

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成28年11月18日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 山本 幸次

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 太田 裕之

【電話番号】 03 - 4530 - 7093

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託  
受益証券に係るファンドの名称】 AMC /ステート・ストリート・リスクバジェット型  
バランス・オープン（ステイブル）

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託  
受益証券の金額】 継続募集額 2兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したことに伴い、平成28年5月20日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）の一部に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 【訂正箇所および訂正事項】

原届出書の該当事項を以下の内容に訂正します。

下線部\_\_\_\_\_は、訂正部分を示します。なお、図もしくは表が含まれる部分については、下線を省略する場合があります。

## 第一部【証券情報】

### （４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

<略>

基準価額は、販売会社（下記「（８）申込取扱場所」を参照）にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

<訂正後>

<略>

基準価額は、販売会社（下記「（８）申込取扱場所」を参照）にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

### （８）【申込取扱場所】

<訂正前>

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の照会先までお問い合わせください。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

<訂正後>

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の照会先までお問い合わせください。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

～ <略>

当ファンドが該当する属性区分

<略>

#### ファンドの目的

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券(以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

#### ファンドの特色

- 1 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク(=収益のブレ)総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。

<株式会社トータルアセットデザインの概要>

平成10年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、平成27年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。

- 2 マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指します。マザーファンドのベンチマークについては、「マザーファンドの概要」をご参照ください。また、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」とは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、各ベンチマークのリターンを合成した指数です。

- 3 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## ファンド運用の仕組み

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



※各マザーファンドには、当ファンド以外にも、各マザーファンドに投資する他のファンド(ベビーファンド)があります。

- \*1 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「日本株式インデックス・マザーファンド」に変更する予定です。
- \*2 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「日本債券インデックス・マザーファンド」に変更する予定です。
- \*3 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」に変更する予定です。
- \*4 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国債券インデックス・マザー・ファンド」に変更する予定です。

### ■ 主な投資制限

1. マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
2. 株式、公社債および外貨建資産、それぞれの実質投資割合には制限を設けません。
3. 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
4. デリバティブ取引は、約款に定める範囲で行います。

## 投資対象とするマザーファンドの概要

### ■ ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	・ TOPIX (東証株価指数配当込み)をベンチマークとします。 ・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。

### ■ ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	・ NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。 ・ 債券組入比率は原則として高位を維持します。

### ■ ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き(MSCI コクサイ指数、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)
投資態度	・ 日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)を主要投資対象とし、MSCI コクサイ指数(円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。 ・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※MSCI コクサイ指数(円ベース)とは、MSCI コクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

### ■ ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。 ・ 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。

※シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティ世界国債指数(除く日本)の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

### ■ 収益分配方針

毎決算時(原則として2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日)に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ① 分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の範囲内とします。
  - ② 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。
  - ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
- なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いについて保証するものではありません。

### ■ 収益分配金に関する留意事項

- ・ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。
- ・ 分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・ 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

<訂正後>

～ <略>

当ファンドが該当する属性区分

<略>

## ファンドの目的

当ファンドは、株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、日本および世界主要国の株式や公社債等を主要投資対象とする資産別のインデックス型マザーファンド受益証券(以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、中長期的に「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指して運用を行います。

## ファンドの特色

- 1** 株式会社トータルアセットデザインが算出した資産配分に基づき、マザーファンドの配分を行います。日本および世界主要国の株式や公社債等、運用資産全体のリスク(=収益のブレ)総量をバジェット化することにより、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、資産別のインデックス型マザーファンドの配分を行います。なお、資産配分は定期的に見直しが行われます。

<株式会社トータルアセットデザインの概要>

平成10年2月に設立され、年金基金ならびに金融機関等の資産運用について、資産配分の策定・運用機関の選択と配分構成・リスク管理に至るまで、トータルなコンサルティングサービスを提供しています。なお、平成27年1月29日付にて、株式会社エー・エム・シーは、株式会社トータルアセットデザインに社名変更されました。
- 2** マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指し、当ファンドは、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」に連動した投資成果を目指します。

マザーファンドのベンチマークについては、「マザーファンドの概要」をご参照ください。

また、「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」とは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、各ベンチマークのリターンを合成した指数です。
- 3** 実質的に保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## ファンド運用の仕組み

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。「ファミリーファンド方式」とは、投資者からの資金をまとめてベビーファンド(当ファンド)とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。



※各マザーファンドには、当ファンド以外にも、各マザーファンドに投資する他のファンド(ベビーファンド)があります。

\*米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月31日付にて、ファンド名称から“ステート・ストリート”を削除しました。

## 主な投資制限

- マザーファンド受益証券の投資割合には制限を設けません。
- 株式、公社債および外貨建資産、それぞれの実質投資割合には制限を設けません。
- 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)の実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- デリバティブ取引は、約款に定める範囲で行います。



## 投資対象とするマザーファンドの概要

### ■ 日本株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、TOPIX(東証株価指数配当込み)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本の取引所に上場されている株式
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ TOPIX (東証株価指数配当込み)をベンチマークとします。</li> <li>・ 株式の組入比率は、原則として信託財産総額の50%超を基本とします。</li> </ul>

### ■ 日本債券インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ NOMURA-BPI総合指数をベンチマークとします。</li> <li>・ 債券組入比率は原則として高位を維持します。</li> </ul>

### ■ 外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、日本を除く世界の主要国の株式市場の動き(MSCI コクサイ指数、円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 日本を除く世界の取引所に上場されている株式(それらに類するものを含みます。)を主要投資対象とし、MSCI コクサイ指数(円ベース)に連動した投資成果を目指して運用を行います。</li> <li>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</li> </ul>

※MSCI コクサイ指数(円ベース)とは、MSCI コクサイ指数の構成国の国別指数および構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

### ■ 外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	主として日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等を主要投資対象としシティ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ 公社債への投資は原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産に対する為替ヘッジは原則として行いません。</li> </ul>

※シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティ世界国債指数(除く日本)の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。

### ■ 収益分配方針

毎決算時(原則として2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日)に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

- ① 分配対象額は経費控除後の利子、配当収入および売買益(評価益を含みます。)等の範囲内とします。
  - ② 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象金額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。
  - ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。
- なお、上記は収益分配方針であり、将来の分配金の支払いについて保証するものではありません。

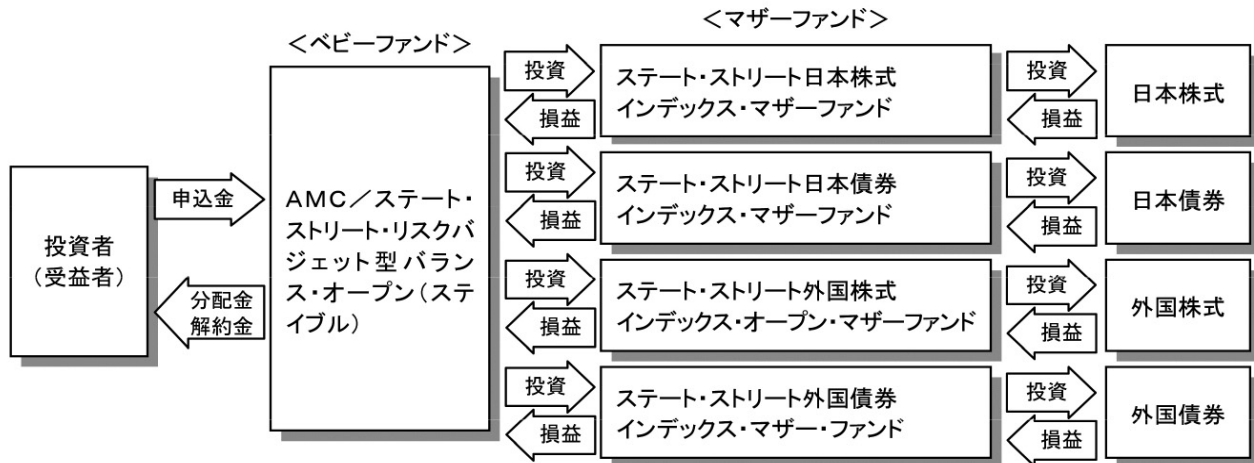
### ■ 収益分配金に関する留意事項

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

&lt; 訂正前 &gt;

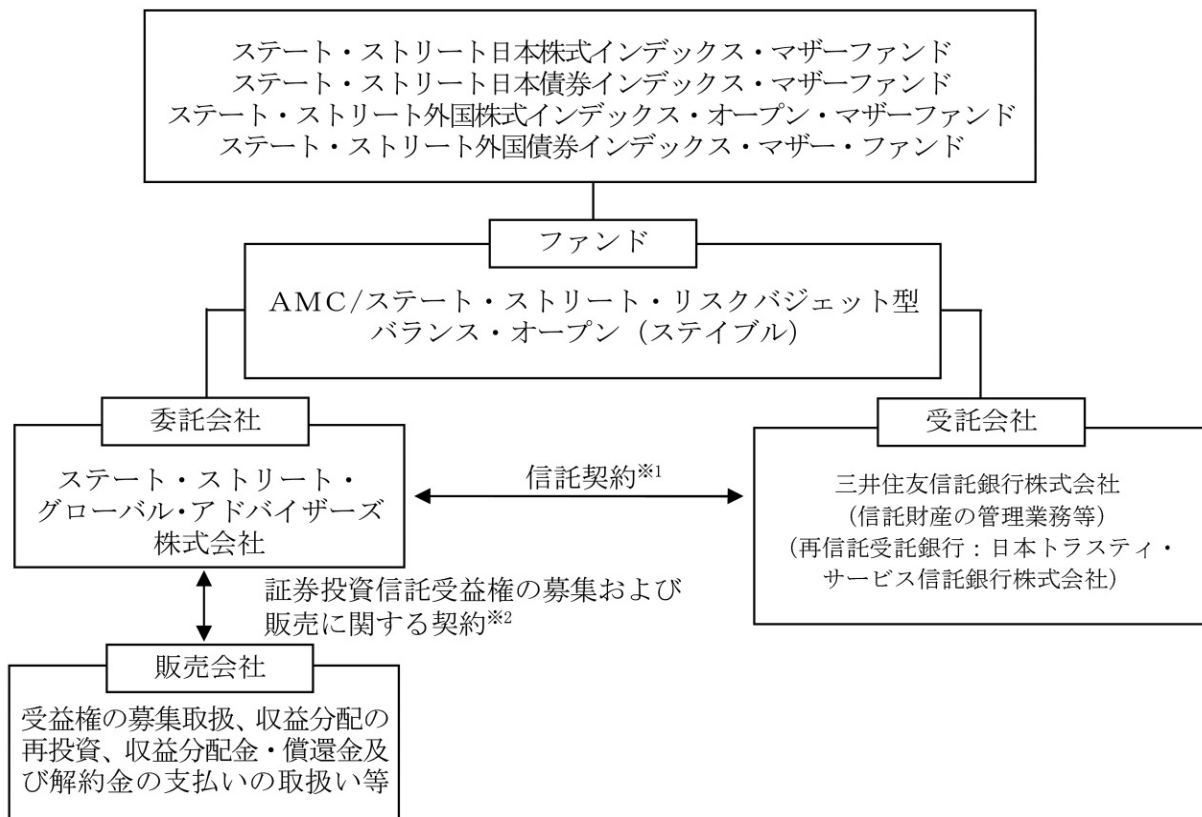
&lt; 略 &gt;



## ファンドの関係法人

&lt; 略 &gt;

## ファンド関係法人



&lt; 略 &gt;

## 委託会社の概況（平成28年3月31日現在）

## 1) 資本金

3億1千万円

## 2) 沿革

平成10年2月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
平成10年3月31日	投資顧問業の登録
平成10年8月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年9月30日	投資一任契約に係る業務の認可
平成10年9月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
平成19年9月30日	金融商品取引業者の登録
平成20年7月1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

## 3) 大株主の状況

(平成28年3月31日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

&lt;訂正後&gt;

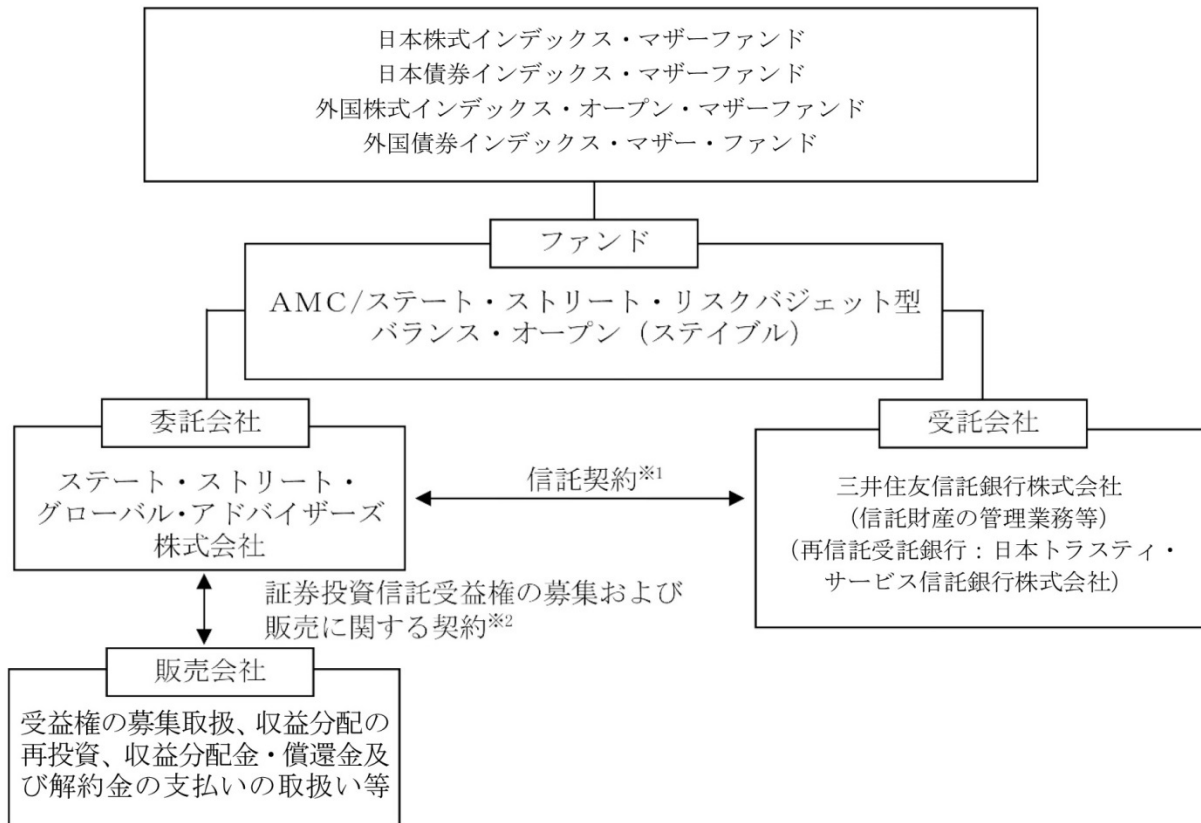
&lt;略&gt;



ファンドの関係法人

&lt;略&gt;

ファンド関係法人



< 略 >

### 委託会社の概況（平成28年9月30日現在）

#### 1) 資本金

3億1千万円

#### 2) 沿革

平成10年2月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
平成10年3月31日	投資顧問業の登録
平成10年8月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年9月30日	投資一任契約に係る業務の認可
平成10年9月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
平成19年9月30日	金融商品取引業者の登録
平成20年7月1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更

#### 3) 大株主の状況

（平成28年9月30日現在）

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

<訂正前>

<略>

「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース<sup>1</sup>）]

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド

[ベンチマーク：シティ世界国債指数（除く日本、円ベース<sup>2</sup>）]

<以下略>

<訂正後>

<略>

「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

「AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数」をベンチマークとします。

各マザーファンド受益証券のベンチマークは下記の通りで、各マザーファンド受益証券においては、それぞれのベンチマークに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。

日本株式インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：TOPIX（東証株価指数配当込み）]

日本債券インデックス・マザーファンド

[ベンチマーク：NOMURA - BPI総合指数]

外国株式インデックス・オープン・マザーファンド

[ベンチマーク：MSCIコクサイ指数（円ベース<sup>1</sup>）]

外国債券インデックス・マザー・ファンド[ベンチマーク：シティ世界国債指数（除く日本、円ベース<sup>2</sup>）]

&lt;以下略&gt;

**（２）【投資対象】**

&lt;訂正前&gt;

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。（信託約款等15条）

&lt;以下略&gt;

&lt;訂正後&gt;

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」および「外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下総称して「マザーファンド」といいます。）の受益証券（以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。）および次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。（信託約款等15条）

&lt;以下略&gt;

**（３）【運用体制】**

&lt;訂正前&gt;

&lt;略&gt;

上記運用体制は平成28年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt;訂正後&gt;

&lt;略&gt;

上記運用体制は平成28年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

**（５）【投資制限】**

&lt;訂正前&gt;

&lt;略&gt;

(参考)「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

&lt;略&gt;

(参考)「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

（参考）「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

（参考）「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

（参考）「日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「日本株式インデックス・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「日本株式インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

（参考）「日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「日本債券インデックス・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「日本債券インデックス・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

（参考）「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

（参考）「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要  
当ファンドが主たる投資対象とする「外国債券インデックス・マザー・ファンド」には、当ファンドと同様の投資リスクがあります。「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

### 3【投資リスク】

#### （3）リスク管理体制

< 訂正前 >

< 略 >

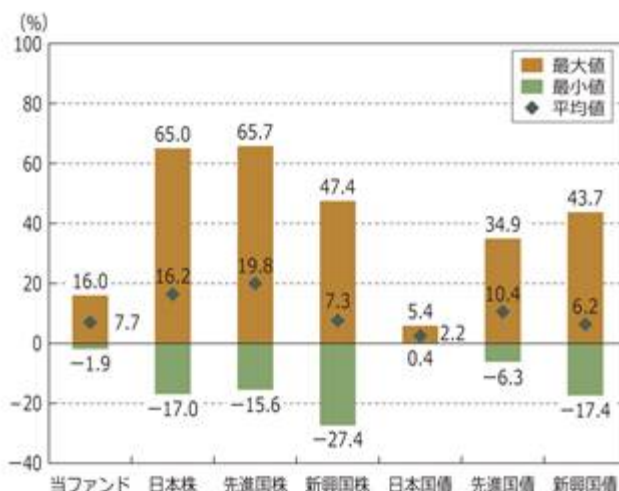
上記リスクに対する管理体制は平成28年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

### ＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞



### ＜ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較＞



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。  
 ※当ファンドの税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)の年間騰落率は、平成25年3月～平成28年3月の3年1ヶ月間、代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、平成23年4月～平成28年3月の5年間の各月末における直近1年前を対比して計算(1年未満の場合は年換算)しており、決算日に対応した数値とは異なります。  
 ※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。  
 ※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。

## 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

＜訂正後＞

＜略＞

上記リスクに対する管理体制は平成28年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。



## ＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

### ＜ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移＞



### ＜ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較＞



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。  
 ※当ファンドの税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)の年間騰落率は、平成25年3月～平成28年9月の3年7ヶ月間、代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、平成23年10月～平成28年9月の5年間の各月末における直近1年前を対比して計算(1年未満の場合は年換算)しており、決算日に対応した数値とは異なります。  
 ※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。  
 ※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。

## ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

前記「ベンチマーク」をご覧ください。

### 新興国債:JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースファイド(円ベース)は、J.P.Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

＜訂正前＞

＜略＞

	報酬額(年率)	役務の内容
信託報酬率合計	＜略＞	

配 分	委託会社	< 略 >	< 略 >
	販売会社	< 略 >	< 略 >
	受託会社	< 略 >	< 略 >

&lt; 以下略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

		報酬率(年率)	役務の内容
信託報酬率合計		< 略 >	
配 分	委託会社	< 略 >	< 略 >
	販売会社	< 略 >	< 略 >
	受託会社	< 略 >	< 略 >

&lt; 以下略 &gt;

## 5【運用状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

## (1)【投資状況】

(平成28年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,771,812,894	84.79
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		497,386,232	15.21
純資産総額		3,269,199,126	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(平成28年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	107,671,020,760	97.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,211,601,913	2.01
純資産総額		109,882,622,673	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(日本債券インデックス・マザーファンド)

(平成28年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	100,653,254,600	80.02
特殊債券	日本	10,272,302,442	8.17
地方債証券	日本	7,945,838,106	6.32
社債券	日本	6,506,525,860	5.17
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		405,859,657	0.32
純資産総額		125,783,780,665	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(平成28年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	75,068,501,505	59.48
	イギリス	9,132,586,782	7.24
	カナダ	4,680,693,239	3.71
	フランス	4,553,007,982	3.61
	スイス	4,416,481,136	3.50
	ドイツ	4,350,736,551	3.45
	オーストラリア	3,289,465,294	2.61
	香港	1,673,885,952	1.33
	オランダ	1,636,090,298	1.30
	スペイン	1,494,168,850	1.18
	スウェーデン	1,381,915,942	1.09
	イタリア	913,974,812	0.72

	デンマーク	866,635,007	0.69
	ベルギー	671,075,585	0.53
	シンガポール	590,372,563	0.47
	フィンランド	483,771,221	0.38
	イスラエル	340,059,444	0.27
	ノルウェー	323,019,578	0.25
	アイルランド	219,970,155	0.17
	オーストリア	94,087,863	0.07
	ニュージーランド	93,183,764	0.07
	ポルトガル	70,914,133	0.06
	小計	116,344,597,656	92.18
投資証券	アメリカ	2,526,680,379	2.00
	オーストラリア	323,849,756	0.26
	フランス	182,259,938	0.15
	イギリス	133,376,488	0.11
	香港	64,340,446	0.05
	シンガポール	55,381,875	0.04
	カナダ	30,410,893	0.02
	小計	3,316,299,775	2.63
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		6,550,589,210	5.19
純資産総額		126,211,486,641	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（平成28年9月30日現在）

種類	国 / 地域名	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	63,795,430,823	42.55
	フランス	14,963,731,809	9.98
	イタリア	14,267,403,277	9.52
	イギリス	11,680,214,148	7.79
	ドイツ	11,097,874,642	7.40
	スペイン	8,219,485,658	5.48
	ベルギー	3,865,426,213	2.58
	オランダ	3,523,214,141	2.35
	カナダ	3,063,167,200	2.04
	オーストラリア	2,899,117,074	1.93
	オーストリア	2,326,500,739	1.55
	メキシコ	1,239,101,075	0.83
	アイルランド	1,214,979,096	0.81
	デンマーク	1,038,971,514	0.69
	フィンランド	924,655,756	0.62
	ポーランド	885,995,228	0.59
	南アフリカ	725,906,873	0.48
	マレーシア	699,568,470	0.47
	スウェーデン	685,632,479	0.46
	シンガポール	562,029,372	0.37
	ノルウェー	385,993,802	0.26
	スイス	364,376,363	0.24

	小計	148,428,775,752	98.99
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,508,856,153	1.01
純資産総額		149,937,631,905	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

（平成28年9月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	日本債券インデックス・マ ザーファンド		1,340,111,438	1.2587	1,686,798,268	1.2810	1,716,682,752	52.51
2	日本	親投資信託 受益証券	日本株式インデックス・マ ザーファンド		295,117,051	1.9415	572,969,755	2.0754	612,485,927	18.74
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・ オープン・マザーファンド		150,635,226	1.8344	276,325,259	1.8495	278,599,850	8.52
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデックス・マ ザー・ファンド		78,814,435	2.2293	175,707,409	2.0814	164,044,365	5.02
									投資比率：合計	84.79

（注１）投資有価証券は4銘柄です。

（注２）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券		84.79
合計		84.79

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

### <参考情報>

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成28年9月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	701,600	6,087	4,270,421,704	5,779	4,054,546,400	3.69
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	4,357,900	552	2,403,425,429	505	2,201,175,290	2.00
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	307,700	5,755	1,770,918,118	6,522	2,006,819,400	1.83
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	419,800	4,740	1,989,730,258	4,614	1,936,957,200	1.76
5	日本	株式	KDDI	情報・通信業	537,300	2,886	1,550,508,102	3,115	1,673,689,500	1.52
6	日本	株式	三井住友フィナンシ ャルグループ	銀行業	434,900	3,605	1,567,814,500	3,380	1,469,962,000	1.34
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	495,200	3,152	1,560,766,408	2,888	1,429,890,000	1.30
8	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	341,700	4,616	1,577,174,439	4,119	1,407,462,300	1.28
9	日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	7,807,700	180	1,407,181,771	169	1,316,378,220	1.20
10	日本	株式	ソニー	電気機器	388,400	2,650	1,029,205,624	3,293	1,279,001,200	1.16
11	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	229,600	5,462	1,254,153,264	4,823	1,107,360,800	1.01

12	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	227,200	4,527	1,028,525,312	4,757	1,080,790,400	0.98
13	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	405,800	2,547	1,033,503,614	2,562	1,039,659,600	0.95
14	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	625,600	1,576	985,964,368	1,574	984,381,600	0.90
15	日本	株式	ファナック	電気機器	55,800	17,784	992,332,134	17,010	949,158,000	0.86
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	407,500	2,053	836,536,375	2,285	931,137,500	0.85
17	日本	株式	キーエンス	電気機器	12,500	60,141	751,756,500	73,460	918,250,000	0.84
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	99,800	9,876	985,646,756	9,080	906,184,000	0.82
19	日本	株式	任天堂	その他製品	33,900	15,799	535,588,473	26,605	901,909,500	0.82
20	日本	株式	キヤノン	電気機器	296,200	3,329	986,079,420	2,924	865,940,700	0.79
21	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	49,300	19,399	956,370,700	17,210	848,453,000	0.77
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	220,000	3,995	878,871,400	3,834	843,480,000	0.77
23	日本	株式	花王	化学	146,400	5,688	832,680,744	5,691	833,162,400	0.76
24	日本	株式	三菱地所	不動産業	404,000	2,158	871,823,920	1,888	762,752,000	0.69
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	58,000	14,602	846,914,260	13,030	755,740,000	0.69
26	日本	株式	三菱電機	電気機器	587,000	1,196	701,916,990	1,283	752,827,500	0.69
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	80,100	8,180	655,228,413	9,351	749,015,100	0.68
28	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	750,200	1,114	835,602,768	983	737,221,540	0.67
29	日本	株式	信越化学工業	化学	103,400	6,077	628,372,140	7,002	724,006,800	0.66
30	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	194,500	4,175	811,998,600	3,706	720,817,000	0.66
									投資比率：合計	32.94

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.96
	輸送用機器	9.02
	情報・通信業	8.33
	銀行業	7.36
	化学	6.47
	医薬品	5.39
	機械	4.91
	食料品	4.88
	小売業	4.80
	卸売業	4.31
	陸運業	4.19
	サービス業	3.82
	建設業	3.05
	不動産業	2.45
	保険業	2.26
	その他製品	1.93
	電気・ガス業	1.84
	精密機器	1.48
	その他金融業	1.25
	鉄鋼	1.18
証券、商品先物取引業	0.95	
ゴム製品	0.89	
非鉄金属	0.89	
ガラス・土石製品	0.88	
繊維製品	0.75	
金属製品	0.65	
空運業	0.54	

	石油・石炭製品	0.48
	鉱業	0.31
	パルプ・紙	0.25
	海運業	0.22
	倉庫・運輸関連業	0.20
	水産・農林業	0.10
	合 計	97.99

(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	TOPIX(先物) (2016年12月限)	大阪取引所	買建	160	2,143,173,680	2,116,800,000	1.93

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

#### <参考情報>

#### 親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

#### 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成28年9月30日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	日本	国債 証券	第298回利付国 債(10年)	1.300	2018/12/20	1,600,000,000	104.24	1,667,872,000	103.56	1,656,976,000	1.32
2	日本	国債 証券	第340回利付国 債(10年)	0.400	2025/09/20	1,300,000,000	104.66	1,360,580,000	104.94	1,364,324,000	1.08
3	日本	国債 証券	第157回利付国 債(20年)	0.200	2036/06/20	1,400,000,000	99.21	1,388,984,200	97.14	1,360,016,000	1.08
4	日本	国債 証券	第343回利付国 債(10年)	0.100	2026/06/20	1,300,000,000	101.84	1,323,939,500	101.96	1,325,480,000	1.05
5	日本	国債 証券	第297回利付国 債(10年)	1.400	2018/12/20	1,200,000,000	104.52	1,254,264,000	103.78	1,245,396,000	0.99
6	日本	国債 証券	第304回利付国 債(10年)	1.300	2019/09/20	1,100,000,000	105.37	1,159,136,000	104.71	1,151,898,000	0.92
7	日本	国債 証券	第295回利付国 債(10年)	1.500	2018/06/20	1,100,000,000	103.93	1,143,263,000	103.11	1,134,210,000	0.90
8	日本	国債 証券	第313回利付国 債(10年)	1.300	2021/03/20	1,000,000,000	107.59	1,075,940,000	107.01	1,070,110,000	0.85
9	日本	国債 証券	第305回利付国 債(10年)	1.300	2019/12/20	1,000,000,000	105.73	1,057,380,000	105.10	1,051,020,000	0.84
10	日本	国債 証券	第339回利付国 債(10年)	0.400	2025/06/20	1,000,000,000	104.68	1,046,800,000	104.89	1,048,990,000	0.83
11	日本	国債 証券	第338回利付国 債(10年)	0.400	2025/03/20	1,000,000,000	104.69	1,046,990,000	104.89	1,048,910,000	0.83
12	日本	国債 証券	第302回利付国 債(10年)	1.400	2019/06/20	1,000,000,000	105.35	1,053,550,000	104.60	1,046,010,000	0.83
13	日本	国債 証券	第337回利付国 債(10年)	0.300	2024/12/20	1,000,000,000	103.77	1,037,740,000	104.00	1,040,000,000	0.83

14	日本	国債証券	第293回利付国債（10年）	1.800	2018/06/20	1,000,000,000	104.62	1,046,210,000	103.62	1,036,260,000	0.82
15	日本	国債証券	第128回利付国債（5年）	0.100	2021/06/20	1,000,000,000	101.31	1,013,198,000	101.66	1,016,670,000	0.81
16	日本	国債証券	第330回利付国債（10年）	0.800	2023/09/20	900,000,000	107.44	966,996,000	107.32	965,925,000	0.77
17	日本	国債証券	第314回利付国債（10年）	1.100	2021/03/20	900,000,000	106.57	959,202,000	106.10	954,981,000	0.76
18	日本	国債証券	第307回利付国債（10年）	1.300	2020/03/20	900,000,000	106.13	955,233,000	105.49	949,473,000	0.75
19	日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	1.000	2020/09/20	900,000,000	105.51	949,635,000	105.06	945,576,000	0.75
20	日本	国債証券	第57回利付国債（20年）	1.900	2022/06/20	800,000,000	113.32	906,592,000	112.35	898,840,000	0.71
21	日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	1.200	2020/12/20	800,000,000	106.76	854,088,000	106.21	849,728,000	0.68
22	日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1.400	2020/03/20	800,000,000	106.54	852,344,000	105.84	846,768,000	0.67
23	日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	0.500	2024/09/20	800,000,000	105.48	843,856,000	105.57	844,616,000	0.67
24	日本	国債証券	第309回利付国債（10年）	1.100	2020/06/20	800,000,000	105.61	844,912,000	105.11	840,904,000	0.67
25	日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	1.500	2017/12/20	800,000,000	103.07	824,560,000	102.21	817,696,000	0.65
26	日本	国債証券	第342回利付国債（10年）	0.100	2026/03/20	800,000,000	102.13	817,083,000	102.05	816,440,000	0.65
27	日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	1.200	2021/06/20	750,000,000	107.47	806,055,000	106.88	801,630,000	0.64
28	日本	国債証券	第60回利付国債（20年）	1.400	2022/12/20	700,000,000	110.96	776,748,000	110.34	772,380,000	0.61
29	日本	国債証券	第2回利付国債（40年）	2.200	2049/03/20	500,000,000	142.14	710,700,000	151.92	759,640,000	0.60
30	日本	国債証券	第319回利付国債（10年）	1.100	2021/12/20	700,000,000	107.60	753,242,000	107.07	749,497,000	0.60
										投資比率：合計	24.16

（注1）評価金額の上位30銘柄について記載しています。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		80.02
特殊債券		8.17
地方債証券		6.32
社債券		5.17
合計		99.68

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）



## 投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成28年9月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	215,367	11,913	2,565,655,699	11,344	2,443,046,060	1.94
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	294,032	5,453	1,603,474,579	5,804	1,706,646,409	1.35
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	162,451	8,214	1,334,368,875	8,743	1,420,282,321	1.13
4	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	15,808	68,188	1,077,908,113	83,834	1,325,240,537	1.05
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	107,925	10,352	1,117,202,301	11,858	1,279,811,603	1.01
6	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	90,852	10,691	971,316,896	12,952	1,176,756,968	0.93
7	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	365,002	3,070	1,120,557,308	2,986	1,089,922,836	0.86
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	124,916	7,993	998,449,590	8,066	1,007,597,689	0.80
9	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	241,013	3,395	818,142,344	4,119	992,640,383	0.79
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	144,190	6,792	979,371,701	6,639	957,209,352	0.76
11	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	12,181	75,866	924,127,293	78,369	954,612,925	0.76
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	105,779	7,655	809,715,396	8,922	943,740,943	0.75
13	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	11,412	78,062	890,839,052	81,163	926,231,663	0.73
14	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	188,597	5,601	1,056,338,737	4,487	846,177,103	0.67
15	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	159,384	4,574	728,967,842	5,270	840,013,353	0.67
16	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	241,788	3,316	801,702,467	3,369	814,660,757	0.65
17	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	73,695	9,138	673,440,710	10,240	754,667,928	0.60
18	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	89,105	9,285	827,342,152	8,082	720,137,253	0.57
19	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	184,728	3,485	643,702,302	3,774	697,126,230	0.55
20	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,515	28,823	793,059,617	25,297	696,050,146	0.55
21	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	161,807	4,363	706,017,013	4,250	687,691,658	0.54
22	アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	108,460	5,456	591,804,961	6,260	678,996,389	0.54
23	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	46,434	13,614	632,142,520	14,520	674,213,359	0.53
24	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	49,639	13,625	676,326,847	12,936	642,144,082	0.51
25	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	95,106	6,228	592,318,341	6,699	637,134,115	0.50
26	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	196,682	2,763	543,353,378	3,174	624,299,507	0.49
27	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	74,995	8,073	605,466,192	8,284	621,239,861	0.49
28	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	403,587	1,768	713,371,340	1,533	618,690,476	0.49
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	56,436	10,187	574,903,870	10,897	614,965,664	0.49

30	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC- W/I	食品・飲料・タバコ	60,651	8,840	536,149,405	9,888	599,687,587	0.48
									投資比率：合計	22.18

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成28年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.84
	ソフトウェア・サービス	8.69
	銀行	7.87
	エネルギー	6.93
	資本財	6.80
	食品・飲料・タバコ	6.19
	素材	4.66
	保険	3.83
	小売	3.82
	ヘルスケア機器・サービス	3.80
	各種金融	3.76
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.50
	公益事業	3.30
	電気通信サービス	3.05
	メディア	2.46
	半導体・半導体製造装置	2.27
	家庭用品・パーソナル用品	2.20
	食品・生活必需品小売り	1.97
	運輸	1.81
	消費者サービス	1.73
耐久消費財・アパレル	1.62	
自動車・自動車部品	1.50	
商業・専門サービス	0.99	
不動産	0.59	
	小 計	92.18
投資証券		2.63
合 計		94.81

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類及び業種の評価金額の比率です。

(注2) 平成28年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
-------	-------	------	---------------	----	----	----------------	----------------	-------------	-----------------

株価指数先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	398	42,223,312.50	42,755,150.00	4,323,400,768	3.43
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	248	7,394,101.02	7,387,920.00	837,494,611	0.66
	FTSE100INDEX	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリス・ポンド	62	4,131,134.54	4,264,050.00	558,590,550	0.44
	FSMI INDEX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイス・フラン	34	2,777,680.00	2,764,540.00	289,226,174	0.23
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	20	3,364,012.00	3,433,600.00	263,734,816	0.21
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	22	2,852,300.00	3,004,650.00	231,478,236	0.18

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（平成28年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

(注3) 先物取引の評価においては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

#### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成28年9月30日現在）

順位	国/地域名	種類	銘柄名	利率(%)	償還日	数量(額面)	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	12,000,000	11,252	1,350,190,137	11,206	1,344,734,208	0.90
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/12/31	12,000,000	10,255	1,230,576,048	10,240	1,228,850,688	0.82
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/02/15	11,500,000	10,463	1,203,231,936	10,531	1,211,081,376	0.81
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.000	2045/11/15	10,200,000	10,916	1,113,448,144	11,682	1,191,614,461	0.79
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/02/28	11,000,000	10,462	1,150,874,022	10,505	1,155,511,385	0.77
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	10,000,000	10,556	1,055,617,124	10,717	1,071,710,208	0.71
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/09/30	10,000,000	10,482	1,048,211,689	10,491	1,049,079,552	0.70
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2044/02/15	7,800,000	12,377	965,373,427	13,032	1,016,515,069	0.68
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2017/09/30	9,800,000	10,291	1,008,546,004	10,235	1,003,016,358	0.67
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	9,500,000	10,293	977,825,849	10,390	987,057,600	0.66
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	13,811	994,404,372	13,551	975,693,127	0.65
12	イタリア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	5.000	2025/03/01	6,500,000	14,788	961,207,780	14,982	973,859,322	0.65
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	8,800,000	11,089	975,851,683	11,011	968,973,096	0.65
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	10,643	957,859,200	10,658	959,178,816	0.64

15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/09/30	9,000,000	10,289	925,978,434	10,388	934,897,881	0.62
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	8,800,000	10,453	919,890,302	10,531	926,740,531	0.62
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/01/31	9,000,000	10,212	919,089,792	10,255	922,984,934	0.62
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	8,900,000	10,204	908,157,708	10,223	909,813,649	0.61
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2018/04/30	8,800,000	10,075	886,590,228	10,098	888,636,897	0.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/09/30	8,500,000	10,255	871,673,612	10,231	869,593,574	0.58
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	8,100,000	10,712	867,675,732	10,518	851,957,740	0.57
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/08/15	8,000,000	10,441	835,251,200	10,507	840,590,336	0.56
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2018/11/30	8,200,000	10,233	839,105,578	10,210	837,185,625	0.56
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2019/12/31	8,200,000	10,121	829,930,265	10,179	834,656,614	0.56
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2019/09/30	8,200,000	10,094	827,691,468	10,151	832,359,774	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	8,000,000	10,199	815,929,190	10,309	824,694,272	0.55
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	7,500,000	10,750	806,247,456	10,751	806,330,880	0.54
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	7,500,000	10,644	798,335,258	10,497	787,287,456	0.53
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2018/08/31	7,600,000	10,286	781,753,461	10,252	779,140,520	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	7,000,000	11,077	775,360,857	11,013	770,936,857	0.51
										投資比率：合計	19.20

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成28年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		98.99
合計		98.99

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 平成28年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

平成28年9月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
第1期	（平成25年 2月20日）	分配付：	213,198,476	分配付：	1.0667
		分配落：	213,198,476	分配落：	1.0667
第2期	（平成26年 2月20日）	分配付：	1,623,142,054	分配付：	1.1583
		分配落：	1,616,135,543	分配落：	1.1533
第3期	（平成27年 2月20日）	分配付：	1,749,455,838	分配付：	1.2424
		分配落：	1,726,925,712	分配落：	1.2264
第4期	（平成28年 2月22日）	分配付：	2,799,520,026	分配付：	1.1999
		分配落：	2,783,188,603	分配落：	1.1929
平成27年 9月末日			2,175,270,688		1.2115
10月末日			2,763,783,101		1.2480
11月末日			2,810,624,016		1.2515
12月末日			2,842,246,922		1.2445
平成28年 1月末日			2,831,646,638		1.2201
2月末日			2,826,879,149		1.2023
3月末日			2,893,526,582		1.2258
4月末日			2,911,044,009		1.2250
5月末日			3,368,255,457		1.2318
6月末日			3,302,586,732		1.2060
7月末日			3,351,318,287		1.2208
8月末日			3,327,026,662		1.2143
9月末日			3,269,199,126		1.2110

#### 【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	0.0000円
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	0.0050円
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	0.0160円
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	0.0070円

#### 【収益率の推移】

計算期間		収益率
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	6.7%
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	8.6%
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	7.7%

第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	2.2%
	自平成28年 2月23日 至平成28年 9月30日	1.5%

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末の分配落基準価額（設定時は当初元本額）を控除した額を、前期末の分配落基準価額（同）で除して得た数に100を乗じて得た数です。

（４）【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自平成24年 3月 9日 至平成25年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
	自平成28年 2月23日 至平成28年 9月30日	434,226,231	67,671,721	2,699,614,966

（注1）日本国外における設定、解約はありません。

（注2）第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## (参考情報) 運用実績

(平成28年9月30日現在)

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

基準価額	12,110円
純資産総額	3,269百万円

## 分配の推移

計算期間	分配金
第1期 (平成25年2月20日)	0円
第2期 (平成26年2月20日)	50円
第3期 (平成27年2月20日)	160円
第4期 (平成28年2月22日)	70円
設定来累計	280円

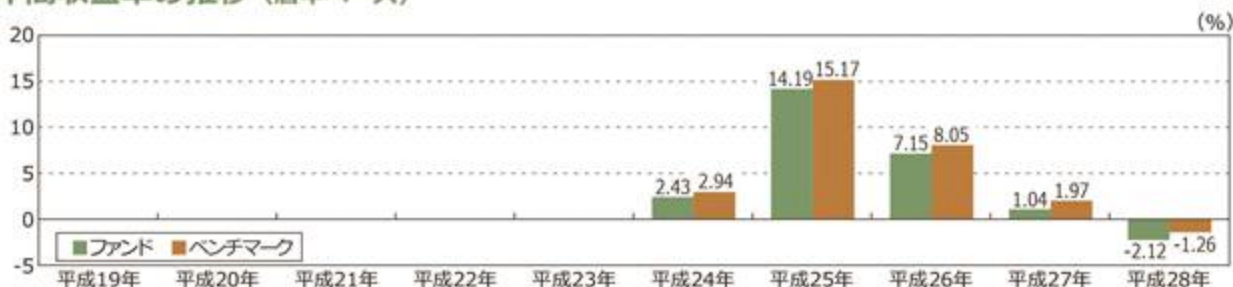
※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	投資銘柄 (上位3銘柄)	国/ 地域名	種類	業種	利率	償還日	投資比率
日本債券 インデックス・マザーファンド	52.51%	第298回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	1.300%	2018/12/20	1.32%
		第340回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.400%	2025/09/20	1.08%
		第157回利付国債(20年)	日本	国債証券	—	0.200%	2036/06/20	1.08%
日本株式 インデックス・マザーファンド	18.74%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.69%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	2.00%
		ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	—	—	1.83%
外国株式 インデックス・オープン・ マザーファンド	8.52%	APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	—	—	1.94%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	1.35%
		EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	株式	エネルギー	—	—	1.13%
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	5.02%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	3.625%	2021/02/15	0.90%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.375%	2018/12/31	0.82%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2022/02/15	0.81%

※各マザーファンドの投資比率は、当ファンドの純資産総額に対する各マザーファンドの評価金額の比率であり、投資銘柄(上位3銘柄)の投資比率は、各マザーファンド純資産総額に対する各投資銘柄の評価金額の比率です。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※ベンチマークは、株式会社トータルアセットデザインが決定した資産配分に基づき、組入れマザーファンドの各ベンチマークのリターンを合成したAMCリスクバジェット型資産配分モデル指数です。

※平成24年のファンドとベンチマークの収益率は設定時から12月末まで、平成28年は9月末までで算出しております。

※基準価額と同一基準のデータを取得できないため、設定時以前のベンチマークの収益率は記載しておりません。

- 上記の運用実績は、過去の実績であり将来の成果を保証するものではありません。
- 上記のベンチマークの情報は参考情報です。
- 最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

<訂正前>

1) ~ 2) <略>

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

<訂正後>

1) ~ 2) <略>

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

#### (5)【その他】

<訂正前>

1) ~ 3) <略>

4) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成し、販売会社を通じて知れている受益者に対して交付します。

5) ~ 6) <略>

<訂正後>

1) ~ 3) <略>

4) 運用報告書の交付（信託約款第56条）

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

(a) 交付運用報告書は、知れている受益者に対して販売会社を通じて交付されます。

(b) 運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

5) ~ 6) <略>



### 第3【ファンドの経理状況】

<訂正前>

(1) <略>

(2) <略>

<訂正後>

(1) <略>

(2) <略>

(3) 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および第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。

(4) 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(平成28年2月23日から平成28年8月22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り中間監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

末尾に「中間財務諸表」を追加します。

< 末尾追加 >

## 中間財務諸表

AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	446,357,532	1,399,460
コール・ローン	9,721,414	517,360,909
親投資信託受益証券	2,354,470,265	2,811,750,498
流動資産合計	2,810,549,211	3,330,510,867
<b>資産合計</b>	2,810,549,211	3,330,510,867
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払収益分配金	16,331,423	-
未払解約金	-	9,819,222
未払受託者報酬	725,617	836,179
未払委託者報酬	10,158,509	11,706,409
未払利息	-	1,503
その他未払費用	145,059	167,813
流動負債合計	27,360,608	22,531,126
<b>負債合計</b>	27,360,608	22,531,126
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 2,333,060,456	1 2,739,380,040
<b>剰余金</b>		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	450,128,147	568,599,701
(分配準備積立金)	146,021,951	144,663,339
元本等合計	2,783,188,603	3,307,979,741
<b>純資産合計</b>	2,783,188,603	3,307,979,741
<b>負債純資産合計</b>	2,810,549,211	3,330,510,867

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 平成27年 2月21日 至 平成27年 8月20日	当中間計算期間 自 平成28年 2月23日 至 平成28年 8月22日
営業収益		
受取利息	13,048	-
有価証券売買等損益	50,709,160	43,280,233
営業収益合計	50,722,208	43,280,233
営業費用		
支払利息	-	146,597
受託者報酬	558,010	836,179
委託者報酬	7,812,039	11,706,409
その他費用	111,538	205,138
営業費用合計	8,481,587	12,894,323
営業利益	42,240,621	30,385,910
経常利益	42,240,621	30,385,910
中間純利益	42,240,621	30,385,910
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	22,304	437,729
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	318,792,775	450,128,147
剰余金増加額又は欠損金減少額	88,212,791	93,216,808
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	88,212,791	93,216,808
剰余金減少額又は欠損金増加額	319,462	4,693,435
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	319,462	4,693,435
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	448,904,421	568,599,701

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成28年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成28年2月23日から平成28年8月22日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	1,408,132,937円	2,333,060,456円
期中追加設定元本額	932,006,609円	430,435,941円
期中一部解約元本額	7,079,090円	24,116,357円
2 受益権の総数	2,333,060,456口	2,739,380,040口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

## (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 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。  (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。  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。	(3)デリバティブ取引 同左  同左
---------------------------	---	-----------------------------

(有価証券関係に関する注記)  
該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)  
該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,192,929円 (11,929円)	1,207,676円 (12,076円)

<参考>

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」及び「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要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の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在) 金 額	(平成28年 8月22日現在) 金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		1,692,250,530	6,629,810
コール・ローン		36,856,257	2,450,948,956
株式		93,167,451,910	107,039,839,150
派生商品評価勘定		9,000,376	79,114,504
未収入金		4,474,400	548,704
未収配当金		154,837,548	151,759,708
未収利息		1	
前払金		157,245,000	

差入委託証拠金		136,290,000	120,600,000
流動資産合計		95,358,406,022	109,849,440,832
資産合計		95,358,406,022	109,849,440,832
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		161,084,520	11,581,104
未払金		1,416,296	
前受金			54,133,000
未払解約金		5,748,000	131,915,000
未払利息			7,122
その他未払費用			4,435
流動負債合計		168,248,816	197,640,661
負債合計		168,248,816	197,640,661
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,624,700,839	54,072,809,292
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		47,565,456,367	55,578,990,879
元本等合計		95,190,157,206	109,651,800,171
純資産合計		95,190,157,206	109,651,800,171
負債純資産合計		95,358,406,022	109,849,440,832

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

## (2) 注記表

### (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。

### (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	60,470,886,080円	47,624,700,839円

期中追加設定元本額	7,869,377,988円	10,951,933,666円
期中一部解約元本額	20,715,563,229円	4,503,825,213円
元本の内訳		
ファンド名		
A M C / ステート・ストリート・リス クバジェット型バランス・オープン (ステイブル)	61,059,364円	320,387,985円
日本株式インデックス・ファンド(年 金1) < 適格機関投資家限定 >	937,009,211円	1,063,075,210円
バランスファンドVA30A < 適格機関投 資家限定 >	28,579,358円	20,733,270円
バランスファンドVA30B < 適格機関投 資家限定 >	1,789,754,811円	1,188,220,099円
バランスファンドVA40A < 適格機関投 資家限定 >	565,745円	590,175円
バランスファンドVA40B < 適格機関投 資家限定 >	25,497,391円	26,042,537円
バランスファンドVA50A < 適格機関投 資家限定 >	22,517,384円	18,026,719円
バランスファンドVA50B < 適格機関投 資家限定 >	11,636,116,633円	11,513,943,230円
日本株式インデックス・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	733,518,232円	673,415,744円
バランスファンドVA50C < 適格機関投 資家限定 >	49,046,960円	32,807,343円
バランスファンドVA25A < 適格機関投 資家限定 >	2,416,238,945円	2,269,986,213円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関 投資家限定 >	1,256,363,868円	1,254,282,552円
バランスファンドVA75A < 適格機関投 資家限定 >	102,941,007円	92,900,211円
日本株式インデックス・ファンドM < 適格機関投資家限定 >	866,852,830円	1,157,273,102円
日本株式インデックス・ファンドS < 適格機関投資家限定 >	9,925,735,568円	16,170,881,513円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家 限定 >	122,551,245円	132,485,361円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家 限定 >	1,057,553,586円	844,905,134円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家 限定 >	313,473,073円	301,536,492円
バランスファンドVA35A < 適格機関投 資家限定 >	3,494,104,159円	3,425,630,701円
バランスファンドVA40C < 適格機関投 資家限定 >	359,065,869円	363,668,912円
世界4資産バランスV A 4 5 < 適格機 関投資家限定 >	1,136,069,732円	1,173,337,855円
日本株式インデックス・ファンドF O F < 適格機関投資家限定 >	5,230,105,025円	5,268,986,136円

グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	24,102,902円	25,402,205円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	25,517,267円	27,911,129円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	11,657,497円	10,962,000円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	916,512,893円	936,360,376円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	7,244,638円	7,192,153円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	16,615,843円	17,265,672円
バランスファンドVA50D<適格機関投資家限定>	259,894円	円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	49,862,802円	55,097,780円
日本株式インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	1,545,606,479円	1,514,931,003円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	557,823,373円	567,005,743円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,563,860,098円	2,633,132,097円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	228,382,598円	336,879,277円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	49,292,823円	430,061,694円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	63,241,736円	93,780,233円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	円	103,711,436円
計	47,624,700,839円	54,072,809,292円
2 受益権の総数	47,624,700,839口	54,072,809,292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	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左



2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左

（有価証券関係に関する注記）  
該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 2月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	2,137,925,000		1,985,940,000	151,985,000
	合 計	2,137,925,000		1,985,940,000	151,985,000

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 8月22日現在）		
		契 約 額 等	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	2,533,337,000	2,601,000,000	67,663,000
	合 計	2,533,337,000	2,601,000,000	67,663,000

## （注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 5．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
1口当たり純資産額	1.9988円	2.0279円
（1万口当たり純資産額）	（19,988円）	（20,279円）

## 「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## （1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		555,149,420	1,888,681
コール・ローン		12,096,597	474,250,670
国債証券		111,482,950,600	101,968,433,900
地方債証券		8,712,383,705	7,952,026,427
特殊債券		11,929,987,179	10,486,313,948
社債券		8,080,609,220	6,805,560,880
未収入金		977,700,000	
未収利息		526,178,865	459,245,310
前払費用		4,240,941	3,588,535
流動資産合計		142,281,296,527	128,151,308,351
資産合計		142,281,296,527	128,151,308,351
負債の部			
流動負債			
未払解約金		1,220,714,241	152,775,159
未払利息			1,378

その他未払費用			1,724
流動負債合計		1,220,714,241	152,778,261
負債合計		1,220,714,241	152,778,261
純資産の部			
元本等			
元本	1	112,637,231,314	99,785,840,061
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		28,423,350,972	28,212,690,029
元本等合計		141,060,582,286	127,998,530,090
純資産合計		141,060,582,286	127,998,530,090
負債純資産合計		142,281,296,527	128,151,308,351

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

## (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、特殊債券、社債券</p> <p>個別法に基づき、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)、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
-------------------	---

### (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	145,599,818,302円	112,637,231,314円
期中追加設定元本額	20,917,964,505円	10,130,728,805円
期中一部解約元本額	53,880,551,493円	22,982,120,058円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン(ステイブル)	1,165,481,769円	1,340,111,438円
日本債券インデックス・ファンド(年金1) < 適格機関投資家限定 >	3,475,655,804円	3,346,898,103円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	118,068,530円	81,463,596円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	6,850,158,087円	4,353,692,170円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	1,738,192円	1,616,996円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	66,210,122円	62,284,146円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	48,238,130円	38,197,344円

バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	20,871,418,406円	17,830,238,864円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	83,382,907円	50,013,726円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	11,523,951,706円	9,568,997,955円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	3,388,876,404円	2,928,463,248円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	26,358,049円	21,062,179円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	861,692,718円	827,056,283円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	2,813,677,488円	1,971,597,143円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,282,599,221円	1,082,631,355円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	10,926,324,967円	9,336,905,522円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	967,179,722円	850,487,072円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	3,602,900,305円	3,213,537,299円
日本債券インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	236,460,798円	217,399,212円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	85,553,492円	78,721,613円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	47,310,904円	42,739,447円
日本債券インデックス・ファンドVA2＜適格機関投資家限定＞	1,334,458,108円	1,841,540,315円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	61,812,496円	49,829,353円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	5,390,636,692円	4,900,029,631円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	52,428,279円	47,407,070円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	56,478,381円	52,618,143円
バランスファンドVA50D＜適格機関投資家限定＞	443,409円	円
バランスファンドVA10A＜適格機関投資家限定＞	1,661,098,501円	1,580,842,903円
日本債券インデックス・ファンドVA3＜適格機関投資家限定＞	6,919,654,462円	6,711,424,577円
日本債券インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,139,155,035円	3,632,817,669円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	4,101,545,966円	3,615,361,441円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	15,133,234,444円	13,538,047,778円

4 資産インデックスバランスV A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	18,902,051円	15,759,351円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	1,265,180,071円	1,290,428,354円
債券マルチ・ファクター戦略ファン ド（年金）< 適格機関投資家限定 >	492,449,114円	155,072,348円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定 >	192,174,876円	円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）< 適 格機関投資家限定 >	351,635,700円	358,181,556円
ステート・ストリート日本債券イン デックス・オープン	円	231,008,349円
グローバルバランス4 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	262,609,337円	245,063,268円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適 格機関投資家限定 >	3,148,233,745円	2,951,913,241円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適 格機関投資家限定 >	191,933,757円	172,119,254円
グローバルバランス5 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	88,700,940円	73,497,025円
世界株式V C ファンド< 適格機関投 資家限定 >	1,331,228,229円	1,078,763,724円
計	112,637,231,314円	99,785,840,061円
2 受益権の総数	112,637,231,314口	99,785,840,061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	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
1 貸借対照表計上 額、時価及びこれ らの差額	貸借対照表計上額は時価を計上し ているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の 算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以 外の金融商品については、短期間で 決済されることから、時価は帳簿価 額と近似しているため、当該金融商 品の帳簿価額を時価としておりま す。	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左
	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(3)デリバティブ取引 同左
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券関係に関する注記）  
該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）  
該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2523円 （12,523円）	1.2827円 （12,827円）

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		3,682,348,691	1,008,058,228
金銭信託		2,636,234,789	11,917,840
コール・ローン		57,415,699	4,405,860,377
株式		117,258,392,917	116,880,184,970
投資証券		3,210,321,908	3,338,973,594
派生商品評価勘定		154,175,708	218,441,020
未収入金		96,098,389	15,179,428
未収配当金		240,434,552	247,312,711
未収利息		1	

差入委託証拠金		1,511,987,097	718,077,512
流動資産合計		128,847,409,751	126,844,005,680
資産合計		128,847,409,751	126,844,005,680
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		56,853,548	52,122,374
未払解約金		1,418,716,000	487,915,000
未払利息			12,803
その他未払費用			4,913
流動負債合計		1,475,569,548	540,055,090
負債合計		1,475,569,548	540,055,090
純資産の部			
元本等			
元本	1	69,950,993,970	68,149,718,445
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		57,420,846,233	58,154,232,145
元本等合計		127,371,840,203	126,303,950,590
純資産合計		127,371,840,203	126,303,950,590
負債純資産合計		128,847,409,751	126,844,005,680

（注）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年12月1日から、翌年11月30日までであり、当ファンドの計算期間と異なります。

## （2）注記表

### （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <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 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
1 期首元本額	80,290,033,338円	69,950,993,970円
期中追加設定元本額	22,408,813,834円	10,718,565,109円
期中一部解約元本額	32,747,853,202円	12,519,840,634円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン	7,404,464,299円	7,356,345,941円
ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン	7,007,507,550円	7,242,548,433円
ステート・ストリートDCグローバル株式インデックス・オープン	37,966,903円	41,207,138円
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	348,830,019円	150,635,226円
外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	3,076,645,691円	2,683,486,289円
外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	264,414,758円	198,463,080円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	15,425,761円	11,197,203円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	2,025,097,086円	1,303,380,799円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	366,021円	381,179円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	28,538,491円	28,500,800円



バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	16,187,131円	13,173,925円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	13,143,616,943円	12,594,370,163円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	22,523,943円	15,417,340円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,782,091,006円	1,649,641,100円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,236,269,890円	1,199,587,222円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	133,045,853円	116,187,756円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	136,147,847円	143,471,476円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,171,209,274円	910,995,799円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	348,193,513円	326,344,751円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	2,930,127,488円	2,809,224,302円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	405,577,482円	397,240,917円
世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	1,613,319,080円	1,607,669,433円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	55,507,311円	54,680,041円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	58,846,125円	59,966,154円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	26,045,962円	23,462,421円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	428,549,962円	439,422,814円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,668,011円	2,598,983円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	7,079,130円	7,524,807円
バランスファンドVA50D<適格機関投資家限定>	120,390円	円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	56,333,060円	60,509,789円
外国株式インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	9,085,167,180円	9,286,578,764円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	409,583,792円	413,697,981円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	52,316,340円	49,009,102円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	272,448,392円	157,671,702円

T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）＜適 格機関投資家限定＞	75,618,215円	43,752,460円
ステート・ストリート先進国株式イ ンデックス・オープン	円	46,990,537円
ステート・ストリート先進国株式イ ンデックス・オープン（為替ヘッジ あり）	円	88,298,358円
ワールドエクイティ・ファンドV L ＜適格機関投資家限定＞	16,273,144,071円	16,616,084,260円
計	69,950,993,970円	68,149,718,445円
2 受益権の総数	69,950,993,970口	68,149,718,445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	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22日現在）
1 貸借対照表計上 額、時価及びこれ らの差額	貸借対照表計上額は時価を計上し ているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の 算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以 外の金融商品については、短期間で 決済されることから、時価は帳簿価 額と近似しているため、当該金融商 品の帳簿価額を時価としておりま す。  (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（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。  (3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関 係に関する注記）」に記載してあり ます。	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左  (3)デリバティブ取引 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	同左
---------------------------	--	----

（有価証券関係に関する注記）  
該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 2月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	4,257,318,443		4,342,631,634	85,313,191
	S&P 60	239,628,250		246,723,432	7,095,182
	SPI 200	241,469,486		248,367,750	6,898,264
	FTSE100INDEX	555,929,742		572,379,492	16,449,750
	FSMI INDEX	297,365,203		300,819,923	3,454,720
	EURO STOXX 50	849,015,477		864,729,545	15,714,068
	合 計	6,440,726,601		6,575,651,776	134,925,175

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 8月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	3,912,497,232		4,050,595,490	138,098,258
	S&P 60	231,608,085		239,208,328	7,600,243
	SPI 200	218,094,916		231,032,604	12,937,688
	FTSE100INDEX	475,251,365		503,916,000	28,664,635
	FSMI INDEX	258,589,037		262,917,820	4,328,783
	EURO STOXX 50	757,753,753		775,535,459	17,781,706
	合 計	5,853,794,388		6,063,205,701	209,411,313

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 2月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,782,531,674		1,755,844,800	26,686,874
	カナダ・ドル	60,625,073		60,137,700	487,373
	オーストラリア・ドル	99,137,433		98,740,080	397,353
	イギリス・ポンド	253,246,565		247,841,250	5,405,315
	ユーロ	286,388,688		280,430,320	5,958,368
	売建				
	アメリカ・ドル	832,617,570		832,082,160	535,410
	カナダ・ドル	24,256,040		24,230,560	25,480
	オーストラリア・ドル	63,033,849		63,235,080	201,231
	イギリス・ポンド	233,823,220		233,415,570	407,650
	香港・ドル	21,069,972		21,083,040	13,068
	スウェーデン・クローナ	20,536,320		20,490,240	46,080
	デンマーク・クローネ	46,652,760		46,569,600	83,160
	イスラエル・シェケル	21,764,385		21,774,200	9,815
	ユーロ	226,608,042		226,149,440	458,602
	合 計	3,972,291,591		3,932,024,040	37,603,015

(単位：円)

区 分	種 類	(平成28年 8月22日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	3,441,276,390		3,401,944,800	39,331,590
	カナダ・ドル	171,445,328		172,225,300	779,972
	オーストラリア・ドル	107,677,779		106,084,800	1,592,979
	イギリス・ポンド	315,022,456		310,944,000	4,078,456
	ユーロ	371,604,669		372,509,600	904,931
	売建				
	アメリカ・ドル	307,037,232		307,713,600	676,368
	カナダ・ドル	18,036,324		17,923,900	112,424

	オーストラリア・ドル	13,824,504		13,737,600	86,904
	イギリス・ポンド	84,556,445		83,968,000	588,445
	ユーロ	56,899,050		56,785,000	114,050
	合計	4,887,380,177		4,843,836,600	43,092,667

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 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。

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。

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ない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 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。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 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、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1口当たり純資産額	1.8209円	1.8533円
(1万口当たり純資産額)	(18,209円)	(18,533円)

## 「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		894,688,759	709,211,004
金銭信託		228,226,721	328,815
コール・ローン		4,970,649	121,558,375
国債証券		157,110,348,596	149,441,292,460
派生商品評価勘定		2,390,400	
未収入金		705,397,652	800,871,440
未収利息		1,514,348,734	1,272,823,781
前払費用		28,008,805	63,280,968
流動資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843
資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		427,200	
未払金			947,631,914
未払解約金		1,699,257,258	66,655,000

未払利息			353
その他未払費用			442
流動負債合計		1,699,684,458	1,014,287,709
負債合計		1,699,684,458	1,014,287,709
純資産の部			
元本等			
元本	1	70,807,053,573	72,799,330,559
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		87,981,642,285	78,595,748,575
元本等合計		158,788,695,858	151,395,079,134
純資産合計		158,788,695,858	151,395,079,134
負債純資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843

## (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、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）、又は価格情報会社の提供する価額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	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	93,621,001,523円	70,807,053,573円
期中追加設定元本額	15,970,215,085円	11,971,227,143円
期中一部解約元本額	38,784,163,035円	9,978,950,157円

元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	5,638,579,993円	5,748,494,515円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	13,076,343円	13,292,507円
AMCノステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	61,405,248円	78,814,435円
海外国債インデックス・ファンド 適格機関投資家限定	279,991,019円	円
外国債券インデックス・ファンドノ 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関 投資家限定＞	1,492,168,040円	2,596,507,751円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格 機関投資家限定＞	8,960,328,412円	8,313,589,602円
バランスファンドVA30A＜適格機関投 資家限定＞	26,395,685円	20,092,632円
バランスファンドVA30B＜適格機関投 資家限定＞	3,770,477,898円	2,705,743,591円
バランスファンドVA40A＜適格機関投 資家限定＞	317,363円	328,881円
バランスファンドVA40B＜適格機関投 資家限定＞	35,052,645円	38,188,169円
バランスファンドVA50A＜適格機関投 資家限定＞	6,470,910円	5,883,560円
バランスファンドVA50B＜適格機関投 資家限定＞	11,276,376,409円	11,111,999,262円
外国債券インデックス・ファンドVA1 ＜適格機関投資家限定＞	382,866,199円	336,718,421円
バランスファンドVA50C＜適格機関投 資家限定＞	20,017,905円	12,996,037円
バランスファンドVA25A＜適格機関投 資家限定＞	5,453,974,047円	5,169,106,442円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関 投資家限定＞	1,985,114,455円	1,964,086,978円
バランスファンドVA75A＜適格機関投 資家限定＞	55,498,781円	51,720,996円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家 限定＞	454,677,212円	506,653,510円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家 限定＞	1,506,849,551円	1,201,143,598円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家 限定＞	676,329,234円	671,374,745円
バランスファンドVA35A＜適格機関投 資家限定＞	5,046,371,273円	4,970,924,195円
バランスファンドVA40C＜適格機関投 資家限定＞	523,220,146円	520,353,498円
世界4資産バランスVA45＜適格 機関投資家限定＞	1,103,520,704円	1,112,267,199円

外国債券インデックス・ファンド (年金) < 適格機関投資家限定 >	288,454,006円	297,329,932円
グローバル4資産30VA < 適格機 関投資家限定 >	114,367,726円	121,028,930円
グローバル4資産45VA < 適格機 関投資家限定 >	65,727,530円	70,368,279円
外国債券インデックス・ファンドV A2 < 適格機関投資家限定 >	716,413,612円	1,103,994,678円
4資産バランス30VA2 < 適格機関 投資家限定 >	43,432,480円	41,205,054円
バランスファンドVA25B < 適格 機関投資家限定 >	881,281,263円	915,441,949円
バランスファンドVA20A < 適格 機関投資家限定 >	6,542,069円	6,703,256円
バランスファンドVA35B < 適格 機関投資家限定 >	9,187,897円	9,611,205円
バランスファンドVA50D < 適格 機関投資家限定 >	104,299円	円
外国債券インデックス・ファンドV A3 < 適格機関投資家限定 >	12,829,440,380円	13,909,843,006円
外国債券インデックス・ファンドA < 適格機関投資家限定 >	341,665,536円	722,685,619円
4資産インデックスバランスVA2 0 < 適格機関投資家限定 >	1,472,157,148円	1,479,110,120円
世界分散ファンドVA25A < 適格 機関投資家限定 >	2,477,695,241円	2,544,089,560円
外国債券インデックス・ファンド A / 為替ヘッジ付き < 適格機関投資 家限定 >	1,362,187,622円	2,221,576,472円
4資産インデックスバランスVA5 0 < 適格機関投資家限定 >	38,772,789円	38,541,501円
外国債券インデックス・ファンド/ 為替ヘッジ付きVA4 < 適格機関投 資家限定 >	31,804,629円	21,820,573円
Tadリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル)年金 < 適格機関投資家限定 >	1,966,382円	円
債券マルチ・ファクター戦略ファン ド(年金) < 適格機関投資家限定 >	760,270,336円	647,467,877円
フレックス資産配分戦略ファンド< 適格機関投資家限定 >	596,092,651円	707,548,043円
Tadリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド(ステイブル) < 適 格機関投資家限定 >	410,505円	円
ステート・ストリート先進国債券イ ンデックス・オープン	円	30,237,382円
ステート・ストリート先進国債券イ ンデックス・オープン(為替ヘッジ あり)	円	67,951,789円
世界国債タームスプレッド・プレミ ア戦略ファンド年金為替ヘッジ	円	227,667,620円



世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド/為替ヘッジ付	円	464,827,190円
計	70,807,053,573円	72,799,330,559円
2 受益権の総数	70,807,053,573口	72,799,330,559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	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表(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>(3)デリバティブ取引 「注記表(デリバティブ取引等関係に関する注記)」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</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> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	<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>
---------------------------	--	--

（有価証券関係に関する注記）  
該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）  
取引の時価等に関する事項  
通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 2月22日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引 以外の取 引	為替予約取引 売建 アメリカ・ドル オーストラリア・ドル イギリス・ポンド メキシコ・ペソ ポーランド・ズロチ ユーロ	790,585,000 8,050,300 80,830,000 33,841,500 54,245,000 615,749,400		789,880,000 8,076,000 80,655,000 33,990,000 54,473,000 614,264,000	705,000 25,700 175,000 148,500 228,000 1,485,400
	合 計	1,583,301,200		1,581,338,000	1,963,200

（平成28年8月22日現在）  
該当する事項はありません。

（注）1．時価の算定方法

（1）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。

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。

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ない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 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。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2)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、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1口当たり純資産額	2,2426円	2,0796円
(1万口当たり純資産額)	(22,426円)	(20,796円)

## 2【ファンドの現況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

## &lt;訂正・更新後&gt;

## 【純資産額計算書】

(平成28年9月30日現在)

資産総額	3,272,082,410円
負債総額	2,883,284円
純資産総額( - )	3,269,199,126円
発行済口数	2,699,614,966口
1口当たり純資産額( / )	1.2110円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

(平成28年9月30日現在)

資産総額	110,148,834,655円
負債総額	266,211,982円
純資産総額( - )	109,882,622,673円
発行済口数	52,946,277,072口
1口当たり純資産額( / )	2.0754円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

(平成28年9月30日現在)

資産総額	127,001,222,893円
負債総額	1,217,442,228円
純資産総額( - )	125,783,780,665円
発行済口数	98,188,131,902口
1口当たり純資産額( / )	1.2810円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

(平成28年9月30日現在)

資産総額	126,390,658,751円
負債総額	179,172,110円
純資産総額( - )	126,211,486,641円
発行済口数	68,241,629,933口
1口当たり純資産額( / )	1.8495円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(平成28年9月30日現在)

資産総額	150,119,262,119円
負債総額	181,630,214円
純資産総額( - )	149,937,631,905円
発行済口数	72,036,805,846口
1口当たり純資産額( / )	2.0814円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です(平成28年9月30日現在)。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です(平成28年9月30日現在)。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成28年9月30日現在)。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査および業務監査を行います。各部には、部長をおき、部長は、代表取締役社長または取締役の命を受け、所属員を指揮監督し、部の業務を統括します。

投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

投資政策委員会で、投資対象地域経済、産業、政治について更に精緻に分析を行い、投資対象企業、債券を様々な面より分析しつつ、基本的な運用方針を決定します。

###### 2) 運用実施計画の作成

ファンド・マネージャーは決定された運用基本方針に基づいて、具体的な銘柄選択と運用実施計画を作成します。

###### 3) 運用の実行

ファンド・マネージャーは運用計画に基づいて、組入有価証券の売買等を指図します。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、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）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

平成28年9月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計126本であり、その純資産総額は1,246,983百万円です(親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」といいます。）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. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表について、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】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資産の部)		%		%
流動資産				
預金	8,366,245		6,002,331	
有価証券	38,658		6,448	
差入保証金	61,568		-	
前払金	34,267		94,019	
前払費用	16,572		19,057	
未収入金	631,179		527,437	
未収委託者報酬	620,043		544,116	
未収収益	20,425		28,476	
繰延税金資産	89,899		969,336	
流動資産計	9,878,861	97.4	8,191,223	74.4
固定資産				
有形固定資産	153,132		130,133	
建物附属設備	1	-	103,983	
器具備品	1	302	22,098	
リース資産	1	6,365	4,051	
建設仮勘定		146,463	-	
無形固定資産		804	201	
ソフトウェア	2	804	201	
投資その他の資産		108,598	2,686,381	
長期差入保証金		80,034	75,114	
繰延税金資産		23,714	2,606,416	
その他投資		4,850	4,850	
固定資産計		262,535	2,816,715	25.6
資産合計		10,141,396	11,007,938	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金		35,845	59,514	
未払金		560,375	586,597	
未払手数料	135,048		112,932	
その他未払金	425,326		473,664	
未払費用		11,999	1,560	
未払法人税等		154,604	3,917,946	
未払消費税等		89,514	39,613	
賞与引当金		53,368	58,531	

リース債務		-			1,861	
流動負債計		905,707	8.9		4,665,626	42.4
固定負債						
退職給付引当金		58,673			73,140	
長期リース債務		6,502			2,834	
固定負債計		65,175	0.6		75,974	0.7
負債合計		970,883	9.6		4,741,600	43.1
(純資産の部)			%			%
株主資本		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	8,751,393			5,847,217		
純資産合計		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
負債・純資産合計		10,141,396	100.0		11,007,938	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日		当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,546,857		2,509,890	
投資顧問収入	1,644,728		1,578,998	
その他営業収益	37,200		155,119	
営業収益計	4,228,786	100.0	4,244,008	100.0
営業費用				
支払手数料	590,805		559,139	
広告宣伝費	16,509		16,680	
公告費	1,190		1,190	
調査費	379,903		410,480	
調査費	257,107		265,829	
委託調査費	120,214		142,735	
図書費	2,581		1,915	
委託計算費	166,328		151,283	
営業雑経費	36,320		42,905	
通信費	5,792		4,838	
印刷費	7,774		11,461	
協会費	10,010		10,719	
諸会費	2,763		4,744	
その他	9,978		11,140	
営業費用計	1,191,058	28.2	1,181,679	27.8
一般管理費				
給料	1,319,517		1,209,889	



役員報酬	337,945			289,386		
給料・手当	689,216			689,687		
賞与	257,155			187,055		
賞与引当金繰入額	35,199			43,760		
交際費		3,610			2,655	
旅費交通費		32,522			27,724	
租税公課		17,227			99,542	
不動産賃借料		126,366			85,870	
退職給付費用		57,683			80,570	
固定資産減価償却費		16,581			25,224	
福利厚生費		80,872			84,742	
事務手数料	1	84,588			522,979	
諸経費		183,190			148,610	
一般管理費計		1,922,160	45.5		2,287,811	53.9
営業利益		1,115,567	26.4		774,517	18.2
営業外収益						
受取利息		0			0	
有価証券運用益		678			-	
雑収入		3,846			278	
営業外収益計		4,525	0.1		278	0.0
営業外費用						
支払利息		201			174	
為替差損		2,420			2,081	
有価証券運用損		-			1,242	
雑損失		500			360	
営業外費用計		3,122	0.1		3,858	0.1
経常利益		1,116,969	26.4		770,936	18.2
特別損失						
固定資産減損損失	2	95,541			-	
固定資産除却損失		3,268			-	
事業再構築費用		-			101,509	
事務処理損失		15,453			173	
特別損失計		114,263	2.7		101,682	2.4
税引前当期純利益		1,002,706	23.7		669,254	15.8
法人税、住民税及び事業税		426,689	10.1		4,035,569	95.1
法人税等調整額		8,861	0.2		3,462,138	81.6
当期純利益		567,156	13.4		95,824	2.3

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			利益剰余金 合計		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,184,237	8,293,357	8,603,357	8,603,357
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156

当期変動額合計	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本合計			
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金					利益剰余金合計
					別途積立金	繰越利益剰余金				
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513	
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	3,000,000	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
当期純利益	-	-	-	-	-	95,824	95,824	95,824	95,824	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,904,175	2,904,175	2,904,175	2,904,175	
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337	

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年 リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4.引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等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及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。</p>
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(未適用の会計基準等)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1)概要

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」は、日本公認会計士協会における税効果会計に関する会計上の実務指針及び監査上の実務指針（会計処理に関する部分）を企業会計基準委員会に移管するに際して、企業会計基準委員会が、当該実務指針のうち主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について、企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積るという取扱いの枠組みを基本的に踏襲した上で、分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの一部について必要な見直しを行ったもので、繰延税金資産の回収可能性について、「税効果会計に係る会計基準」（企業会計審議会）を適用する際の指針を定めたものであります。

（分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの見直し）

- ・（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
- ・（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件
- ・（分類2）に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
- ・（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
- ・（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成28年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成27年3月31日現在)	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備                     - 器具備品                     11,634千円 リース資産                     578千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備                     16,731千円 器具備品                     17,133千円 リース資産                     2,893千円
2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア                     10,720千円	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア                     11,323千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

## (損益計算書関係)

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日								
1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額24,014千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額68,801千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	1. 移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額141,249千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額519,485千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。								
2. 当事業年度において、当社は以下の資産について減損損失を計上しました。 <table border="1" data-bbox="145 1350 746 1456"> <thead> <tr> <th>場所</th> <th>用途</th> <th>種類</th> <th>減損損失 (千円)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>東京都港区</td> <td>旧本社</td> <td>建物附属設備</td> <td>95,541</td> </tr> </tbody> </table> <p>旧本社については、本社移転の意思決定に伴い、移転予定日以降、将来の使用が見込まれなくなったため、建物に付帯する資産の帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として、特別損失に計上しております。</p> <p>なお、当該資産の回収可能価額の算定は、使用価値によっており、減損損失の認定時点から移転予定時までの減価償却費相当額を使用価値としております。</p>	場所	用途	種類	減損損失 (千円)	東京都港区	旧本社	建物附属設備	95,541	-
場所	用途	種類	減損損失 (千円)						
東京都港区	旧本社	建物附属設備	95,541						
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左								

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株あたりの配当額	基準日	効力発生日
平成28年3月24日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	483,870.96円	平成27年9月30日	平成28年3月25日

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの。  
該当ありません。

（リース取引関係）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
リース資産の内容 社用車両であります。	
リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	

（金融商品関係）

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

当社は、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成27年3月31日現在

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	8,366,245	8,366,245	

(2)未収委託者報酬	620,043	620,043	
(3)未収入金	631,179	631,179	
(4)長期差入保証金	80,034	35,636	44,398
(5)未払手数料	135,048	135,048	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(5)未払手数料

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

## (注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

平成28年3月31日現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	6,002,331	6,002,331	
(2)未収委託者報酬	544,116	544,116	
(3)未収入金	527,437	527,437	
(4)長期差入保証金	75,114	45,594	29,520
(5)未払手数料	112,932	112,932	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

預金は、すべて満期のない預金であり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(5)未払手数料

これらは短期間で決済され、時価は帳簿価額に近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

## (注3) 社債、長期借入金、リース債務およびその他の有利子負債の決算日後の返済予定額

記載すべき事項はありません。

## (有価証券関係)

前事業年度 (平成27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	38,658千円	貸借対照表計上額	6,448千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	311千円	に含まれた評価差額	1,448千円

## （デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
該当事項はありません。	同左

## （退職給付関係）

## 1．採用している退職給付制度の概要

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

## 2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付債務の期首残高	391,473
勤務費用	46,659
利息費用	3,914
数理計算上の差異の発生額	7,645
退職給付の支払額	8,106
退職給付債務の期末残高	426,295

（単位：千円）

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付債務の期首残高	426,295
勤務費用	46,270
利息費用	4,262
数理計算上の差異の発生額	20,018
退職給付の支払額	38,975
退職給付債務の期末残高	457,872

## 3．年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
年金資産の期首残高	278,789

期待運用収益	2,052
数理計算上の差異の発生額	11,804
事業主からの拠出額	50,203
退職給付の支払額	8,106
年金資産の期末残高	311,134

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
年金資産の期首残高	311,134
期待運用収益	2,295
数理計算上の差異の発生額	6,922
事業主からの拠出額	46,651
退職給付の支払額	38,975
年金資産の期末残高	328,027

## 4. 退職給付債務及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の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
積立型制度の退職給付債務	426,295
年金資産	311,134
	115,161
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	115,161
未認識数理計算上の差異	4,158
未認識過去勤務費用	52,329
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	58,673

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
積立型制度の退職給付債務	457,872
年金資産	328,027
	129,844
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	129,844
未認識数理計算上の差異	13,096
未認識過去勤務費用	43,608



貸借対照表に計上された負債と資産の純額	73,140
---------------------	--------

## 5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付費用	42,241
(1)勤務費用	46,659
(2)利息費用	3,914
(3)期待運用収益（減算）	2,052
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	15,002

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付費用	61,118
(1)勤務費用	46,270
(2)利息費用	4,262
(3)期待運用収益（減算）	2,295
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	4,158

## 6. 年金資産に関する事項

前事業年度（平成27年3月31日現在）

## 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.5%
その他	2.5%
合計	100.0%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（平成28年3月31日現在）

## 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.7%
その他	2.3%
合計	100.0%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

#### 7. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日現在)
(1) 割引率	1.0%
(2) 長期期待運用収益率	0.75%
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4) 過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5) 数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
(1) 割引率	0.0%
(2) 長期期待運用収益率	0.75%
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4) 過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5) 数理計算上の差異の処理年数	1年

(注) 当事業年度の期首時点において適用した割引率は1.0%でありましたが、期末時点において割引率の再検討を行った結果、割引率の変更により退職給付債務の額に重要な影響を及ぼすと判断し、割引率を0.0%に変更しております。

#### 8. 確定拠出制度

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)  
 当社の確定拠出制度への要拠出額は15,442千円であります。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)  
 当社の確定拠出制度への要拠出額は15,211千円であります。

#### (税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
(単位：千円)		(単位：千円)	
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	14,194	連結納税適用に伴う影響額	647,569
未払事業税	11,023	未払事業税	236,325
その他	64,681	賞与引当金繰入超過額	15,182
		その他	70,259
繰延税金資産(流動)合計	89,899	繰延税金資産(流動)合計	969,336
繰延税金負債(流動)との相殺	-	繰延税金負債(流動)との相殺	-
繰延税金資産(流動)の純額	89,899	繰延税金資産(流動)の純額	969,336
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
退職給付引当金	20,103	連結納税適用に伴う影響額	2,575,170
その他	3,610	退職給付引当金	23,491
		その他	7,754
繰延税金資産(固定)合計	23,714	繰延税金資産(固定)合計	2,606,416
繰延税金負債(固定)との相殺	-	繰延税金負債(固定)との相殺	-
繰延税金資産(固定)の純額	23,714	繰延税金資産(固定)の純額	2,606,416
繰延税金資産合計	113,613	繰延税金資産合計	3,575,752
繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)	
その他	-	その他	-
繰延税金負債(流動)合計	-	繰延税金負債(流動)合計	-
繰延税金資産(流動)との相殺	-	繰延税金資産(流動)との相殺	-
繰延税金負債(流動)の純額	-	繰延税金負債(流動)の純額	-
繰延税金負債(固定)		繰延税金負債(固定)	
事業譲受に係る調整項目	-	事業譲受に係る調整項目	-
繰延税金負債(固定)合計	-	繰延税金負債(固定)合計	-
繰延税金資産(固定)との相殺	-	繰延税金資産(固定)との相殺	-
繰延税金負債(固定)の純額	-	繰延税金負債(固定)の純額	-
繰延税金資産の純額	113,613	繰延税金資産の純額	3,575,752
=====		=====	

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の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	35.6%	法定実効税率	33.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.5%	交際費等永久に損金に算入されない項目	8.1%
その他	0.2%	税率変更差異	40.5%
		その他	3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	43.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	85.6%
	=====		=====

（税率変更に伴う影響）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は9,318千円減少し、法人税等調整額は9,318千円増加しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。この税率変更により、繰延税金資産は178,278千円減少し、法人税等調整額は178,278千円増加しております。

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
該当事項はありません。	同左

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する差入保証金および長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は89,966千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および本社オフィス移転に伴う新たな資産除去債務の発生により31,670千円増加しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## (1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

## (2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

## (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および旧オフィス賃借契約終了に伴う一部の資産除去債務の履行により54,624千円減少しております。

## （セグメント情報）

### 1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

### 2. セグメント関連情報

#### 1. 商品及びサービスに関する情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

#### 2. 地域に関する情報

##### 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

##### 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、記載を省略しております。

#### 3. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。

また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

#### （報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日											
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の所 有（被所有） 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払  投資顧問料の支払  人件費等の支払  事務手数料の受取  事務手数料の支払	162,092  107,442  286,824  24,014  84,588	未収入金  未払金	240,569  7,234
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ  兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託  事務所賃借料の支払  人件費等の支払	35,271  4,173  135,406	前払金	34,267
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取  投資顧問料の支払	440  5,521	-	-
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルグ大公国ルクセンブルグ市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	66,188	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	407	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日											
種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の所有 (被所有) 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼任等	事業上 の関係				

同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払  投資顧問料の支払  人件費等の支払  事務手数料の受取  事務手数料の支払	167,037  118,594  235,888  141,249  522,979	未収入金  未払金	228,410  205,912
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ  兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託  人件費等の支払	38,211  133,176	前払金	94,019
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取  投資顧問料の支払	399  10,659	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	290	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、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。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金額に基づき決定しております。
- 人件費及び事務所賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
- 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
- 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

#### 親会社又は重要な関連会社に関する注記

##### (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

##### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

##### (1株当たり情報)

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28年3月31日



1株当たり純資産 1,479,115円06銭 1株当たり当期純利益 91,476円79銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	1株当たり純資産 1,010,699円58銭 1株当たり当期純利益 15,455円49銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。
--	--

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
当期純利益 (千円)	567,156	95,824
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益 (千円)	567,156	95,824
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容

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

（参考）再信託受託会社

名 称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28年3月末現在）

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

#### (2) 販売会社

名 称	資本金の額	事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (平成28年3月末現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
楽天証券株式会社	7,495百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	47,937百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
フィデリティ証券株式会社	6,707百万円 (平成28年3月末現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託会社

受託会社は主として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

#### (2) 販売会社

当ファンドの販売会社として受益権の募集・売出しの取扱い等を行います。

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成28年10月6日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているAMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成28年2月23日から平成28年8月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）の平成28年8月22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（平成28年2月23日から平成28年8月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ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

( ) 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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年7月7日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 伊藤 雅人 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第19期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

( ) 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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。