

【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】 2019年11月20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 高村 孝

【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】 中川 祐子

【電話番号】 03 - 4530 - 7409

【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】 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、2019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」といいます。）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】

（５）【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.16%^{*}（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。申込手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

*消費税率が10%に引き上げられる場合は、2.2%になります。

<訂正後>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。申込手数料には消費税および地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）がかかります。詳細については、販売会社にお問い合わせください。

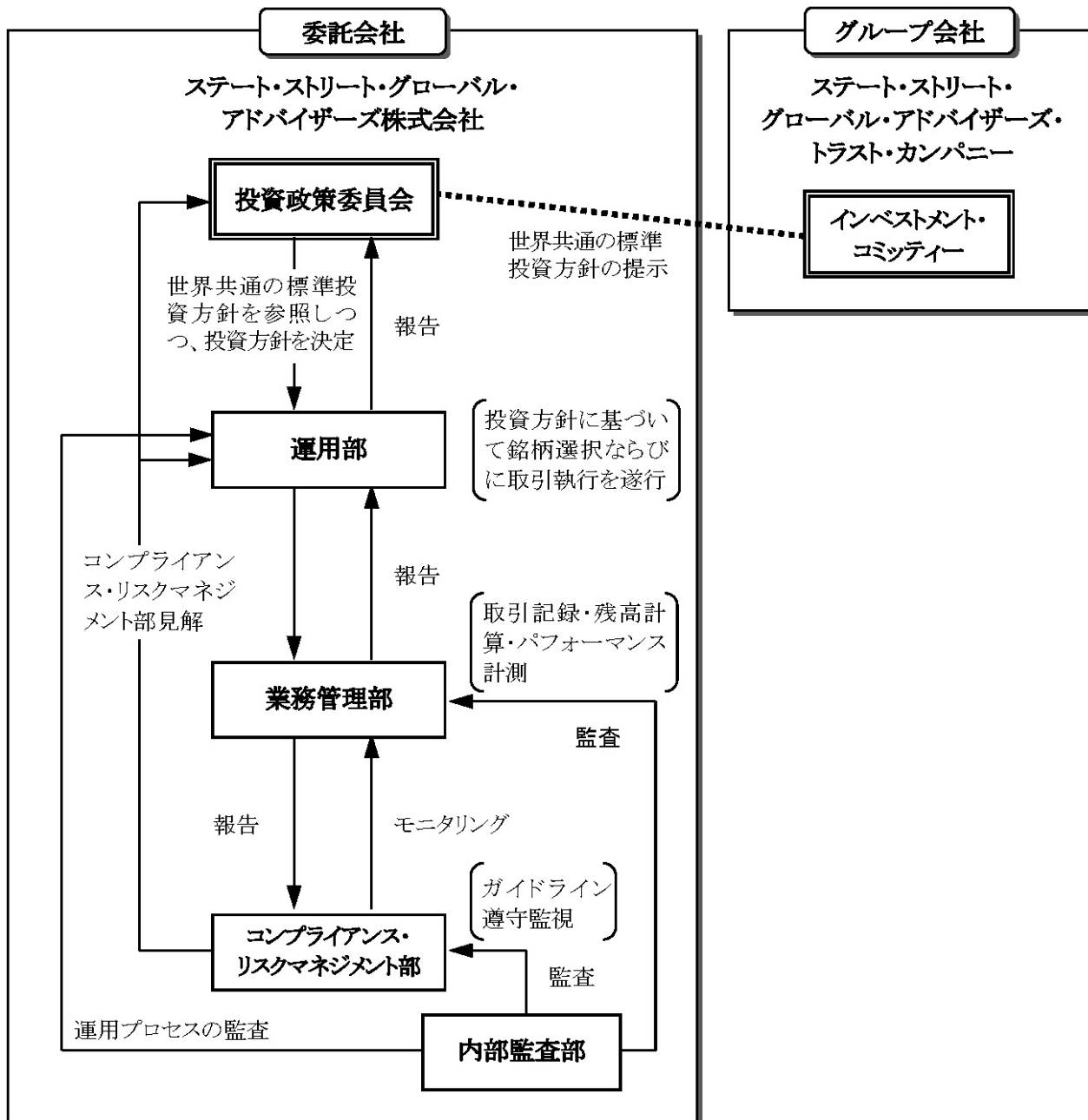
第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

2【投資方針】

（３）【運用体制】

<訂正前>



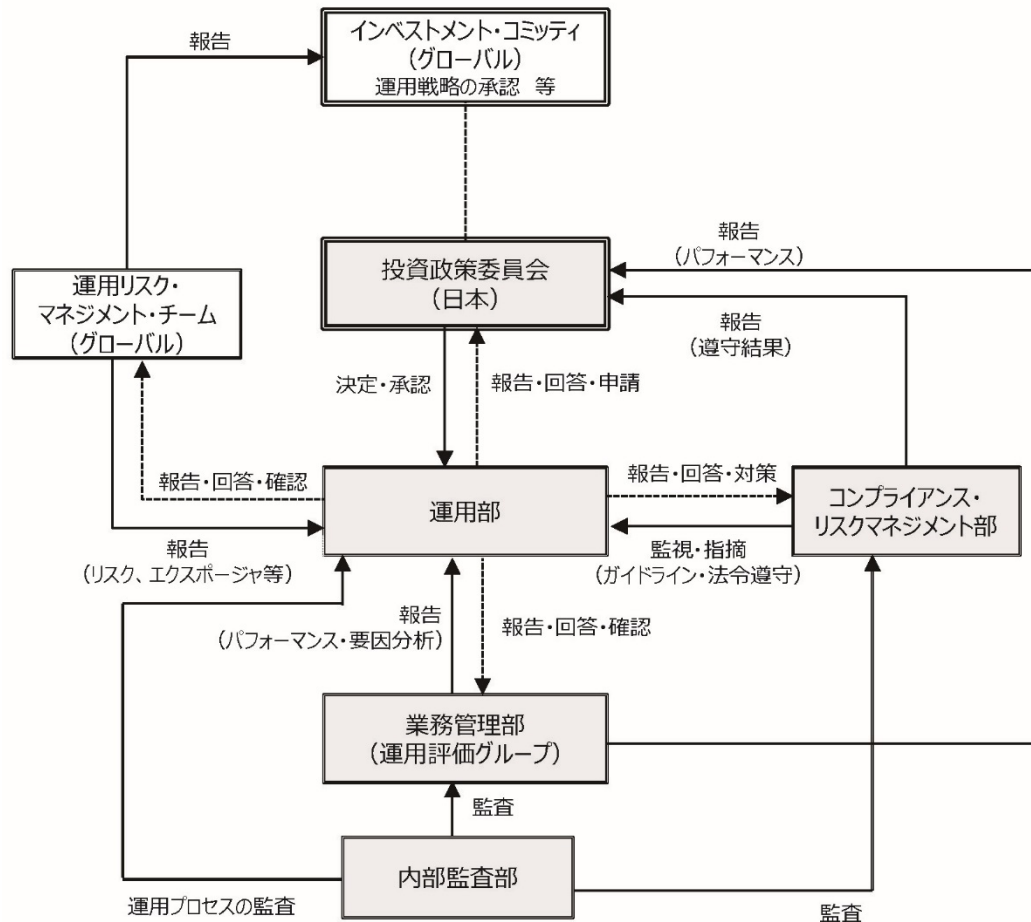
委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル/プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

< 略 >

< 訂正後 >



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理・運用を行っています。運用モデル/プロセスは基本的に、グループ会社、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・トラスト・カンパニー（所在地：アメリカ合衆国マサチューセッツ州ボストン市）を中心とした各運用戦略グループ全体で共通のものを使用し、またモデルの改善、運用パフォーマンス、市場環境に関する情報などについて海外運用拠点と十分なコミュニケーションをとることによって、質の高い運用サービスの提供を目指しています。

ファンド担当者は、いずれも国内外の有価証券市場に精通した経験豊富な投資運用の専門家であり、資産クラス・運用戦略ごとの運用チームに配置されています。また、チーム・アプローチによって運用を行うため、特定の担当者に依存することない安定した運用体制となっています。

運用の報告は、投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部の代表等により構成されています。投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、ガイドラインに対する適合性、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

グローバルには、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ（SSGA）のグローバル組織である運用リスク・マネジメント・チームが、ポートフォリオの運用リスクモニタリングを定期的に行っています。当チームは運用チームとは独立した組織で、SSGAグローバルのチーフ・リスク・オフィサーに直接報告を行っており、ポートフォリオが顧客のガイドラインや運用戦略に即したリスクをとっているか、また目標リターンに見合ったリスクをとっているか、リスクに対する寄与が意図したエクスポージャーによるものか否か等、運用戦略の中身に実質的にフォーカスしたかたちでモニタリングを行い、その結果は継続的に運用担当チームにフィードバックされています。

当チームが行った戦略代表口座の分析結果は、インベストメント・コミッティ（グローバル）およびグローバルの運用戦略責任者によってレビューされています。

< 略 >

3【投資リスク】

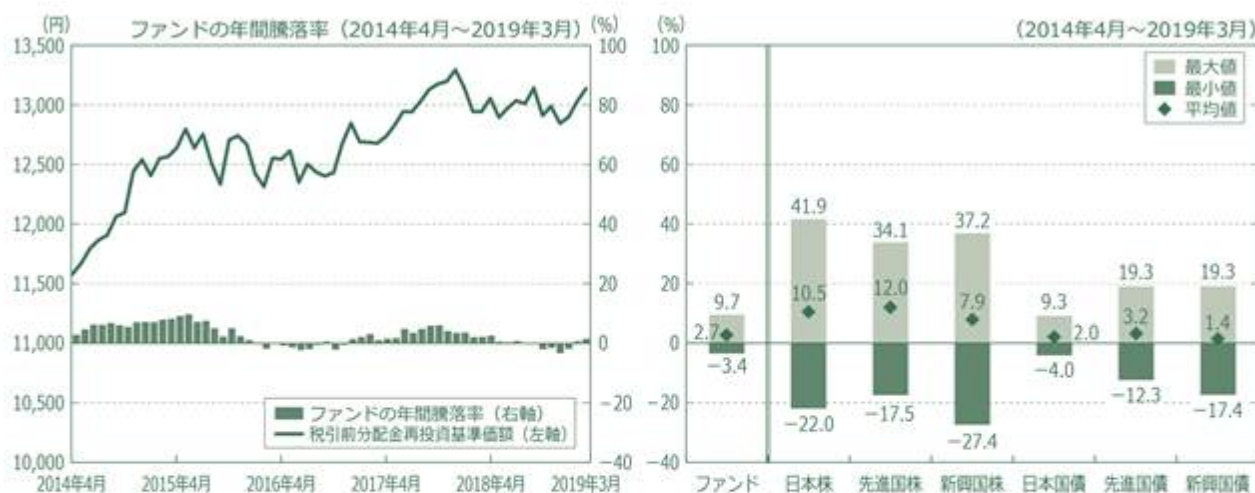
< 訂正前 >

(1) ~ (3) < 略 >

＜参考情報＞ 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

＜ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移＞ ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
 - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
 - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
 - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
 - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小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います。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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東京証券取引所に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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。

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

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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＞

(1) ~ (3) <略>

＜参考情報＞代表的な資産クラスと騰落率の比較等

投資リスクに関する参考情報として、ファンドのリスクの定量的な把握・比較を目的に下記のグラフを作成しています。

＜ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移＞ ＜ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較＞



- ・上記の左グラフは、各月末におけるファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
 - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
 - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
 - ・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されていますので、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
 - ・上記の右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小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います。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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東京証券取引所に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。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。

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

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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】

(1)【申込手数料】

< 訂正前 >

申込手数料（購入時手数料）は、取得申込受付日（購入申込受付日）の翌営業日の基準価額に $2.16\%^{*}$ （税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。

*消費税率が10%に引き上げられる場合は、2.2%になります。

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

< 略 >

< 訂正後 >

申込手数料（購入時手数料）は、取得申込受付日（購入申込受付日）の翌営業日の基準価額に 2.2% （税抜2.0%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。

購入時手数料は販売会社によるファンドの募集・販売の事務等の対価です。

< 略 >

（3）【信託報酬等】

< 訂正前 >

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率 $0.81\%^{*}$ （税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

*消費税率が10%に引き上げられる場合は、年率0.825%になります。

< 略 >

< 訂正後 >

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に年率 0.825% （税抜0.75%）の信託報酬率を乗じて得た額とします。

< 略 >

（5）【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

上記は、2019年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

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

上記は、2019年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

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】

(2019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	3,861,253,532	85.24
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		668,714,675	14.76
純資産総額		4,529,968,207	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)

(2019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	90,343,334,160	97.20
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		2,605,637,925	2.80
純資産総額		92,948,972,085	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)

(2019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	131,935,033,000	81.88
特殊債券	日本	13,987,326,657	8.68
地方債証券	日本	9,741,346,150	6.05
社債券	日本	4,895,007,800	3.04
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		568,458,490	0.35
純資産総額		161,127,172,097	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)

(2019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	106,817,188,037	64.47
	イギリス	9,552,545,400	5.77
	フランス	6,482,174,067	3.91
	カナダ	6,140,794,486	3.71
	スイス	5,558,561,882	3.35
	ドイツ	5,021,791,179	3.03
	オーストラリア	3,871,096,091	2.34
	オランダ	2,343,977,260	1.41
	香港	1,965,998,684	1.19
	スペイン	1,707,728,302	1.03
	スウェーデン	1,498,650,794	0.90
	イタリア	1,390,092,062	0.84

	デンマーク	1,051,117,855	0.63
	シンガポール	670,994,960	0.40
	ベルギー	600,575,038	0.36
	フィンランド	571,851,798	0.35
	ノルウェー	385,423,794	0.23
	イスラエル	329,825,408	0.20
	アイルランド	310,562,321	0.19
	ニュージーランド	137,661,853	0.08
	オーストリア	127,703,469	0.08
	ポルトガル	95,629,698	0.06
	小計	156,631,944,438	94.53
投資証券	アメリカ	3,745,122,700	2.26
	オーストラリア	289,622,030	0.17
	フランス	172,686,245	0.10
	イギリス	101,025,509	0.06
	香港	96,568,879	0.06
	シンガポール	74,918,159	0.05
	カナダ	27,474,522	0.02
	小計	4,507,418,044	2.72
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		4,549,554,019	2.75
純資産総額		165,688,916,501	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)

(2019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	83,968,121,693	47.40
	フランス	17,363,632,018	9.80
	イタリア	15,996,454,503	9.03
	ドイツ	11,240,997,776	6.35
	イギリス	11,215,241,355	6.33
	スペイン	9,848,133,019	5.56
	ベルギー	4,384,088,108	2.48
	オーストラリア	3,511,232,069	1.98
	カナダ	3,398,604,295	1.92
	オランダ	3,248,798,405	1.83
	オーストリア	2,435,849,833	1.38
	メキシコ	1,381,460,426	0.78
	アイルランド	1,272,350,784	0.72
	フィンランド	987,720,305	0.56
	ポーランド	981,633,192	0.55
	南アフリカ	952,896,250	0.54
	デンマーク	909,345,811	0.51
	マレーシア	829,609,887	0.47
	シンガポール	747,272,677	0.42
	スウェーデン	591,579,080	0.33
ノルウェー	403,491,034	0.23	
	小計	175,668,512,520	99.17

コール・ローン、その他資産(負債控除後)	1,473,997,390	0.83
純資産総額	177,142,509,910	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】

(2019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	外国債券インデックス・マザー・ファンド		871,829,698	2.2830	1,990,460,572	2.3514	2,050,020,351	45.26
2	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		1,031,844,600	1.2878	1,328,825,273	1.3110	1,352,748,270	29.86
3	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		86,923,541	2.6406	229,538,400	2.6704	232,120,623	5.12
4	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		83,600,210	2.6077	218,005,967	2.7077	226,364,288	5.00
投資比率：合計										85.24

(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		85.24
合計		85.24

(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)

(2019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	443,000	6,608.13	2,927,401,590	7,216.00	3,196,688,000	3.44
2	日本	株式	ソニー	電気機器	266,900	5,345.67	1,426,759,323	6,347.00	1,694,014,300	1.82
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	2,699,000	577.59	1,558,915,410	548.40	1,480,131,600	1.59
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	266,800	4,808.86	1,283,003,848	5,156.00	1,375,620,800	1.48
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	309,500	5,236.37	1,620,656,515	4,240.00	1,312,280,000	1.41
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	19,500	67,588.25	1,317,970,875	66,900.00	1,304,550,000	1.40
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	347,000	4,613.78	1,600,981,660	3,690.00	1,280,430,000	1.38

8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	276,300	3,964.05	1,095,267,015	3,695.00	1,020,928,500	1.10
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	335,300	3,065.68	1,027,922,504	2,798.50	938,337,050	1.01
10	日本	株式	任天堂	その他製品	22,700	31,057.54	705,006,158	40,020.00	908,454,000	0.98
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	319,800	2,661.02	850,994,196	2,825.00	903,435,000	0.97
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	272,100	3,188.47	867,582,687	3,286.00	894,120,600	0.96
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,327,400	174.59	930,110,766	165.60	882,217,440	0.95
14	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	140,200	5,384.23	754,869,046	5,779.00	810,215,800	0.87
15	日本	株式	信越化学工業	化学	68,600	9,446.83	648,052,538	11,560.00	793,016,000	0.85
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	35,600	24,550.81	874,008,836	22,220.00	791,032,000	0.85
17	日本	株式	第一三共	医薬品	113,800	4,431.43	504,296,734	6,804.00	774,295,200	0.83
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	54,300	12,689.11	689,018,673	14,180.00	769,974,000	0.83
19	日本	株式	ファナック	電気機器	37,800	19,231.33	726,944,274	20,340.00	768,852,000	0.83
20	日本	株式	花王	化学	95,200	8,616.67	820,306,984	7,984.00	760,076,800	0.82
21	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	44,900	12,306.04	552,541,196	16,440.00	738,156,000	0.79
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	274,700	3,124.43	858,280,921	2,651.00	728,229,700	0.78
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	70,000	10,596.23	741,736,100	10,310.00	721,700,000	0.78
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	178,900	3,369.94	602,882,266	4,023.00	719,714,700	0.77
25	日本	株式	HOYA	精密機器	80,000	7,370.14	589,611,200	8,819.00	705,520,000	0.76
26	日本	株式	日本電産	電気機器	47,800	13,774.85	658,437,830	14,520.00	694,056,000	0.75
27	日本	株式	資生堂	化学	79,000	7,792.65	615,619,350	8,629.00	681,691,000	0.73
28	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	247,000	2,559.00	632,073,000	2,753.00	679,991,000	0.73
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	164,100	4,623.23	758,672,043	4,132.00	678,061,200	0.73
30	日本	株式	村田製作所	電気機器	125,100	6,004.43	751,154,193	5,185.00	648,643,500	0.70
									投資比率：合計	31.89

(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	13.65
	情報・通信業	8.31
	輸送用機器	7.64
	化学	7.06
	銀行業	5.71
	医薬品	5.38
	サービス業	5.05
	機械	4.90
	卸売業	4.72
	小売業	4.67
	陸運業	4.58
	食料品	3.95
	建設業	2.81
	不動産業	2.48
	保険業	2.25

その他製品	2.19
精密機器	2.18
電気・ガス業	1.60
その他金融業	1.10
ガラス・土石製品	0.79
証券、商品先物取引業	0.76
鉄鋼	0.75
ゴム製品	0.74
非鉄金属	0.73
繊維製品	0.64
石油・石炭製品	0.55
金属製品	0.54
空運業	0.51
鉱業	0.27
パルプ・紙	0.24
倉庫・運輸関連業	0.19
海運業	0.16
水産・農林業	0.10
合 計	97.20

（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) (2019年12月限)	大阪取引所	買建	154	2,413,764,792	2,445,520,000	2.63

（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）

（2019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139回利付 国債(5年)	0.100	2024/03/20	2,500,000,000	101.32	2,533,069,000	102.08	2,552,175,000	1.58
2	日本	国債 証券	第399回利付 国債(2年)	0.100	2021/04/01	2,000,000,000	100.49	2,009,800,000	100.61	2,012,340,000	1.25
3	日本	国債 証券	第9回利付国債 (40年)	0.400	2056/03/20	1,960,000,000	90.55	1,774,794,400	99.68	1,953,767,200	1.21
4	日本	国債 証券	第135回利付 国債(5年)	0.100	2023/03/20	1,900,000,000	101.03	1,919,684,000	101.63	1,931,008,000	1.20
5	日本	国債 証券	第129回利付 国債(5年)	0.100	2021/09/20	1,750,000,000	100.62	1,760,937,500	100.84	1,764,735,000	1.10
6	日本	国債 証券	第136回利付 国債(5年)	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	101.10	1,718,717,000	101.79	1,730,430,000	1.07

7	日本	国債証券	第137回利付 国債（5年）	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	101.14	1,567,716,500	101.85	1,578,706,000	0.98
8	日本	国債証券	第351回利付 国債（10年）	0.100	2028/06/20	1,500,000,000	101.99	1,529,973,000	103.62	1,554,405,000	0.96
9	日本	国債証券	第353回利付 国債（10年）	0.100	2028/12/20	1,500,000,000	101.00	1,515,134,000	103.44	1,551,735,000	0.96
10	日本	国債証券	第340回利付 国債（10年）	0.400	2025/09/20	1,480,000,000	103.57	1,532,836,000	104.63	1,548,612,800	0.96
11	日本	国債証券	第134回利付 国債（5年）	0.100	2022/12/20	1,500,000,000	100.97	1,514,580,000	101.49	1,522,470,000	0.94
12	日本	国債証券	第133回利付 国債（5年）	0.100	2022/09/20	1,500,000,000	100.90	1,513,620,000	101.36	1,520,475,000	0.94
13	日本	国債証券	第132回利付 国債（5年）	0.100	2022/06/20	1,500,000,000	100.82	1,512,390,000	101.22	1,518,300,000	0.94
14	日本	国債証券	第349回利付 国債（10年）	0.100	2027/12/20	1,460,000,000	101.60	1,483,442,800	103.67	1,513,669,600	0.94
15	日本	国債証券	第350回利付 国債（10年）	0.100	2028/03/20	1,410,000,000	101.36	1,429,190,100	103.65	1,461,521,400	0.91
16	日本	国債証券	第341回利付 国債（10年）	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	103.02	1,339,267,000	104.23	1,355,003,000	0.84
17	日本	国債証券	第355回利付 国債（10年）	0.100	2029/06/20	1,300,000,000	103.07	1,339,931,000	103.22	1,341,964,000	0.83
18	日本	国債証券	第401回利付 国債（2年）	0.100	2021/06/01	1,300,000,000	100.60	1,307,839,000	100.69	1,309,022,000	0.81
19	日本	国債証券	第348回利付 国債（10年）	0.100	2027/09/20	1,200,000,000	101.62	1,219,494,000	103.64	1,243,752,000	0.77
20	日本	国債証券	第346回利付 国債（10年）	0.100	2027/03/20	1,200,000,000	102.43	1,229,162,000	103.52	1,242,348,000	0.77
21	日本	国債証券	第344回利付 国債（10年）	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	101.71	1,220,556,000	103.28	1,239,456,000	0.77
22	日本	国債証券	第343回利付 国債（10年）	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	101.73	1,220,760,000	103.20	1,238,424,000	0.77
23	日本	国債証券	第130回利付 国債（5年）	0.100	2021/12/20	1,200,000,000	100.68	1,208,232,000	100.96	1,211,532,000	0.75
24	日本	国債証券	第352回利付 国債（10年）	0.100	2028/09/20	1,160,000,000	101.09	1,172,676,000	103.54	1,201,098,800	0.75
25	日本	国債証券	第131回利付 国債（5年）	0.100	2022/03/20	1,100,000,000	100.76	1,108,360,000	101.09	1,112,034,000	0.69
26	日本	国債証券	第154回利付 国債（20年）	1.200	2035/09/20	940,000,000	114.63	1,077,571,600	118.12	1,110,384,400	0.69
27	日本	国債証券	第336回利付 国債（10年）	0.500	2024/12/20	1,000,000,000	103.76	1,037,670,000	104.57	1,045,740,000	0.65
28	日本	国債証券	第337回利付 国債（10年）	0.300	2024/12/20	1,000,000,000	102.61	1,026,122,000	103.51	1,035,100,000	0.64
29	日本	国債証券	第345回利付 国債（10年）	0.100	2026/12/20	1,000,000,000	101.69	1,016,900,000	103.40	1,034,090,000	0.64
30	日本	国債証券	第354回利付 国債（10年）	0.100	2029/03/20	1,000,000,000	102.17	1,021,752,000	103.34	1,033,430,000	0.64
										投資比率：合計	26.95

（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		81.88
特殊債券		8.68
地方債証券		6.05
社債券		3.04
合計		99.65

（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）

（2019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	181,967	19,570.21	3,561,132,912	23,615.05	4,297,160,604	2.59
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	288,132	12,125.60	3,493,773,381	14,863.82	4,282,742,645	2.58
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	16,488	183,128.24	3,019,418,557	186,210.56	3,070,239,779	1.85
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	94,352	15,459.88	1,458,670,878	19,112.63	1,803,315,054	1.09
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	12,481	117,885.50	1,471,328,944	132,211.71	1,650,134,387	1.00
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	129,490	11,905.20	1,541,605,433	12,704.34	1,645,085,297	0.99
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	11,812	118,492.10	1,399,628,802	132,304.52	1,562,781,037	0.94
8	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	105,325	15,685.41	1,652,066,528	13,878.51	1,461,754,276	0.88
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	121,189	9,430.61	1,142,887,072	11,726.37	1,421,107,781	0.86
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	98,939	10,208.46	1,010,015,750	13,443.59	1,330,095,786	0.80
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	69,195	15,329.58	1,060,730,948	18,778.07	1,299,349,245	0.78
12	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	167,551	8,507.54	1,425,448,295	7,714.12	1,292,508,788	0.78
13	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	288,183	3,326.55	958,655,228	4,039.44	1,164,099,551	0.70
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	51,534	23,439.22	1,207,917,079	22,388.00	1,153,743,398	0.70
15	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	356,387	3,035.78	1,081,915,948	3,167.45	1,128,838,715	0.68
16	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	43,439	19,262.64	836,749,853	24,806.49	1,077,569,171	0.65
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	163,484	6,397.38	1,045,870,127	6,507.57	1,063,884,554	0.64
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	36,114	21,863.93	789,594,115	29,044.50	1,048,913,419	0.63
19	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	71,164	12,624.19	898,388,363	14,025.28	998,095,253	0.60
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	177,928	5,147.18	915,828,917	5,480.17	975,077,040	0.59
21	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	75,195	12,870.35	967,786,359	12,799.31	962,444,265	0.58

22	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	160,707	5,310.41	853,420,148	5,861.13	941,925,454	0.57
23	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	170,997	5,767.65	986,251,939	5,472.62	935,802,149	0.56
24	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	102,160	8,446.25	862,869,919	8,947.64	914,091,637	0.55
25	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	168,782	5,189.87	875,957,110	5,270.81	889,618,326	0.54
26	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	37,991	30,178.75	1,146,521,014	23,230.85	882,563,571	0.53
27	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	21,270	37,074.13	788,566,821	41,318.25	878,839,203	0.53
28	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	27,814	27,853.33	774,712,636	31,422.76	873,992,869	0.53
29	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア・娯楽	178,712	4,291.03	766,859,532	4,835.89	864,232,502	0.52
30	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	219,588	4,886.71	1,073,064,324	3,908.86	858,339,276	0.52
									投資比率：合計	25.76

(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) 2019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	ソフトウェア・サービス	9.15
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.77
	銀行	7.69
	資本財	6.85
	メディア・娯楽	5.74
	エネルギー	5.47
	食品・飲料・タバコ	4.89
	小売	4.75
	ヘルスケア機器・サービス	4.57
	各種金融	4.21
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.21
	素材	4.19
	保険	3.86
	公益事業	3.64
	半導体・半導体製造装置	2.97
	電気通信サービス	2.44
	家庭用品・パーソナル用品	2.18
	運輸	1.89
	耐久消費財・アパレル	1.87
	消費者サービス	1.84
食品・生活必需品小売り	1.55	
商業・専門サービス	1.24	
自動車・自動車部品	1.05	
不動産	0.51	

	小 計	94.53
投資証券		2.72
合 計		97.25

(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) 2019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	187	28,111,425.03	27,711,530.00	2,990,628,317	1.80
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	125	4,390,415.30	4,412,500.00	520,763,250	0.31
	FTSE100INDEX	インターコンチネンタル取引所	買建	イギリス・ポンド	31	2,265,767.94	2,290,435.00	303,917,820	0.18
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	11	2,192,230.90	2,192,960.00	178,704,310	0.11
	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	15	1,493,000.00	1,501,650.00	163,499,652	0.10
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	13	2,164,500.00	2,175,875.00	158,577,770	0.10

(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（2019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）

（2019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	1.375	2021/01/31	15,000,000	10,597.44	1,589,616,324	10,735.08	1,610,263,355	0.91
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2021/06/30	11,000,000	10,473.85	1,152,123,500	10,685.34	1,175,387,918	0.66
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2021/07/31	11,000,000	10,562.13	1,161,834,344	10,685.34	1,175,387,918	0.66
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/11/30	10,200,000	10,692.49	1,090,634,771	10,814.76	1,103,105,971	0.62
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2023/11/15	9,100,000	11,023.25	1,003,115,893	11,296.61	1,027,991,534	0.58
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/09/30	9,500,000	10,701.34	1,016,627,984	10,811.81	1,027,122,279	0.58
7	イタリア	国債証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	3.750	2021/03/01	8,200,000	12,503.04	1,025,249,476	12,481.33	1,023,469,540	0.58
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2024/05/31	9,000,000	10,832.93	974,964,456	11,010.79	990,971,186	0.56
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2021/03/31	9,000,000	10,735.12	966,161,354	10,872.51	978,526,661	0.55

10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	10,762.96	968,667,256	10,868.72	978,185,198	0.55
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2021/06/15	8,650,000	10,959.31	947,980,662	10,958.51	947,911,738	0.54
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2021/12/15	8,500,000	10,907.50	927,138,190	11,030.18	937,565,536	0.53
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/02/28	8,500,000	10,682.78	908,036,721	10,829.51	920,509,118	0.52
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2022/03/15	8,000,000	10,949.66	875,973,150	10,998.98	879,918,977	0.50
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	12,349.28	889,148,563	12,208.45	879,008,400	0.50
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/05/31	8,100,000	10,675.60	864,724,024	10,843.00	878,283,731	0.50
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2021/08/15	8,000,000	10,697.57	855,805,600	10,879.68	870,374,800	0.49
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/11/15	8,000,000	10,656.87	852,549,755	10,872.94	869,835,200	0.49
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/09/30	8,000,000	10,523.06	841,845,068	10,846.38	867,710,522	0.49
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2023/08/31	7,500,000	10,981.97	823,648,020	11,273.84	845,538,447	0.48
21	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.750	2021/04/25	6,600,000	12,832.94	846,974,235	12,632.73	833,760,244	0.47
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	7,500,000	11,023.05	826,729,254	11,065.17	829,887,937	0.47
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.125	2021/05/15	7,500,000	10,937.90	820,343,088	11,033.97	827,548,269	0.47
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2021/10/31	7,700,000	10,650.62	820,098,109	10,704.31	824,232,255	0.47
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	7,500,000	10,805.92	810,444,126	10,888.53	816,640,333	0.46
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/31	7,500,000	10,773.31	807,998,304	10,833.31	812,498,480	0.46
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2021/04/30	7,500,000	10,606.24	795,468,179	10,733.82	805,036,831	0.45
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2028/08/15	6,700,000	11,297.38	756,925,010	11,865.29	794,974,970	0.45
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2023/12/31	7,000,000	10,814.64	757,025,021	11,092.99	776,509,688	0.44
30	フランス	国債証券	FRENCH GOVERNMENT BOND	3.250	2021/10/25	6,000,000	12,952.58	777,155,326	12,781.99	766,919,452	0.43
										投資比率：合計	15.86

(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) 2019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		99.17
合計		99.17

(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) 2019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】

2019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	(2013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	(2014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	(2015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	(2016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
第5期	(2017年 2月20日)	分配付：	3,353,263,422	分配付：	1.2368
		分配落：	3,315,305,934	分配落：	1.2228
第6期	(2018年 2月20日)	分配付：	4,218,203,352	分配付：	1.2495
		分配落：	4,167,563,611	分配落：	1.2345
第7期	(2019年 2月20日)	分配付：	4,251,424,588	分配付：	1.2434
		分配落：	4,213,813,566	分配落：	1.2324
2018年 9月末日			4,301,319,811		1.2537
10月末日			4,206,943,142		1.2315
11月末日			4,237,123,413		1.2390
12月末日			4,187,868,557		1.2253
2019年 1月末日			4,204,461,583		1.2303
2月末日			4,247,694,442		1.2323
3月末日			4,279,855,446		1.2420
4月末日			4,274,648,722		1.2422
5月末日			4,242,072,400		1.2311
6月末日			4,293,421,683		1.2437
7月末日			4,503,721,784		1.2471
8月末日			4,516,333,151		1.2496
9月末日			4,529,968,207		1.2531

【分配の推移】

計算期間	一口当たりの分配金
第1期 自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	0.0000円
第2期 自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	0.0050円
第3期 自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円
第4期 自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期 自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期 自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円

第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
-----	------------------------------	---------

【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	6.7%
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	8.6%
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
	自2019年 2月21日 至2019年 8月20日	1.1%

(注) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末の分配基準価額（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2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
	自2019年 2月21日 至2019年 8月20日	230,025,597	34,053,163	3,615,156,275

(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

(2019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。分配金再投資基準価額は税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	12,531円
純資産総額	4,530百万円

分配の推移

決算期	分配金
第3期 (2015年2月20日)	160円
第4期 (2016年2月22日)	70円
第5期 (2017年2月20日)	140円
第6期 (2018年2月20日)	150円
第7期 (2019年2月20日)	110円
設定来累計	680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
外国債券 インデックス・マザー・ファンド	45.26%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.375%	2021/01/31	0.91%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.125%	2021/06/30	0.66%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.125%	2021/07/31	0.66%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	29.86%	第139回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2024/03/20	1.58%
		第399回利付国債(2年)	日本	国債証券	—	0.100%	2021/04/01	1.25%
		第9回利付国債(40年)	日本	国債証券	—	0.400%	2056/03/20	1.21%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	5.12%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.44%
		ソニー	日本	株式	電気機器	—	—	1.82%
		三菱UFJ フィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	—	—	1.59%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.00%	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	—	—	2.59%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	2.58%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	1.85%

※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。

※2012年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2019年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から9月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

※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いません。

- 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。

(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(2019年2月21日から2019年8月20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 (2019年 2月20日現在)	当中間計算期間末 (2019年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,119,066	5,389
コール・ローン	643,159,407	690,909,337
親投資信託受益証券	3,620,626,218	3,829,866,683
流動資産合計	4,268,904,691	4,520,781,409
資産合計		
	4,268,904,691	4,520,781,409
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,611,022	-
未払解約金	402	64,647
未払受託者報酬	1,149,832	1,152,923
未払委託者報酬	16,097,634	16,140,821
未払利息	1,640	1,900
その他未払費用	230,595	230,918
流動負債合計	55,091,125	17,591,209
負債合計		
	55,091,125	17,591,209
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,419,183,841	1 3,615,156,275
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	794,629,725	888,033,925
(分配準備積立金)	151,281,087	149,815,226
元本等合計	4,213,813,566	4,503,190,200
純資産合計		
	4,213,813,566	4,503,190,200
負債純資産合計		
	4,268,904,691	4,520,781,409

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2018年 2月21日 至 2018年 8月20日	当中間計算期間 自 2019年 2月21日 至 2019年 8月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,357,536	63,840,465
営業収益合計	6,357,536	63,840,465
営業費用		
支払利息	261,266	295,995
受託者報酬	1,134,398	1,152,923
委託者報酬	15,881,443	16,140,821
その他費用	261,548	240,818
営業費用合計	17,538,655	17,830,557
営業利益又は営業損失（ ）	11,181,119	46,009,908
経常利益又は経常損失（ ）	11,181,119	46,009,908
中間純利益又は中間純損失（ ）	11,181,119	46,009,908
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（ ）	152,364	311,919
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	791,580,845	794,629,725
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,612,964	55,606,305
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,612,964	55,606,305
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,534,431	7,900,094
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,534,431	7,900,094
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	793,325,895	888,033,925

(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。
-------------------	--

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 (2019年 2月20日現在)	当中間計算期間末 (2019年 8月20日現在)
1 期首元本額	3,375,982,766円	3,419,183,841円
期中追加設定元本額	128,819,369円	230,025,597円
期中一部解約元本額	85,618,294円	34,053,163円
2 受益権の総数	3,419,183,841口	3,615,156,275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 (2019年 2月20日現在)	当中間計算期間末 (2019年 8月20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	<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 該当する事項はありません。</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	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）

	前計算期間末 (2019年 2月20日現在)	当中間計算期間末 (2019年 8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2324円 (12,324円)	1.2456円 (12,456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	(2019年 2月20日現在) 金 額	(2019年 8月20日現在) 金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		21,413,135	25,201
コール・ローン		2,690,346,033	3,230,898,216
株式		87,254,422,410	87,330,309,170
派生商品評価勘定		122,902,528	2,887,780
未収入金		36,000,000	
未収配当金		141,135,756	136,836,243
前払金			151,982,000
差入委託証拠金		85,095,000	113,850,000
流動資産合計		90,351,314,862	90,966,788,610
資産合計		90,351,314,862	90,966,788,610
負債の部			
流動負債			
前受金		108,325,000	

派生商品評価勘定			131,364,228
未払金			1,777,184
未払解約金		19,940,000	15,000,000
未払利息		6,862	8,887
その他未払費用		3,070	1,804
流動負債合計		128,274,932	148,152,103
負債合計		128,274,932	148,152,103
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,028,428,491	36,195,997,042
剰余金			
剰余金又は欠損金()		56,194,611,439	54,622,639,465
元本等合計		90,223,039,930	90,818,636,507
純資産合計		90,223,039,930	90,818,636,507
負債純資産合計		90,351,314,862	90,966,788,610

(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	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
1 期首元本額	41,667,325,452円	34,028,428,491円
期中追加設定元本額	10,521,493,768円	5,008,083,528円
期中一部解約元本額	18,160,390,729円	2,840,514,977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)	81,664,824円	86,923,541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＞	856,940,904円	920,842,870円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	4,365,158円	3,079,474円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	141,670,799円	125,765,321円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	121,013円	121,280円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	4,426,507円	4,462,057円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	11,202,501円	9,091,649円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	7,241,529,595円	7,030,934,074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＞	426,392,515円	396,504,694円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,648,845円	5,670,280円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,271,582,169円	1,206,566,423円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	802,871,113円	777,779,244円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	56,116,211円	56,500,386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＞	950,217,271円	977,453,398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＞	7,344,621,937円	7,184,881,718円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	58,645,273円	231,020,164円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	731,722,264円	2,376,414,375円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	199,034,584円	434,379,854円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,093,887,155円	1,966,115,589円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	62,460,294円	57,059,671円
世界4資産バランスVA45＜適格機関投資家限定＞	162,484,745円	97,838,831円
日本株式インデックス・ファンドF OF＜適格機関投資家限定＞	4,801,801,587円	4,734,156,316円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	17,668,545円	17,942,287円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	19,453,793円	20,095,667円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	8,090,499円	11,431,725円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	580,693,532円	568,583,156円

バランスファンドVA20A<適格 機関投資家限定>	3,343,682円	3,081,872円
バランスファンドVA35B<適格 機関投資家限定>	3,384,173円	3,325,302円
バランスファンドVA10A<適格 機関投資家限定>	38,762,912円	29,802,040円
日本株式インデックス・ファンドV A2<適格機関投資家限定>	1,339,409,071円	2,099,263,955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>	367,591,206円	353,715,909円
世界分散ファンドVA25A<適格 機関投資家限定>	1,683,985,611円	1,606,450,347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>	87,285,437円	88,847,304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>	158,424,927円	128,087,598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>	77,152,734円	78,424,678円
ステート・ストリート日本株式イン デックス・オープン	1,995,324,541円	2,193,814,475円
グローバルバランス40VA<適格 機関投資家限定>	1,039,453円	573,244円
グローバルバランス40VA2<適 格機関投資家限定>	286,917,026円	277,535,390円
グローバルバランス40VA3<適 格機関投資家限定>	23,221,746円	23,764,430円
グローバルバランス50VA<適格 機関投資家限定>	7,279,937円	7,696,454円
ワールドバランスVA0902<適 格機関投資家限定>	18,992,402円	円
計	34,028,428,491円	36,195,997,042円
2 受益権の総数	34,028,428,491口	36,195,997,042口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20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	（2019年 2月20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）	2,929,325,000		3,052,350,000	123,025,000
	合 計	2,929,325,000		3,052,350,000	123,025,000

(単位:円)

区 分	種 類	(2019年 8月20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)	3,529,630,000		3,401,300,000	128,330,000
	合 計	3,529,630,000		3,401,300,000	128,330,000

(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)

	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6514円 (26,514円)	2.5091円 (25,091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	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		6,348,210	137,070
コール・ローン		765,794,398	939,176,931
国債証券		126,300,082,900	141,940,212,000
地方債証券		9,741,616,281	10,488,306,928
特殊債券		13,775,783,507	15,031,926,549
社債券		5,250,780,400	4,939,224,900
未収利息		425,665,291	427,397,964
前払費用		4,497,000	12,354,291
流動資産合計		156,270,567,987	173,778,736,633
資産合計		156,270,567,987	173,778,736,633
負債の部			
流動負債			
未払金		355,226,000	
未払解約金		26,530,212	629,473,814
未払利息		1,953	2,583
その他未払費用		1,342	789
流動負債合計		381,759,507	629,477,186
負債合計		381,759,507	629,477,186
純資産の部			

元本等			
元本	1	121,137,400,893	131,140,918,184
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		34,751,407,587	42,008,341,263
元本等合計		155,888,808,480	173,149,259,447
純資産合計		155,888,808,480	173,149,259,447
負債純資産合計		156,270,567,987	173,778,736,633

（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	（2019年 2月20日現在）	（2019年 8月20日現在）
1 期首元本額	99,715,707,801円	121,137,400,893円
期中追加設定元本額	55,349,194,064円	21,472,657,731円
期中一部解約元本額	33,927,500,972円	11,469,140,440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）	1,020,195,393円	1,031,844,600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＞	3,615,695,748円	3,647,817,652円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	21,900,440円	15,401,279円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	663,477,977円	566,386,238円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	437,092円	438,256円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	13,505,890円	13,499,294円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	29,841,502円	23,858,583円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	14,495,610,506円	13,747,940,808円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	12,865,543円	11,425,672円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	6,841,375,099円	6,376,203,938円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	2,419,966,112円	2,303,323,292円

バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	15,921,237円	15,815,204円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	474,719,901円	1,837,879,463円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	2,221,078,550円	7,154,869,695円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	939,989,765円	2,036,033,505円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	7,361,808,915円	6,764,129,149円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	188,030,514円	168,997,366円
世界4資産バランスVA45 < 適格機関投資家限定 >	578,297,898円	320,932,079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 >	155,553,273円	151,915,646円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	70,703,672円	71,760,868円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	39,696,976円	39,242,469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 >	6,792,854,941円	8,200,380,083円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	49,375,605円	67,992,219円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	3,874,480,652円	3,699,651,974円
バランスファンドVA20A < 適格機関投資家限定 >	28,932,161円	26,727,919円
バランスファンドVA35B < 適格機関投資家限定 >	13,388,464円	13,458,063円
バランスファンドVA10A < 適格機関投資家限定 >	1,436,495,240円	1,003,413,152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 >	7,123,113,299円	11,042,626,410円
日本債券インデックス・ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,810,746,155円	1,872,539,910円
4資産インデックスバランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	3,001,698,395円	2,831,616,678円
世界分散ファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	11,140,648,736円	10,587,727,227円
4資産インデックスバランスVA50 < 適格機関投資家限定 >	15,375,763円	14,633,603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 >	401,942,513円	330,400,618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 >	935,906,250円	938,442,155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 >	355,242,299円	291,683,579円

ステート・ストリート日本債券イン デックス・オープン	1,536,983,302円	1,487,140,318円
日本債券インデックス・ファンドF <適格機関投資家限定>	37,553,578,731円	40,102,704,347円
グローバルバランス40VA<適格 機関投資家限定>	5,252,354円	2,858,426円
グローバルバランス40VA2<適 格機関投資家限定>	2,310,346,637円	2,162,524,084円
グローバルバランス40VA3<適 格機関投資家限定>	118,121,700円	117,958,836円
グローバルバランス50VA<適格 機関投資家限定>	44,733,785円	46,723,527円
ワールドバランスVA0902<適 格機関投資家限定>	89,088,574円	円
世界株式VCファンド<適格機関投 資家限定>	1,318,423,334円	円
計	121,137,400,893円	131,140,918,184円
2 受益権の総数	121,137,400,893口	131,140,918,184口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20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 該当する事項はありません。	(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	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）

	（2019年 2月20日現在）	（2019年 8月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2869円 （12,869円）	1.3203円 （13,203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	（2019年 2月20日現在）	（2019年 8月20日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		566,996,968	912,621,623
金銭信託		11,241,281	33,001
コール・ローン		1,412,354,372	4,230,922,353
株式		144,448,525,789	151,953,573,001
投資証券		3,851,568,208	4,414,894,767
派生商品評価勘定		118,424,625	38,825,649
未収入金		2,197,698	5,492,952
未収配当金		186,951,328	306,226,939
差入委託証拠金		667,590,932	1,208,468,964
流動資産合計		151,265,851,201	163,071,059,249
資産合計		151,265,851,201	163,071,059,249
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,927,395	92,746,859
未払解約金		215,519,000	1,400,762,000
未払利息		3,602	11,637
その他未払費用		1,705	2,812
流動負債合計		217,451,702	1,493,523,308
負債合計		217,451,702	1,493,523,308
純資産の部			
元本等			
元本	1	57,955,317,361	61,575,636,256

剰余金 剰余金又は欠損金（ ）		93,093,082,138	100,001,899,685
元本等合計		151,048,399,499	161,577,535,941
純資産合計		151,048,399,499	161,577,535,941
負債純資産合計		151,265,851,201	163,071,059,249

（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	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
1 期首元本額	64,427,801,459円	57,955,317,361円
期中追加設定元本額	13,291,705,497円	11,671,517,108円
期中一部解約元本額	19,764,189,595円	8,051,198,213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	6,351,967,197円	6,223,601,991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	6,834,819,365円	6,697,679,307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	54,493,281円	54,094,021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)	84,890,489円	83,600,210円
外国株式インデックス・ファンドVA 1(適格機関投資家専用)	1,783,752,639円	1,780,501,941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)	63,262,650円	58,592,784円
バランスファンドVA30A<適格機関投 資家限定>	2,283,581円	1,471,911円
バランスファンドVA30B<適格機関投 資家限定>	143,505,321円	119,487,793円
バランスファンドVA40A<適格機関投 資家限定>	75,948円	71,263円
バランスファンドVA40B<適格機関投 資家限定>	4,704,169円	4,395,951円
バランスファンドVA50A<適格機関投 資家限定>	7,784,215円	5,738,664円
バランスファンドVA50B<適格機関投 資家限定>	7,434,532,177円	6,640,587,989円
バランスファンドVA50C<適格機関投 資家限定>	3,012,858円	2,323,869円
バランスファンドVA25A<適格機関投 資家限定>	857,697,908円	761,738,307円
バランスファンドVA37.5A<適格機関 投資家限定>	715,814,160円	645,553,219円
バランスファンドVA75A<適格機関投 資家限定>	65,951,557円	61,942,214円
4資産バランス20VA<適格機関投資家 限定>	62,169,274円	218,327,328円
4資産バランス40VA<適格機関投資家 限定>	750,531,735円	2,249,336,691円
4資産バランス30VA<適格機関投資家 限定>	204,167,933円	412,283,789円
バランスファンドVA35A<適格機関投 資家限定>	1,593,945,296円	1,393,538,365円
バランスファンドVA40C<適格機関投 資家限定>	64,403,370円	53,992,129円

世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	205,784,567円	117,830,309円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	36,739,533円	34,902,918円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	41,602,412円	38,758,233円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	16,904,300円	22,121,861円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	254,008,190円	230,028,560円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,163,655円	981,111円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,387,236円	1,279,586円
バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	41,185,183円	28,927,421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>	7,729,137,849円	10,998,625,207円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	252,574,108円	224,493,928円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	34,281,699円	32,590,646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>	30,226,231円	27,913,746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>	26,728,893円	24,636,211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	383,521,283円	184,353,906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)	2,550,036,343円	2,886,031,310円
全世界株式インデックス・ファンド	296,801,828円	347,202,080円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	3,229,393円	1,656,980円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	878,515,606円	792,096,573円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	71,012,688円	68,436,191円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	31,725,349円	29,878,197円
ワールドバランスVA0902<適格機関投資家限定>	40,619,126円	円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	17,944,366,766円	18,014,031,546円
計	57,955,317,361円	61,575,636,256円
2 受益権の総数	57,955,317,361口	61,575,636,256口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	（2019年 2月20日現在）	（2019年 8月20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	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	(2019年 2月20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	1,709,541,145		1,784,897,937	75,356,792
	S&P 60	107,702,537		111,331,136	3,628,599
	SPI 200	87,652,167		96,105,989	8,453,822
	FTSE100INDEX	178,575,501		185,682,678	7,107,177
	FSMI INDEX	97,532,400		101,574,810	4,042,410
	EURO STOXX 50	311,092,881		321,395,633	10,302,752
	合 計	2,492,096,631		2,600,988,183	108,891,552

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 8月20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	3,748,690,714		3,710,569,991	38,120,723
	S&P 60	219,153,889		218,028,888	1,125,001
	SPI 200	163,864,870		162,165,584	1,699,286
	FTSE100INDEX	361,687,896		353,085,114	8,602,782
	FSMI INDEX	212,995,383		213,343,040	347,657
	EURO STOXX 50	650,030,262		636,767,040	13,263,222
	合 計	5,356,423,014		5,293,959,657	62,463,357

(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	(2019年 2月20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	1,211,654,248		1,218,371,200	6,716,952
	カナダ・ドル	75,114,481		75,366,000	251,519
	オーストラリア・ドル	40,914,560		41,147,600	233,040
	イギリス・ポンド	102,835,734		104,090,400	1,254,666
	ユーロ	153,928,356		154,635,600	707,244
	売建				
	アメリカ・ドル	367,465,180		368,164,800	699,620
	カナダ・ドル	24,151,196		24,284,600	133,404
	オーストラリア・ドル	25,849,058		26,112,900	263,842
	イギリス・ポンド	38,876,070		39,033,900	157,830
	ユーロ	60,042,553		60,345,600	303,047
合 計	2,100,831,436		2,111,552,600	7,605,678	

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 8月20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	3,717,261,753		3,737,108,400	19,846,647
	カナダ・ドル	198,190,181		198,926,100	735,919
	オーストラリア・ドル	92,403,087		92,867,100	464,013
	イギリス・ポンド	274,645,965		275,626,260	980,295
	スイス・フラン	18,475,600		18,472,200	3,400
	ユーロ	547,725,933		544,948,100	2,777,833
	売建				
	アメリカ・ドル	1,452,500,760		1,462,485,600	9,984,840
	カナダ・ドル	66,302,390		66,308,700	6,310
	オーストラリア・ドル	43,149,618		43,194,000	44,382
	イギリス・ポンド	151,259,398		152,479,600	1,220,202
ユーロ	200,327,140		199,774,900	552,240	
合 計	6,762,241,825		6,792,190,960	8,542,147	

(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)

	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6063円 (26,063円)	2.6240円 (26,240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	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		260,140,815	11,666,563
金銭信託		785,872	14,380
コール・ローン		98,736,930	1,843,622,702
国債証券		144,429,871,714	181,376,651,149
派生商品評価勘定		12,000	8,450
未収入金			232,636,300
未収利息		1,205,972,511	1,136,846,415
前払費用		59,399,221	166,241,156
流動資産合計		146,054,919,063	184,767,687,115
資産合計		146,054,919,063	184,767,687,115
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		33,000	72,500
未払解約金		60,374,892	1,852,882,605
未払利息		251	5,071
その他未払費用		210	106
流動負債合計		60,408,353	1,852,960,282
負債合計		60,408,353	1,852,960,282
純資産の部			
元本等			
元本	1	64,007,469,031	78,554,479,283
剰余金			
剰余金又は欠損金()		81,987,041,679	104,360,247,550
元本等合計		145,994,510,710	182,914,726,833
純資産合計		145,994,510,710	182,914,726,833
負債純資産合計		146,054,919,063	184,767,687,115

(注) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月21日から、翌年2月20日までであります。

(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</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	（2019年 2月20日現在）	（2019年 8月20日現在）
1 期首元本額	77,182,711,057円	64,007,469,031円
期中追加設定元本額	17,652,006,111円	23,784,345,303円
期中一部解約元本額	30,827,248,137円	9,237,335,051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	6,151,926,579円	6,235,672,688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	16,224,013円	19,372,904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）	819,834,527円	871,829,698円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	1,546,466,428円	5,119,169,919円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	2,772,355,475円	2,253,870,870円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	4,992,225円	3,476,770円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	377,645,298円	323,998,994円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	84,219円	82,574円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	7,628,195円	7,615,810円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,251,183円	3,354,406円

バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	8,259,856,676円	7,825,181,709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>	106,604,554円	104,809,023円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	3,165,556円	2,756,436円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,396,546,005円	3,166,788,141円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,492,658,471円	1,415,993,692円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	36,624,722円	36,313,060円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	269,254,164円	1,040,532,110円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	1,260,005,070円	4,029,037,779円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	533,211,369円	1,146,144,698円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	3,590,404,794円	3,307,837,521円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	107,507,805円	96,104,417円
世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	187,022,504円	105,287,623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>	148,688,336円	148,608,587円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	100,878,655円	100,536,178円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	58,728,277円	58,498,081円
外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	3,894,205,578円	4,612,507,612円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	37,363,302円	51,408,710円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	668,782,969円	639,992,697円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	3,809,488円	3,470,020円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,356,085円	2,281,296円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	13,787,084,927円	21,151,956,141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>	618,524,266円	806,686,117円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,136,987,195円	1,065,253,899円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,927,690,179円	1,822,146,386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>	1,094,196,514円	1,562,650,693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 >	33,525,745円	32,766,609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 >	136,849,852円	179,620,268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 >	534,530,098円	537,542,699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 >	393,259,414円	206,225,354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 >	120,956,525円	158,548,110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	133,205,198円	69,800,148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)	3,618,286,122円	3,862,449,146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<適格 機関投資家限定>	3,834,415,948円	3,631,172,524円
グローバルバランス4 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	4,182,372円	2,250,368円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適 格機関投資家限定 >	664,153,566円	622,010,391円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適 格機関投資家限定 >	93,605,621円	93,471,993円
グローバルバランス5 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	16,932,967円	17,394,414円
計	64,007,469,031円	78,554,479,283円
2 受益権の総数	64,007,469,031口	78,554,479,283口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20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	<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>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>(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> <p>同左</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	(2019年 2月20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 イギリス・ポンド ユーロ	166,125,000 28,933,000 150,852,000		166,095,000 28,930,000 150,864,000	30,000 3,000 12,000
	合 計	345,910,000		345,889,000	21,000

(単位：円)

区 分	種 類	(2019年 8月20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	191,934,000		191,934,000	
	ユーロ	118,200,000		118,200,000	
	売建				
	オーストラリア・ドル	9,377,550		9,369,100	8,450
	イギリス・ポンド	12,918,000		12,932,000	14,000
	ユーロ	35,401,500		35,460,000	58,500
	合 計	367,831,050		367,895,100	64,050

(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)

	(2019年 2月20日現在)	(2019年 8月20日現在)
1口当たり純資産額	2.2809円	2.3285円
(1万口当たり純資産額)	(22,809円)	(23,285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。

< 訂正・更新後 >

【純資産額計算書】

(2019年9月30日現在)

資産総額	4,534,255,242円
負債総額	4,287,035円
純資産総額 (-)	4,529,968,207円
発行済口数	3,614,872,959口
1口当たり純資産額 (/)	1.2531円

< 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）

(2019年9月30日現在)

資産総額	93,259,465,879円
負債総額	310,493,794円
純資産総額 (-)	92,948,972,085円
発行済口数	34,806,591,273口
1口当たり純資産額 (/)	2.6704円

< 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）

(2019年9月30日現在)

資産総額	161,616,866,899円
負債総額	489,694,802円
純資産総額 (-)	161,127,172,097円
発行済口数	122,901,945,186口
1口当たり純資産額 (/)	1.3110円

< 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）

(2019年9月30日現在)

資産総額	165,791,826,472円
負債総額	102,909,971円
純資産総額 (-)	165,688,916,501円
発行済口数	61,192,055,757口
1口当たり純資産額 (/)	2.7077円

< 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）

(2019年9月30日現在)

資産総額	177,409,643,383円
負債総額	267,133,473円
純資産総額 (-)	177,142,509,910円
発行済口数	75,334,461,090口
1口当たり純資産額 (/)	2.3514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（本書提出日現在）

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。

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。

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。

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会社は、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。

2019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136本であり、その純資産総額は2,279,766百万円です（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）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（2018年4月1日から2019年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2018年3月31日現在)			当事業年度 (2019年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(資産の部)			%			%
流動資産						
預金		2,376,164			2,933,318	
有価証券		22,684			44,368	
前払金		46,929			42,741	
前払費用		8,682			15,949	
未収入金		210,888			500,748	
未収還付法人税等		1,020			2,367	
未収委託者報酬		642,874			617,227	
未収収益		221,238			122,922	
流動資産計		3,530,482	53.2		4,279,642	60.3
固定資産						
有形固定資産		106,070			84,968	
建物附属設備	1	79,548			66,820	
器具備品	1	26,521			18,147	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		3,002,584			2,732,068	
長期差入保証金		66,014			63,377	
繰延税金資産		2,931,719			2,662,416	
その他投資		4,850			6,275	
固定資産計		3,108,655	46.8		2,817,037	39.7
資産合計		6,639,137	100.0		7,096,680	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2018年3月31日現在)			当事業年度 (2019年3月31日現在)		
	金 額	構成比	%	金 額	構成比	%
(負債の部)			%			%
流動負債						
預り金		123,003			134,522	
未払金		295,067			286,607	
未払手数料	131,425			123,825		
その他未払金	163,642			162,781		
未払費用		2,095			1,928	
未払法人税等		6,486			1,181	
未払消費税等		33,130			27,995	
賞与引当金		85,243			57,088	
流動負債計		545,027	8.2		509,323	7.2
固定負債						
退職給付引当金		65,230			67,644	
固定負債計		65,230	1.0		67,644	1.0
負債合計		610,257	9.2		576,968	8.1

(純資産の部)			%			%
株主資本		6,028,879	90.8		6,519,711	91.9
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	5,609,759			6,100,591		
純資産合計		6,028,879	90.8		6,519,711	91.9
負債・純資産合計		6,639,137	100.0		7,096,680	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,350,838		2,337,607	
投資顧問収入	1,772,901		2,367,856	
その他営業収益	20,464		17,873	
営業収益計	4,144,205	100.0	4,723,337	100.0
営業費用				
支払手数料	523,308		502,719	
広告宣伝費	43,448		39,808	
公告費	1,140		1,140	
調査費	417,484		585,088	
調査費	257,351		353,007	
委託調査費	158,734		230,952	
図書費	1,398		1,129	
委託計算費	151,080		153,098	
営業雑経費	31,907		44,871	
通信費	4,058		4,783	
印刷費	9,892		9,076	
協会費	9,442		8,632	
諸会費	2,072		6,374	
その他	6,441		16,005	
営業費用計	1,168,368	28.2	1,326,726	28.1
一般管理費				
給料	1,277,564		1,315,296	
役員報酬	249,245		211,622	
給料・手当	804,242		876,471	
賞与	162,677		192,102	
賞与引当金繰入額	61,399		35,098	
交際費	3,788		3,029	
旅費交通費	26,904		21,095	
租税公課	11,290		6,373	

不動産賃借料		95,293			104,671	
退職給付費用		41,704			79,897	
固定資産減価償却費		22,523			21,600	
福利厚生費		113,473			116,798	
事務手数料		254,170			773,947	
諸経費		145,755			190,123	
一般管理費計		1,992,467	48.1		2,632,834	55.7
営業利益		983,368	23.7		763,777	16.2
営業外収益						
有価証券運用益		3,607			1,711	
雑収入		9,153			50	
営業外収益計		12,761	0.3		1,762	0.0
営業外費用						
支払利息		169			-	
為替差損		601			46	
雑損失		241			277	
営業外費用計		1,012	0.0		324	0.0
経常利益		995,117	24.0		765,215	16.2
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			5,262	
特別利益計		-	0.0		5,262	0.1
特別損失						
事業再構築費用		28,134			6,296	
事務処理損失		0			714	
ゴルフ会員権売却損		-			2,800	
特別損失計		28,134	0.7		9,811	0.2
税引前当期純利益		966,983	23.3		760,665	16.1
法人税、住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		340,417	8.2		269,303	5.7
当期純利益		626,035	15.1		490,831	10.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	4,983,724	5,092,844	5,402,844	5,402,844
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	626,035	626,035	626,035	626,035
当期変動額合計	-	-	-	626,035	626,035	626,035	626,035
当期末残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	6,028,879

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本					株主資本 合計	純資産合計
	資本金	利益剰余金			利益剰余金 合計		
		利益準備金	その他利益 剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	5,609,759	5,718,879	6,028,879	6,028,879
当期変動額							
当期純利益	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期変動額合計	-	-	-	490,831	490,831	490,831	490,831
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711

[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
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	(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。 (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。 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。 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。 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。
5. その他 財務諸表作成のための重要な事項	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。

[表示方法の変更]

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

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」669,807千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」2,931,719千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第5項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)及び同注解(注9)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取り扱いに従い、その記載をしておりません。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1. 有形固定資産の減価償却累計額
建物附属設備 42,115千円	建物附属設備 54,843千円
器具備品 29,212千円	器具備品 38,003千円
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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
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20,209千円は、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254,170千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。	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17,341千円は、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773,947千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。
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 2017年4月1日 至 2018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
普通株式	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

該当ありません。

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。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式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
普通株式	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
該当ありません。

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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株当たりの配当額	基準日
2019年6月26日 定時株主総会（予定）	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日

（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。

2018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	2,376,164	2,376,164	
(2) 未収入金	210,888	210,888	
(3) 未収委託者報酬	642,874	642,874	
(4) 預り金	123,003	123,003	
(5) 未払手数料	131,425	131,425	
(6) その他未払金	163,642	163,642	

（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）未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

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。

(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。

2019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	2,933,318	2,933,318	
(2) 未収入金	500,748	500,748	
(3) 未収委託者報酬	617,227	617,227	
(4) 預り金	134,522	134,522	
(5) 未払手数料	123,825	123,825	
(6) その他未払金	162,781	162,781	

(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) 未収入金、(3)未収委託者報酬、(4)預り金、(5)未払手数料及び(6)その他未払金

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。

(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 (2018年3月31日現在)	当事業年度 (2019年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 22,684千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,913千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 44,368千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,704千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。	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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日

2011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、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左
--	----

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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
退職給付債務の期首残高	469,114
勤務費用	45,881
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	9,915
退職給付の支払額	51,823
退職給付債務の期末残高	473,087

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
退職給付債務の期首残高	473,087
勤務費用	51,555
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	52,891
退職給付の支払額	75,129
退職給付債務の期末残高	502,405

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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
年金資産の期首残高	367,412
期待運用収益	2,717
数理計算上の差異の発生額	8,568
事業主からの拠出額	53,470
退職給付の支払額	51,823
年金資産の期末残高	380,344

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
年金資産の期首残高	380,344
期待運用収益	2,814

数理計算上の差異の発生額	32,480
事業主からの拠出額	56,396
退職給付の支払額	75,129
年金資産の期末残高	396,905

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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
積立型制度の退職給付債務	473,087
年金資産	380,344
	92,742
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	92,742
未認識数理計算上の差異	1,347
未認識過去勤務費用	26,164
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	65,230

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
積立型制度の退職給付債務	502,405
年金資産	396,905
	105,499
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	105,499
未認識数理計算上の差異	20,411
未認識過去勤務費用	17,443
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	67,644

５．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
退職給付費用	25,902
(1) 勤務費用	45,881
(2) 利息費用	-
(3) 期待運用収益（減算）	2,717
(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	25,983
--------------------	--------

(単位：千円)

	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
退職給付費用	58,810
(1) 勤務費用	51,555
(2) 利息費用	-
(3) 期待運用収益（減算）	2,814
(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	1,347

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2018年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.0%

その他 2.0%

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（2019年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

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 (2018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

	当事業年度 (2019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

8. 確定拠出制度

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,262千円であります。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,720千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
1. 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)		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)	
繰延税金資産		繰延税金資産	
連結納税適用に伴う影響額	1,837,768	連結納税適用に伴う影響額	1,225,179
賞与引当金繰入超過額	21,749	賞与引当金繰入超過額	14,373
退職給付引当金	21,040	退職給付引当金	21,778
繰越欠損金	1,001,357	(注) 繰越欠損金	1,372,856
その他	49,802	その他	28,228
繰延税金資産 合計	2,931,719	繰延税金資産 合計	2,662,416
繰延税金負債との相殺	-	繰延税金負債との相殺	-
繰延税金資産の純額	2,931,719	繰延税金資産の純額	2,662,416

（注）税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

当事業年度（2019年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,372,856	1,372,856

(*1) 税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額であります。

(*2) 税務上の繰越欠損金1,372,856千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,372,856千円を計上しております。当該税務上の繰越欠損金に係る繰延税金資産については、将来の課税所得の見込等により回収可能と判断しております。

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	30.8%	法定実効税率	30.6%
交際費等永久に損金に算入されない項目	4.5%	交際費等永久に損金に算入されない項目	5.3%
その他	0.1%	その他	0.5%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.2%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.4%
=====		=====	

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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、変動は有りません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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、変動は有りません。

（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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

前事業年度											
自 2017年4月 1日											
至 2018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	155,038 100,307 98,690 20,209 254,170	前払金 未収入金 未払金	4,422 38,775 14,495
	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	35,330 141,349	前払金	42,506
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグレーション	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	16,773	-	-
	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 投資顧問料の支払	255 14,663	-	-

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019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・オブ・ニューヨーク・シティ	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	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	229,260	前払金	8,051		
								ソフトウェアの使用契約	投資顧問料の支払	164,709				
								人件費等及び事務手数料の受取	人件費等の支払	135,677			未払金	30,899
								事務手数料の支払	事務手数料の支払	17,341				
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	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	35,235	前払金	34,689			
							兼職社員の人件費支払等	人件費等の支払	159,558					
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インベスティングダム	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	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	16,146	-	-			
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	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取 投資顧問料の支払	531 19,937	-	-			

(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 自 2017年4月 1日 至 2018年3月31日		当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日	
1株当たり純資産	972,399円98銭	1株当たり純資産	1,051,566円42銭
1株当たり当期純利益	100,973円44銭	1株当たり当期純利益	79,166円44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、記載していません。		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、記載していません。	

(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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日	当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
当期純利益（千円）	626,035	490,831
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）	626,035	490,831
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 2017年4月 1日 至 2018年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。 ）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。 ）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

その他、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実は存在しておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

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) 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（2019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（2019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 (2019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 (2019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	48,323百万円 (2019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	9,257百万円 (2019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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年10月2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

指定有限責任社員

公認会計士

大畑 茂

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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2019年2月21日から2019年8月20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な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2019年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2019年2月21日から2019年8月20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(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

2019年6月21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

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 雅人
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第22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2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 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。