
|               | ユーロ    | 10,560,833 | —     | 10,561,069 | 236     |
| 合計            |        | 21,121,666 | —     | 21,116,985 | 5,153   |

(注) 時価の算定方法

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

(1口当たり情報)

|               |
|---------------|
| 2021年 8月15日現在 |
|---------------|

|                      |
|----------------------|
| 1口当たり純資産額 2.7548円    |
| （1万口当たり純資産額 27,548円） |

「しんきん国内債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

### しんきん国内債券マザーファンド

#### （１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 金銭信託        |          | 38,637,381     |
| コール・ローン     |          | 68,257,683     |
| 国債証券        |          | 11,361,067,200 |
| 地方債証券       |          | 1,412,264,000  |
| 特殊債券        |          | 201,692,000    |
| 社債券         |          | 1,109,413,000  |
| 未収利息        |          | 25,798,077     |
| 前払費用        |          | 815,415        |
| 流動資産合計      |          | 14,217,944,756 |
| 資産合計        |          | 14,217,944,756 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 194            |
| その他未払費用     |          | 1,309          |
| 流動負債合計      |          | 1,503          |
| 負債合計        |          | 1,503          |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 10,626,484,749 |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 3,591,458,504  |
| 元本等合計       |          | 14,217,943,253 |
| 純資産合計       |          | 14,217,943,253 |
| 負債純資産合計     |          | 14,217,944,756 |

## ( 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 8 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 11,365,150,678円</p> <p>期中追加設定元本額 1,091,702,648円</p> <p>期中一部解約元本額 1,830,368,577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） 2,048,001,891円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド 7,603,429,169円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 845,438,826円</p> <p>しんきんグローバル6 資産ファンド（1年決算型） 129,614,863円</p> <p>合計 10,626,484,749円</p> |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 10,626,484,749口                                                                                                                                                                                          |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 2021年 8 月15日現在                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                            |
| 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。                                                                              |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|                |
|----------------|
| 2021年 8 月15日現在 |
| 該当事項はありません。    |

## （1口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年 8 月15日現在       |
| 1口当たり純資産額 1.3380円    |
| (1万口当たり純資産額 13,380円) |

「しんきん欧州ソブリン債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

### しんきん欧州ソブリン債マザーファンド

#### （１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 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          |          | 68,944,806     |
| 金銭信託        |          | 8,868,829      |
| コール・ローン     |          | 15,667,877     |
| 国債証券        |          | 13,019,590,243 |
| 未収利息        |          | 92,511,355     |
| 前払費用        |          | 1,343,633      |
| 流動資産合計      |          | 13,206,926,743 |
| 資産合計        |          | 13,206,926,743 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払解約金       |          | 4,000,000      |
| 未払利息        |          | 44             |
| その他未払費用     |          | 206            |
| 流動負債合計      |          | 4,000,250      |
| 負債合計        |          | 4,000,250      |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 7,618,052,291  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 5,584,874,202  |
| 元本等合計       |          | 13,202,926,493 |
| 純資産合計       |          | 13,202,926,493 |
| 負債純資産合計     |          | 13,206,926,743 |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 8 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</p> <p>7,322,270,843円</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>483,458,619円</p> <p>期中一部解約元本額</p> <p>187,677,171円</p> |

|       |                                               |                |
|-------|-----------------------------------------------|----------------|
| 元本の内訳 | 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           | 162,526,225円   |
|       | 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           | 157,926,302円   |
|       | しんきん3資産ファンド（毎月決算型）                            | 6,000,565,868円 |
|       | しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）                       | 521,100,559円   |
|       | しんきん世界アロケーションファンド                             | 326,901,316円   |
|       | しんきん世界アロケーションファンド（積極型）                        | 261,485,038円   |
|       | しんきん3資産ファンド（1年決算型）                            | 154,179,530円   |
|       | しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）                       | 33,367,453円    |
|       | 合計                                            | 7,618,052,291円 |
|       | 2 本報告書における開示対象<br>ファンドの中間計算期間末日<br>における受益権の総数 | 7,618,052,291口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 2021年8月15日現在                                                                                                                                                                                          |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                               |
| 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。                                                                                 |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|              |
|--------------|
| 2021年8月15日現在 |
| 該当事項はありません。  |

## （1口当たり情報）

|                   |
|-------------------|
| 2021年8月15日現在      |
| 1口当たり純資産額 1.7331円 |

|                        |
|------------------------|
| ( 1 万口当たり純資産額 17,331円) |
|------------------------|

## 「しんきん米国ソブリン債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

## しんきん米国ソブリン債マザーファンド

## ( 1 ) 貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 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          |          | 43,667,418     |
| 金銭信託        |          | 10,692,197     |
| コール・ローン     |          | 18,889,079     |
| 国債証券        |          | 11,439,933,570 |
| 特殊債券        |          | 1,631,286,423  |
| 未収利息        |          | 96,744,374     |
| 前払費用        |          | 2,953,906      |
| 流動資産合計      |          | 13,244,166,967 |
| 資産合計        |          | 13,244,166,967 |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払解約金       |          | 2,000,000      |
| 未払利息        |          | 53             |
| その他未払費用     |          | 160            |
| 流動負債合計      |          | 2,000,213      |
| 負債合計        |          | 2,000,213      |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 7,423,334,895  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 5,818,831,859  |
| 元本等合計       |          | 13,242,166,754 |
| 純資産合計       |          | 13,242,166,754 |
| 負債純資産合計     |          | 13,244,166,967 |

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

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

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                  | 2021年 8 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          |
|                                     | 7,300,298,643円 |
|                                     | 期中追加設定元本額      |
|                                     | 336,155,091円   |
|                                     | 期中一部解約元本額      |
|                                     | 213,118,839円   |

|       |                                               |                |
|-------|-----------------------------------------------|----------------|
| 元本の内訳 | 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           | 199,769,099円   |
|       | 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           | 153,504,557円   |
|       | しんきん3資産ファンド（毎月決算型）                            | 5,795,207,438円 |
|       | しんきんグローバル6資産ファンド（毎月決算型）                       | 518,466,005円   |
|       | しんきん世界アロケーションファンド                             | 319,072,700円   |
|       | しんきん世界アロケーションファンド（積極型）                        | 254,947,668円   |
|       | しんきん3資産ファンド（1年決算型）                            | 150,208,090円   |
|       | しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）                       | 32,159,338円    |
|       | 合計                                            | 7,423,334,895円 |
|       | 2 本報告書における開示対象<br>ファンドの中間計算期間末<br>日における受益権の総数 | 7,423,334,895口 |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 2021年8月15日現在                                                                                                                                                                                          |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                               |
| 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。                                                                                 |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|              |
|--------------|
| 2021年8月15日現在 |
| 該当事項はありません。  |

## （1口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年8月15日現在         |
| 1口当たり純資産額 1.7839円    |
| （1万口当たり純資産額 17,839円） |



「しんきん高格付外国債券マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

## 財務諸表

### しんきん高格付外国債券マザーファンド

#### （１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 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          |          | 3,924,001      |
| 金銭信託        |          | 5,972,200      |
| コール・ローン     |          | 10,550,624     |
| 国債証券        |          | 892,456,461    |
| 地方債証券       |          | 816,915,706    |
| 特殊債券        |          | 573,314,177    |
| 未収利息        |          | 13,505,238     |
| 前払費用        |          | 818,344        |
| 流動資産合計      |          | 2,317,456,751  |
| 資産合計        |          | 2,317,456,751  |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 30             |
| その他未払費用     |          | 80             |
| 流動負債合計      |          | 110            |
| 負債合計        |          | 110            |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 1,651,128,720  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 666,327,921    |
| 元本等合計       |          | 2,317,456,641  |
| 純資産合計       |          | 2,317,456,641  |
| 負債純資産合計     |          | 2,317,456,751  |

## ( 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中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>                                                                                                                               |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

## ( 貸借対照表に関する注記 )

| 区分                                    | 2021年 8 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 1,695,625,341円</p> <p>期中追加設定元本額 12,259,791円</p> <p>期中一部解約元本額 56,756,412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 201,408,896円</p> <p>しんきん世界アロケーションファンド（積極型） 161,069,885円</p> <p>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型） 40,876,033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） 616,549,490円</p> <p>合計 1,651,128,720円</p> |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 1,651,128,720口                                                                                                                                                                                                                                   |

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                        | 2021年 8 月15日現在                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．貸借対照表計上額、時価及びその差額       | 時価で計上しているため、その差額はあります。                                                                                                                                                                             |
| 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。                                                                              |

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|                |
|----------------|
| 2021年 8 月15日現在 |
| 該当事項はありません。    |

## （1口当たり情報）

|                      |
|----------------------|
| 2021年 8 月15日現在       |
| 1口当たり純資産額 1.4036円    |
| （1万口当たり純資産額 14,036円） |

「しんきん」リートマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は、監査法人による監査の対象外であります。

財務諸表

しんきん」リートマザーファンド

（１）貸借対照表

| 区分          |          | 2021年 8 月15日現在 |
|-------------|----------|----------------|
| 科目          | 注記<br>番号 | 金額（円）          |
| 資産の部        |          |                |
| 流動資産        |          |                |
| 金銭信託        |          | 9,163,714      |
| コール・ローン     |          | 16,188,826     |
| 投資証券        |          | 5,461,829,850  |
| 未収配当金       |          | 35,071,240     |
| 流動資産合計      |          | 5,522,253,630  |
| 資産合計        |          | 5,522,253,630  |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払金         |          | 9,313,727      |
| 未払利息        |          | 46             |
| その他未払費用     |          | 110            |
| 流動負債合計      |          | 9,313,883      |
| 負債合計        |          | 9,313,883      |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 1,931,466,268  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 3,581,473,479  |
| 元本等合計       |          | 5,512,939,747  |
| 純資産合計       |          | 5,512,939,747  |
| 負債純資産合計     |          | 5,522,253,630  |

## （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 8 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>2,117,254,107円<br>期中追加設定元本額<br>229,997,854円<br>期中一部解約元本額<br>415,785,693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>962,584,024円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>326,518,599円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>393,591,052円<br>しんきん3資産ファンド（1年決算型）<br>187,206,806円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）<br>61,565,787円<br>合計 1,931,466,268円 |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 1,931,466,268口                                                                                                                                                                                                              |

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                    | 2021年 8 月15日現在                                                                                                                                                                           |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1 . 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているため、その差額はありません。                                                                                                                                                                  |
| 2 . 時価の算定方法           | (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。<br><br>(2)デリバティブ取引<br>該当事項はありません。<br><br>(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。 |

|                           |                                                                                                                       |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|                |
|----------------|
| 2021年 8 月15日現在 |
| 該当事項はありません。    |

## （ 1 口当たり情報）

|                                               |
|-----------------------------------------------|
| 2021年 8 月15日現在                                |
| 1 口当たり純資産額 2.8543円<br>（ 1 万口当たり純資産額 28,543円 ） |

「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 8 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          |          | 5,997,109      |
| 金銭信託        |          | 652,719        |
| コール・ローン     |          | 1,153,108      |
| 投資証券        |          | 4,701,972,530  |
| 未収入金        |          | 256,836        |
| 未収配当金       |          | 8,787,596      |
| 流動資産合計      |          | 4,718,819,898  |
| 資産合計        |          | 4,718,819,898  |
| 負債の部        |          |                |
| 流動負債        |          |                |
| 未払利息        |          | 3              |
| その他未払費用     |          | 61             |
| 流動負債合計      |          | 64             |
| 負債合計        |          | 64             |
| 純資産の部       |          |                |
| 元本等         |          |                |
| 元本          | 1, 2     | 2,178,491,608  |
| 剰余金         |          |                |
| 剰余金又は欠損金（ ） |          | 2,540,328,226  |
| 元本等合計       |          | 4,718,819,834  |
| 純資産合計       |          | 4,718,819,834  |
| 負債純資産合計     |          | 4,718,819,898  |

## ( 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中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。                                                                                                                               |
| 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 8 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>2,677,720,619円<br>期中追加設定元本額<br>292,596,069円<br>期中一部解約元本額<br>791,825,080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>1,270,350,177円<br>しんきん世界アロケーションファンド<br>299,077,445円<br>しんきん世界アロケーションファンド（積極型）<br>527,745,966円<br>しんきんグローバル6資産ファンド（1年決算型）<br>81,318,020円<br>合計 2,178,491,608円 |
| 2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における受益権の総数 | 2,178,491,608口                                                                                                                                                                          |

## ( 金融商品に関する注記 )

## 金融商品の時価等に関する事項

| 区分                   | 2021年 8 月15日現在          |
|----------------------|-------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 時価で計上しているため、その差額はありません。 |

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

## （デリバティブ取引等に関する注記）

|                |
|----------------|
| 2021年 8 月15日現在 |
| 該当事項はありません。    |

## （1口当たり情報）

|                                                      |
|------------------------------------------------------|
| 2021年 8 月15日現在                                       |
| <p>1口当たり純資産額 2.1661円</p> <p>（1万口当たり純資産額 21,661円）</p> |

#### 4【委託会社等の概況】

##### (1)【資本金の額】（本書提出日現在）

- ・ 資本の額 2億円
- ・ 委託会社が発行する株式総数 16,000株
- ・ 発行済株式総数 4,000株
- ・ 最近5年間ににおける主な資本の額の増減はありません。

##### (2)【事業の内容及び営業の状況】

「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8月31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  | 87  | 907,201   |
| 単位型公社債投資信託 | 20  | 72,087    |
| 単位型株式投資信託  | 56  | 148,438   |
| 合計         | 163 | 1,127,727 |

（注）純資産総額は百万円未満を切り捨てています。

##### (3)【その他】

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。

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。

## 5【委託会社等の経理状況】

- 1． 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
- 2． 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- 3． 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

## 1 財務諸表

## ( 1 ) 【貸借対照表】

|          |          | 前事業年度<br>( 2020年3月31日現在 ) |           | 当事業年度<br>( 2021年3月31日現在 ) |           |
|----------|----------|---------------------------|-----------|---------------------------|-----------|
| 科 目      | 注記<br>番号 | 金 額                       |           | 金 額                       |           |
| (資産の部)   |          | 千円                        | 千円        | 千円                        | 千円        |
| 流動資産     |          |                           |           |                           |           |
| 現金・預金    | *2       |                           | 6,105,781 |                           | 6,652,162 |
| 前払費用     |          |                           | 18,738    |                           | 24,867    |
| 未収入金     |          |                           | -         |                           | 13        |
| 未収委託者報酬  |          |                           | 472,704   |                           | 521,584   |
| 未収運用受託報酬 | *2       |                           | 7,811     |                           | 7,827     |
| 未収収益     |          |                           | 50        |                           | 13        |
| その他の流動資産 |          |                           | 2,890     |                           | 4,099     |
| 流動資産計    |          |                           | 6,607,976 |                           | 7,210,568 |
| 固定資産     |          |                           |           |                           |           |
| 有形固定資産   | *1       |                           | 82,167    |                           | 67,627    |
| 建物       |          | 64,512                    |           | 57,883                    |           |
| 器具備品     |          | 17,654                    |           | 9,744                     |           |
| 無形固定資産   |          |                           | 27,614    |                           | 27,218    |
| ソフトウェア   |          | 26,308                    |           | 25,925                    |           |
| 電話加入権    |          | 959                       |           | 959                       |           |
| その他      |          | 346                       |           | 333                       |           |
| 投資その他の資産 |          |                           | 44,757    |                           | 40,268    |
| 投資有価証券   |          | 2,479                     |           | 1,344                     |           |
| 長期前払費用   |          | 4,648                     |           | 2,556                     |           |
| 繰延税金資産   |          | 37,628                    |           | 36,367                    |           |
| 固定資産計    |          |                           | 154,539   |                           | 135,114   |
| 資産合計     |          |                           | 6,762,516 |                           | 7,345,683 |

|              |          | 前事業年度<br>( 2020年3月31日現在 ) |           | 当事業年度<br>( 2021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          |          |                           | 348,153   |                           | 386,391   |
| 未払手数料        | *2       | 298,154                   |           | 326,663                   |           |
| その他未払金       |          | 49,999                    |           | 59,727                    |           |
| 未払法人税等       |          |                           | 236,742   |                           | 133,176   |
| 未払消費税等       |          |                           | 60,459    |                           | 21,468    |
| 未払事業所税       |          |                           | 2,020     |                           | 2,070     |
| 賞与引当金        |          |                           | 71,102    |                           | 75,201    |
| その他の流動負債     |          |                           | 4,016     |                           | 4,323     |
| 流動負債計        |          |                           | 722,494   |                           | 622,632   |
| 固定負債         |          |                           |           |                           |           |
| 退職給付引当金      |          |                           | 109,538   |                           | 120,397   |
| 役員退職慰労引当金    |          |                           | 17,951    |                           | 32,355    |
| 固定負債計        |          |                           | 127,489   |                           | 152,752   |
| 負債合計         |          |                           | 849,984   |                           | 775,385   |
| (純資産の部)      |          | 千円                        | 千円        | 千円                        | 千円        |
| 株主資本         |          |                           | 5,912,551 |                           | 6,570,454 |
| 資本金          |          |                           | 200,000   |                           | 200,000   |
| 利益剰余金        |          |                           | 5,712,551 |                           | 6,370,454 |
| 利益準備金        |          | 2,000                     |           | 2,000                     |           |
| その他利益剰余金     |          | 5,710,551                 |           | 6,368,454                 |           |
| 別途積立金        |          | 4,650,000                 |           | 5,560,000                 |           |
| 繰越利益剰余金      |          | 1,060,551                 |           | 808,454                   |           |
| 評価・換算差額等     |          |                           | 20        |                           | 156       |
| その他有価証券評価差額金 |          | 20                        |           | 156                       |           |
| 純資産合計        |          |                           | 5,912,531 |                           | 6,570,298 |
| 負債・純資産合計     |          |                           | 6,762,516 |                           | 7,345,683 |

## （２）【損益計算書】

|             |          | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |           | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021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       |          |                                       | 5,673,201 |                                       | 5,125,325 |
| 運用受託報酬      | *1       |                                       | 132,189   |                                       | 99,617    |
| 営業収益計       |          |                                       | 5,805,390 |                                       | 5,224,942 |
| 営業費用        |          |                                       |           |                                       |           |
| 支払手数料       | *1       |                                       | 2,798,780 |                                       | 2,510,182 |
| 広告宣伝費       |          |                                       | 37,672    |                                       | 30,252    |
| 調査費         |          |                                       | 590,453   |                                       | 633,852   |
| 調査研究費       |          | 389,905                               |           | 431,831                               |           |
| 委託調査費       |          | 200,547                               |           | 202,020                               |           |
| 営業雑経費       |          |                                       | 67,426    |                                       | 66,540    |
| 印刷費         |          | 59,367                                |           | 57,538                                |           |
| 郵便料         |          | 169                                   |           | 193                                   |           |
| 電信電話料       |          | 2,424                                 |           | 3,323                                 |           |
| 協会費         |          | 5,464                                 |           | 5,484                                 |           |
| 営業費用計       |          |                                       | 3,494,332 |                                       | 3,240,827 |
| 一般管理費       |          |                                       |           |                                       |           |
| 給料          |          |                                       | 587,623   |                                       | 609,880   |
| 役員報酬        |          | 53,299                                |           | 62,524                                |           |
| 給料・手当       |          | 386,160                               |           | 399,530                               |           |
| 賞与          |          | 62,682                                |           | 59,582                                |           |
| 法定福利費       |          | 77,704                                |           | 81,816                                |           |
| 福利厚生費       |          | 4,833                                 |           | 6,425                                 |           |
| その他給料       |          | 2,943                                 |           | -                                     |           |
| 賞与引当金繰入     |          |                                       | 71,102    |                                       | 75,201    |
| 退職給付費用      |          |                                       | 62,160    |                                       | 62,682    |
| 役員退職慰労引当金繰入 |          |                                       | 10,803    |                                       | 14,403    |
| 交際費         |          |                                       | 3,715     |                                       | 1,255     |
| 旅費交通費       |          |                                       | 10,463    |                                       | 1,622     |
| 租税公課        |          |                                       | 26,856    |                                       | 22,600    |
| 不動産賃借料      |          |                                       | 62,753    |                                       | 62,833    |
| 固定資産減価償却費   |          |                                       | 30,023    |                                       | 27,327    |
| 諸経費         |          |                                       | 131,389   |                                       | 145,001   |
| 一般管理費計      |          |                                       | 996,891   |                                       | 1,022,808 |
| 営業利益        |          |                                       | 1,314,166 |                                       | 961,307   |
| 営業外収益       |          |                                       |           |                                       |           |
| 受取利息        | *1       |                                       | 145       |                                       | 114       |
| 受取配当金       |          |                                       | 17        |                                       | 133       |
| その他営業外収益    |          |                                       | 263       |                                       | 317       |
| 営業外収益計      |          |                                       | 426       |                                       | 565       |

|        |  |  |           |  |         |
|--------|--|--|-----------|--|---------|
| 営業外費用  |  |  |           |  |         |
| 雑損失    |  |  | 938       |  | 1,257   |
| 営業外費用計 |  |  | 938       |  | 1,257   |
| 経常利益   |  |  | 1,313,653 |  | 960,614 |

|               |          | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |           | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021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      |          |                                       | 1,313,653 |                                       | 960,614 |
| 法人税、住民税および事業税 |          |                                       | 406,739   |                                       | 301,451 |
| 法人税等調整額       |          |                                       | 2,040     |                                       | 1,260   |
| 当期純利益         |          |                                       | 904,874   |                                       | 657,902 |

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

|                         | 株主資本    |           |           |             |                 | 株主資本<br>合計 |
|-------------------------|---------|-----------|-----------|-------------|-----------------|------------|
|                         | 資本金     | 利益剰余金     |           |             | 利益<br>剰余金<br>合計 |            |
|                         |         | 利益<br>準備金 | その他利益剰余金  |             |                 |            |
|                         |         |           | 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 |

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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     | 4,650,000 | 1,060,551   | 5,712,551       | 5,912,551  |
| 当期変動額                   |         |           |           |             |                 |            |
| 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                | —       | —         | —         | —           | —               | —          |
| 当期純利益                   | —       | —         | —         | 657,902     | 657,902         | 657,902    |
| 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                 | —       | —         | 910,000   | 252,097     | 657,902         | 657,902    |
| 当期末残高                   | 200,000 | 2,000     | 5,560,000 | 808,454     | 6,370,454       | 6,570,454  |

|                         | 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                   | —                | —              | 657,902   |
| 株主資本以外の項目の当期<br>変動額（純額） | 135              | 135            | 135       |
| 当期変動額合計                 | 135              | 135            | 657,766   |
| 当期末残高                   | 156              | 156            | 6,570,298 |

## 重要な会計方針

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021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。                                                                                                                                                                                           |

## 未適用の会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

### （１）概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。

ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### （２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### （３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

### （１）概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」および「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）」が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

### （２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

### （３）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 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>(2020年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |
|------|-------------------------|-------------------------|
| 建 物  | 70,422千円                | 77,047千円                |
| 器具備品 | 48,310千円                | 48,009千円                |

## \* 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>(2020年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |
|----------|-------------------------|-------------------------|
| 普通預金     | 4,911,204千円             | 5,490,924千円             |
| 定期預金     | 1,000,000千円             | 1,000,000千円             |
| 未収運用受託報酬 | 2,655千円                 | 3,150千円                 |
| 未払手数料    | 135,102千円               | 148,731千円               |

## (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 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|--------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 運用受託報酬 | 123,017千円                             | 90,790千円                              |
| 受取利息   | 143千円                                 | 112千円                                 |
| 支払手数料  | 2,333,403千円                           | 2,028,702千円                           |

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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      |

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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 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 | —    |

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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

2021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    | 6,652,162 | 6,652,162 | —  |
| (2)未収委託者報酬  | 521,584   | 521,584   | —  |
| (3)未収運用受託報酬 | 7,827     | 7,827     | —  |
| (4)投資有価証券   | 1,344     | 1,344     | —  |
| 資産計         | 7,182,918 | 7,182,918 | —  |
| (5)未払手数料    | 326,663   | 326,663   | —  |
| (6)その他未払金   | 59,727    | 59,727    | —  |
| (7)未払法人税等   | 133,176   | 133,176   | —  |
| (8)未払消費税等   | 21,468    | 21,468    | —  |
| (9)未払事業所税   | 2,070     | 2,070     | —  |
| 負債計         | 543,107   | 543,107   | —  |

### (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 | 6,651,897 | 6,651,897 | —   |

|             |           |           |   |
|-------------|-----------|-----------|---|
| (2)未収委託者報酬  | 521,584   | 521,584   | — |
| (3)未収運用受託報酬 | 7,827     | 7,827     | — |
| 合計          | 7,181,309 | 7,181,309 | — |

## （有価証券関係）

## １．その他有価証券

前事業年度（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 |

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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  | 698      | 500   | 198 |
| 小計                               | 698      | 500   | 198 |
| 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 | 645      | 1,000 | 354 |
| 小計                               | 645      | 1,000 | 354 |
| 合計                               | 1,344    | 1,500 | 156 |

## ２．事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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>(2020年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
|              | 千円                      | 千円                      |
| 退職給付引当金の期首残高 | 102,601                 | 109,538                 |
| 退職給付費用       | 15,713                  | 16,733                  |
| 退職給付の支払額     | 8,777                   | 5,873                   |
| 制度への拠出額      | —                       | —                       |
| 退職給付引当金の期末残高 | 109,538                 | 120,397                 |

### （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>(2020年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                         | 千円                      | 千円                      |
| 非積立型制度の退職給付債務           | 109,538                 | 120,397                 |
| 貸借対照表に計上された<br>負債と資産の純額 | 109,538                 | 120,397                 |
| 退職給付引当金                 | 109,538                 | 120,397                 |
| 貸借対照表に計上された<br>負債と資産の純額 | 109,538                 | 120,397                 |

### （３）退職給付費用

|                | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
|                | 千円                                    | 千円                                    |
| 簡便法で計算した退職給付費用 | 15,713                                | 16,733                                |

## 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 40,250千円、当事業年度 43,129千円であります。

|                   | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|-------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| (１) 直近の積立状況に関する事項 | (2019年3月31日現在)                        | (2020年3月31日現在)                        |
|                   | 千円                                    | 千円                                    |

|                                      |                                                                                                                                            |                                                                                                                                            |
|--------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 年金資産の額                               | 1,650,650,110                                                                                                                              | 1,575,980,891                                                                                                                              |
| 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) | 1,782,453,404                                                                                                                              | 1,718,649,720                                                                                                                              |
| 差引額                                  | 131,803,293                                                                                                                                | 142,668,829                                                                                                                                |
| (2) 掛金に占める当社の拠出割合                    | (2019年3月分)<br>0.0746%                                                                                                                      | (2020年3月分)<br>0.0836%                                                                                                                      |
| (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> | <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189,351,085千円および年金財政計算上の別途積立金46,682,256千円であります。</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>(2020年3月31日現在) | 当事業年度<br>(2021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   | 21,771                  | 23,026                  |
| 役員退職慰労引当金      | 5,496                   | 9,907                   |
| 退職給付引当金繰入限度超過額 | 33,540                  | 36,865                  |
| 未払事業税          | 12,019                  | 9,243                   |
| 未払事業所税         | 618                     | 634                     |
| その他有価証券評価差額金   | 6                       | 47                      |
| その他            | 3,219                   | 3,463                   |
| 繰延税金資産 小計      | 76,671                  | 83,188                  |
| 評価性引当額         | 39,043                  | 46,820                  |
| 繰延税金資産 合計      | 37,628                  | 36,367                  |
| 繰延税金負債         | 千円                      | 千円                      |
| その他有価証券評価差額金   | —                       | —                       |
| 繰延税金負債 合計      | —                       | —                       |
| 繰延税金資産の純額      | 37,628                  | 36,367                  |

## 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 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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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     | 90,790 |

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 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<br>連合会事業 | 直接<br>(被所有)<br>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<br>代行手数料<br>運用受託報酬<br>出向者<br>人件費<br>事務所<br>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<br>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<br>代行手数料 | 424,462<br>千円 | 未払<br>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）

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

### （1）親会社および法人主要株主等

| 種類  | 会社等の名称 | 住所     | 資本金または出資金  | 事業の内容     | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関係内容   |                 | 取引内容                                     | 取引金額                                            | 科目    | 期末残高      |
|-----|--------|--------|------------|-----------|----------------|--------|-----------------|------------------------------------------|-------------------------------------------------|-------|-----------|
|     |        |        |            |           |                | 役員の兼務等 | 事業上の関係          |                                          |                                                 |       |           |
| 親会社 | 信金中央金庫 | 東京都中央区 | 690,998百万円 | 信用金庫連合会事業 | 直接(被所有)100%    | 兼任1人   | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 投資信託の代行手数料<br>運用受託報酬<br>出向者人件費<br>事務所賃借料 | 2,028,702千円<br>90,790千円<br>58,911千円<br>49,958千円 | 未払手数料 | 148,731千円 |

### （2）兄弟会社等

| 種類      | 会社等の名称     | 住所     | 資本金または出資金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関係内容   |                 | 取引内容       | 取引金額      | 科目    | 期末残高     |
|---------|------------|--------|-----------|-------|----------------|--------|-----------------|------------|-----------|-------|----------|
|         |            |        |           |       |                | 役員の兼務等 | 事業上の関係          |            |           |       |          |
| 親会社の子会社 | しんきん証券株式会社 | 東京都中央区 | 20,000百万円 | 証券業   | —              | なし     | 証券投資信託受益証券の募集販売 | 投資信託の代行手数料 | 438,730千円 | 未払手数料 | 93,587千円 |

（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 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|--------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 1株当たり純資産額    | 1,478,132円90銭                         | 1,642,574円61銭                         |
| 1株当たり当期純利益金額 | 226,218円53銭                           | 164,475円67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 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益金額        | 904,874千円                             | 657,902千円                             |
| 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 | 904,874千円                             | 657,902千円                             |
| 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。

## 独立監査人の監査報告書

2021年6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

### 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2021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。

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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．X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年9月29日

しんきんアセットマネジメント投信株式会社

取締役会 御中

P w C 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

## 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、「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2021年2月16日から2021年8月15日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、しんきん世界アロケーションファンドの2021年8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中間計算期間（2021年2月16日から2021年8月15日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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、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、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。

## 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に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、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。

- ・ 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、経営者に対して、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

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

以 上

---

（注） １． 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

２． XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。