

【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】 2021年11月19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】 鈴木 愛

【電話番号】 03 - 4530 - 7385

【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、2021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>

商品分類表

<略>

当ファンドが該当する商品分類

<略>

属性区分表

<略>

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

<略>

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>
1998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、2015年1月29日付にて、株式会社イー・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の獲得を目指します。**
※AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、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、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。
投資対象とする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。
- 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。

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)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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"> ・ 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。

※TOPIX(東証株価指数配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している株式全銘柄で構成される株価指数で、配当を考慮したものです。

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総合指数の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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。

※NOMURA-BPI総合指数は、日本の国債、事業債(社債)、地方債、政府保証債等の固定利付債券で構成される債券価格指数です。

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、MSCI コクサイ指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・ MSCI コクサイ指数(円ベース)をベンチマークとします。 ・ 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 コクサイ指数は、日本を除く世界の主要先進国の株式で構成される株価指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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"> ・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。 ・ 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。

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、日本を除く世界の主要国の国債で構成される債券価格指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ 株式会社東京証券取引所は、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または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 上記に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

NOMURA-BPI総合指数

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独占的に所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関連会社のサービスマークであり、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、「SSGA」といいます。))は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI関係者は、当ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIおよびその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に関わらず、MSCIにより決定、作成、計算されています。MSCI関係者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入力しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

FTSE世界国債インデックス(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。WGBIのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。WGBIに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

<訂正後>

~ <略>

商品分類表

< 略 >

当ファンドが該当する商品分類

< 略 >

属性区分表

< 略 >

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 略 >

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>

1998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、2015年1月29日付にて、株式会社イー・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の獲得を目指します。**

※AMCリスクバジェット型資産配分モデル指数は、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、投資対象とするマザーファンドのベンチマークのリターンを合成した指数であり、当ファンドの投資成果の比較基準となるベンチマークとします。

投資対象とする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。

- 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。

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)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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"> ・ 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。

※TOPIX(東証株価指数配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している株式全銘柄で構成される株価指数で、配当を考慮したものです。2022年4月以降、TOPIXの算出ルールは変更される予定です。

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総合指数の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債等
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・ 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。

※NOMURA-BPI総合指数は、日本の国債、事業債(社債)、地方債、政府保証債等の固定利付債券で構成される債券価格指数です。

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、MSCI コクサイ指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・ MSCI コクサイ指数(円ベース)をベンチマークとします。 ・ 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 コクサイ指数は、日本を除く世界の主要先進国の株式で構成される株価指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

外国債券インデックス・マザー・ファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。
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"> ・ FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとします。 ・ 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。

※FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、日本を除く世界の主要国の国債で構成される債券価格指数であり、投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

■ ベンチマーク(オリジナル指数)

以下に掲げるベンチマークは、マザーファンドのベンチマークです。

TOPIX(東証株価指数配当込み)

- ① TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は株式会社東京証券取引所が有します。
- ② 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- ③ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ④ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ⑤ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ⑥ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
- ⑦ 株式会社東京証券取引所は、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または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ⑧ 上記に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。 ※2022年4月以降、TOPIXの算出ルールは変更される予定です。

NOMURA-BPI総合指数

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

MSCI コクサイ指数

MSCI コクサイ指数は、MSCI Inc.の登録商標です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。))が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数はMSCIが独占的に所有しています。MSCIおよびMSCI指数は、MSCIおよびその関連会社のサービスマークであり、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、「SSGA」といいます。))は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI関係者は、当ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIおよびその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に関わらず、MSCIにより決定、作成、計算されています。MSCI関係者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人の要求を考慮に入れる義務は一切ありません。MSCI関係者は、当ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI関係者は、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI関係者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI関係者は、明示的にも黙示的にも、当ファンドの発行者(SSGA)、所有者あるいはいかなる個人または法人が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について、保証を行うものではありません。MSCI関係者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI関係者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI関係者は、特定目的のための市場性および適切性について、何ら保証しないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害(逸失利益を含む。)につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI関係者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人または法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本)

FTSE世界国債インデックス(除く日本)(以下、「WGBI」といいます。))は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、当ファンドのスポンサーではなく、当ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っていません。WGBIのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。WGBIに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

3【投資リスク】

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) ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に日本および世界主要国の株式や公社債等に分散投資を行いますが、主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合があります、その運用成果（損益）はすべて投資者の皆さまに帰属します。

したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

なお、投資信託は預貯金とは異なります。

当ファンドの主なリスクおよび留意点は以下のとおりですが、当ファンドのリスクおよび留意点を完全に網羅しておりませんのでご注意ください。また、ファンドのリスクは以下に限定されるものではありません。

資産配分リスク

当ファンドは、国内外の株式や公社債等、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、市場環境に応じて決定した最適な資産配分比率に変更する運用を行います。この資産配分がファンドの収益の源泉となる場合もありますが、投資対象資産が予期しない値動きをした場合、損失を被る可能性があります。

株価変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式を実質的な投資対象としていることから、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。したがって、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

信用リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の株式や公社債等を実質的な投資対象としていることから、株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また公社債等の価格は、公社債等の発行体の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等、信用状況によって変動し、特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。したがって、このような状態が生じた場合には、当ファンドが実質的に保有する株式や公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。また、金融商品取引の相手方や受託会社の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

金利変動リスク

当ファンドは、日本および世界主要国の公社債等を実質的な投資対象としていることから、金利変動リスクを伴います。一般に、公社債等の価格は、金利が上昇した場合には下落し、金利が下落した場合には上昇します（価格の変動幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。したがって、金利が上昇した場合、当ファンドが実質的に保有する公社債等の価格が下落し、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

当ファンドの実質的な投資対象である世界主要国の株式や公社債等（日本を除く）は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けます。一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことによって解約金の支払いに対応する場合があります、その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

投資対象国への投資リスク

当ファンドが実質的に保有する有価証券の発行国（投資対象国）における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

パッシブ運用のリスク

当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドはパッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマーク（参考指数）とするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネージャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

マザーファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

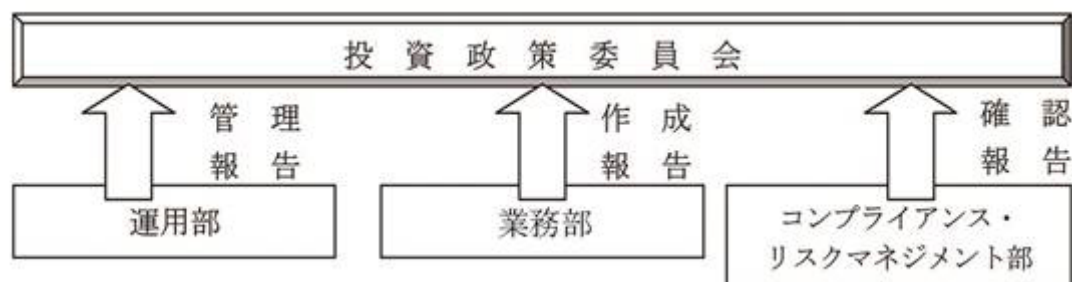
ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

（２）その他の留意点

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

（３）リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

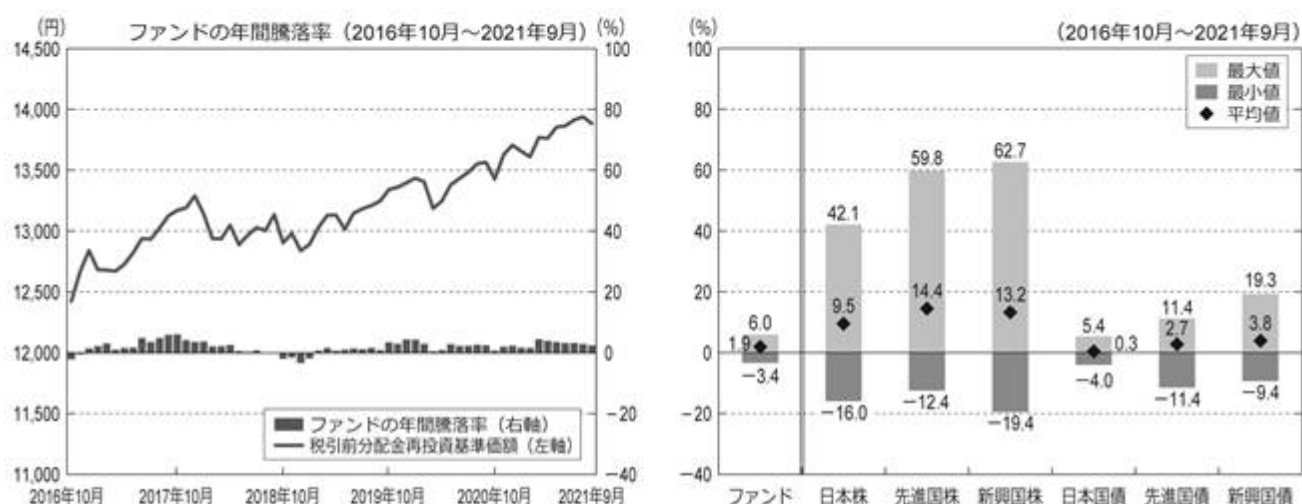
投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

上記リスクに対する管理体制は本書提出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

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。

※2022年4月以降、TOPIXの算出ルールは変更される予定です。

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・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(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】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

< 略 >

上記は、2021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 >

< 略 >

上記は、2021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】

(2021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	3,951,509,225	85.48
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		671,000,036	14.52
純資産総額		4,622,509,261	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)

(2021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	89,542,056,460	97.95
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,878,637,805	2.05
純資産総額		91,420,694,265	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)

(2021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	149,483,106,000	82.59
特殊債券	日本	13,474,679,435	7.44
地方債証券	日本	10,918,060,913	6.03
社債券	日本	6,427,821,400	3.55
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		699,121,755	0.39
純資産総額		181,002,789,503	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)

(2021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	135,701,669,096	69.04
	イギリス	8,416,941,631	4.28
	フランス	6,628,478,288	3.37
	カナダ	6,564,289,994	3.34
	スイス	5,631,451,538	2.87
	ドイツ	5,441,943,145	2.77
	オーストラリア	3,759,524,400	1.91
	オランダ	2,899,329,455	1.48
	スウェーデン	2,157,844,454	1.10
	香港	1,693,798,937	0.86
	デンマーク	1,558,190,076	0.79
	イタリア	1,465,306,614	0.75

	スペイン	1,412,073,151	0.72
	シンガポール	610,107,342	0.31
	フィンランド	602,060,033	0.31
	ベルギー	535,646,283	0.27
	アイルランド	422,568,396	0.21
	ノルウェー	389,792,047	0.20
	イスラエル	376,800,214	0.19
	ニュージーランド	138,553,849	0.07
	オーストリア	127,018,683	0.06
	ポルトガル	115,442,175	0.06
	小計	186,648,829,801	94.96
投資証券	アメリカ	3,697,636,769	1.88
	オーストラリア	256,071,737	0.13
	イギリス	114,620,810	0.06
	フランス	87,171,559	0.05
	シンガポール	77,602,753	0.04
	香港	60,883,147	0.03
	カナダ	24,139,671	0.01
	小計	4,318,126,446	2.20
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		5,588,162,821	2.84
純資産総額		196,555,119,068	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)

(2021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	64,986,574,842	45.92
	フランス	14,262,995,374	10.08
	イタリア	13,209,092,404	9.33
	ドイツ	10,438,369,818	7.38
	イギリス	8,487,519,021	6.00
	スペイン	8,310,557,623	5.87
	ベルギー	3,311,405,536	2.34
	カナダ	2,712,242,727	1.92
	オランダ	2,623,133,632	1.85
	オーストラリア	2,546,954,423	1.80
	オーストリア	2,075,293,035	1.47
	アイルランド	1,137,012,186	0.80
	メキシコ	967,994,734	0.68
	フィンランド	845,130,522	0.60
	ポーランド	798,984,817	0.57
	デンマーク	705,848,451	0.50
	マレーシア	665,445,284	0.47
	イスラエル	650,351,552	0.46
	シンガポール	636,765,595	0.45
	スウェーデン	416,355,870	0.29
ノルウェー	345,619,015	0.24	
	小計	140,133,646,461	99.02

コール・ローン、その他資産（負債控除後）	1,381,978,817	0.98
純資産総額	141,515,625,278	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】

（2021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		812,863,019	2.5328	2,058,819,455	2.5621	2,082,636,340	45.05
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		1,079,553,488	1.2786	1,380,317,090	1.2878	1,390,248,981	30.08
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		68,213,610	3.3455	228,208,633	3.5725	243,693,121	5.27
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		57,384,168	3.5122	201,544,675	4.0940	234,930,783	5.08
									投資比率：合計	85.48

（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	-	85.48
合計		85.48

（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）

（2021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	1,629,500	1,604.07	2,613,832,065	2,000.00	3,259,000,000	3.56
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	201,500	11,213.84	2,259,588,760	12,455.00	2,509,682,500	2.75
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	31,600	51,680.34	1,633,098,744	67,000.00	2,117,200,000	2.32
4	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通信 業	250,500	9,962.82	2,495,686,410	6,480.00	1,623,240,000	1.78
5	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービス業	220,200	4,963.22	1,092,901,044	6,832.00	1,504,406,400	1.65
6	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	2,170,100	566.35	1,229,036,135	657.90	1,427,708,790	1.56
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信 業	369,200	2,766.94	1,021,554,248	3,085.00	1,138,982,000	1.25
8	日本	株式	信越化学工業	化学	58,300	17,521.11	1,021,480,713	18,900.00	1,101,870,000	1.21
9	日本	株式	H O Y A	精密機器	62,800	11,990.31	752,991,468	17,475.00	1,097,430,000	1.20
10	日本	株式	日立製作所	電気機器	154,600	5,275.54	815,598,484	6,640.00	1,026,544,000	1.12

11	日本	株式	ダイキン工業	機械	41,000	21,872.15	896,758,150	24,460.00	1,002,860,000	1.10
12	日本	株式	任天堂	その他製品	18,400	62,021.18	1,141,189,712	54,310.00	999,304,000	1.09
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	267,600	3,756.92	1,005,351,792	3,699.00	989,852,400	1.08
14	日本	株式	日本電産	電気機器	77,400	13,271.59	1,027,221,066	12,420.00	961,308,000	1.05
15	日本	株式	村田製作所	電気機器	94,500	9,259.81	875,052,045	9,960.00	941,220,000	1.03
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	253,100	3,286.61	831,840,991	3,691.00	934,192,100	1.02
17	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	18,800	41,681.57	783,613,516	49,670.00	933,796,000	1.02
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	253,200	3,112.87	788,178,684	3,455.00	874,806,000	0.96
19	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	219,500	3,832.20	841,167,900	3,944.00	865,708,000	0.95
20	日本	株式	第一三共	医薬品	252,800	3,079.97	778,616,416	2,979.50	753,217,600	0.82
21	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	221,600	3,327.79	737,438,264	3,277.00	726,183,200	0.79
22	日本	株式	ファナック	電気機器	28,200	25,792.54	727,349,628	24,565.00	692,733,000	0.76
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	431,100	1,567.65	675,813,915	1,584.50	683,077,950	0.75
24	日本	株式	三菱商事	卸売業	192,900	3,039.88	586,392,852	3,536.00	682,094,400	0.75
25	日本	株式	S M C	機械	9,400	63,666.50	598,465,100	70,080.00	658,752,000	0.72
26	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	123,900	4,274.99	529,671,261	5,085.00	630,031,500	0.69
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	104,500	5,378.84	562,088,780	6,021.00	629,194,500	0.69
28	日本	株式	三井物産	卸売業	246,100	2,289.14	563,357,354	2,464.00	606,390,400	0.66
29	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	32,700	17,588.66	575,149,182	18,130.00	592,851,000	0.65
30	日本	株式	富士通	電気機器	28,900	15,401.02	445,089,478	20,310.00	586,959,000	0.64
									投資比率：合計	35.62

(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	18.22
	情報・通信業	8.26
	輸送用機器	7.54
	化学	6.91
	サービス業	5.91
	機械	5.26
	医薬品	5.04
	銀行業	4.91
	卸売業	4.67
	小売業	4.40
	食料品	3.36
	陸運業	3.23
	精密機器	2.91
	建設業	2.27
	その他製品	2.16
	保険業	1.98
	不動産業	1.97
	その他金融業	1.12
	電気・ガス業	1.12
	鉄鋼	0.80
ガラス・土石製品	0.75	
証券、商品先物取引業	0.72	
ゴム製品	0.70	
非鉄金属	0.65	

金属製品	0.59
空運業	0.48
海運業	0.47
繊維製品	0.47
石油・石炭製品	0.40
パルプ・紙	0.22
鉱業	0.19
倉庫・運輸関連業	0.18
水産・農林業	0.09
合計	97.95

（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） （2021年12月限）	大阪取引所	買建	86	1,751,274,260	1,746,230,000	1.91

（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）

（2021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428回利付国 債（2年）	0.005	2023/09/01	3,500,000,000	100.25	3,509,065,000	100.24	3,508,715,000	1.94
2	日本	国債 証券	第141回利付国 債（5年）	0.100	2024/09/20	2,900,000,000	100.69	2,920,289,000	100.64	2,918,560,000	1.61
3	日本	国債 証券	第363回利付国 債（10年）	0.100	2031/06/20	2,580,000,000	100.63	2,596,283,800	100.33	2,588,694,600	1.43
4	日本	国債 証券	第148回利付国 債（5年）	0.005	2026/06/20	2,400,000,000	100.48	2,411,661,000	100.42	2,410,224,000	1.33
5	日本	国債 証券	第146回利付国 債（5年）	0.100	2025/12/20	2,350,000,000	100.93	2,371,988,000	100.84	2,369,904,500	1.31
6	日本	国債 証券	第356回利付国 債（10年）	0.100	2029/09/20	2,050,000,000	100.83	2,067,219,000	100.91	2,068,798,500	1.14
7	日本	国債 証券	第144回利付国 債（5年）	0.100	2025/06/20	1,900,000,000	100.88	1,916,758,000	100.78	1,914,877,000	1.06
8	日本	国債 証券	第135回利付国 債（5年）	0.100	2023/03/20	1,900,000,000	100.46	1,908,892,000	100.32	1,906,137,000	1.05
9	日本	国債 証券	第145回利付国 債（5年）	0.100	2025/09/20	1,800,000,000	100.93	1,816,740,000	100.81	1,814,706,000	1.00
10	日本	国債 証券	第360回利付国 債（10年）	0.100	2030/09/20	1,700,000,000	100.28	1,704,760,000	100.71	1,712,172,000	0.95
11	日本	国債 証券	第136回利付国 債（5年）	0.100	2023/06/20	1,700,000,000	100.52	1,708,959,000	100.37	1,706,426,000	0.94

12	日本	国債証券	第147回利付国債（5年）	0.005	2026/03/20	1,600,000,000	100.49	1,607,950,000	100.44	1,607,168,000	0.89
13	日本	国債証券	第9回利付国債（40年）	0.400	2056/03/20	1,730,000,000	91.17	1,577,327,500	90.66	1,568,469,900	0.87
14	日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	0.100	2023/09/20	1,550,000,000	100.58	1,559,067,500	100.43	1,556,727,000	0.86
15	日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	0.100	2029/06/20	1,530,000,000	101.02	1,545,747,900	100.96	1,544,779,800	0.85
16	日本	国債証券	第351回利付国債（10年）	0.100	2028/06/20	1,500,000,000	100.98	1,514,775,000	101.01	1,515,165,000	0.84
17	日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	0.400	2025/09/20	1,480,000,000	102.30	1,514,069,600	102.03	1,510,088,400	0.83
18	日本	国債証券	第418回利付国債（2年）	0.100	2022/11/01	1,500,000,000	100.39	1,505,850,000	100.23	1,503,570,000	0.83
19	日本	国債証券	第362回利付国債（10年）	0.100	2031/03/20	1,400,000,000	100.19	1,402,725,000	100.47	1,406,594,000	0.78
20	日本	国債証券	第38回利付国債（30年）	1.800	2043/03/20	1,100,000,000	126.76	1,394,454,000	126.79	1,394,778,000	0.77
21	日本	国債証券	第155回利付国債（20年）	1.000	2035/12/20	1,200,000,000	110.51	1,326,180,000	110.60	1,327,224,000	0.73
22	日本	国債証券	第341回利付国債（10年）	0.300	2025/12/20	1,300,000,000	101.89	1,324,687,000	101.71	1,322,308,000	0.73
23	日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	0.100	2028/12/20	1,300,000,000	100.89	1,311,570,000	101.01	1,313,169,000	0.73
24	日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	0.100	2030/03/20	1,300,000,000	100.49	1,306,370,000	100.84	1,310,998,000	0.72
25	日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	0.100	2024/06/20	1,300,000,000	100.74	1,309,646,000	100.59	1,307,787,000	0.72
26	日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	0.100	2027/12/20	1,260,000,000	101.02	1,272,864,600	101.06	1,273,368,600	0.70
27	日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	0.100	2028/09/20	1,260,000,000	100.95	1,272,009,800	101.01	1,272,763,800	0.70
28	日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	0.100	2028/03/20	1,200,000,000	101.07	1,212,860,000	101.03	1,212,456,000	0.67
29	日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	0.100	2026/09/20	1,200,000,000	100.97	1,211,676,000	100.92	1,211,076,000	0.67
30	日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	0.100	2026/06/20	1,200,000,000	100.95	1,211,460,000	100.90	1,210,800,000	0.67
										投資比率：合計	28.32

（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	-	82.59
特殊債券	-	7.44
地方債証券	-	6.03
社債券	-	3.55
合計		99.61

（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）

（2021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	524,668	13,049.87	6,846,850,242	15,985.53	8,387,097,942	4.27
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	224,932	24,085.18	5,417,528,607	31,785.27	7,149,526,600	3.64
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	14,288	359,286.24	5,133,481,870	369,461.35	5,278,863,774	2.69
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	75,352	31,090.25	2,342,713,030	38,009.15	2,864,065,561	1.46
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,412	199,929.41	1,881,735,618	300,736.87	2,830,535,461	1.44
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	9,181	200,656.89	1,842,230,918	301,111.80	2,764,507,494	1.41
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	25,700	66,510.26	1,709,313,868	87,444.21	2,247,316,330	1.14
8	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	78,300	14,884.73	1,165,475,086	22,962.62	1,797,973,647	0.91
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	95,090	13,559.10	1,289,335,579	18,573.12	1,766,118,361	0.90
10	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	82,925	16,117.59	1,336,551,913	18,357.11	1,522,264,043	0.77
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	53,195	23,612.88	1,256,087,236	25,370.02	1,349,558,511	0.69
12	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	29,691	37,817.76	1,122,847,349	44,813.88	1,330,569,124	0.68
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	41,634	25,905.00	1,078,528,903	31,034.29	1,292,081,912	0.66
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	33,439	30,892.15	1,033,002,884	37,709.20	1,260,958,126	0.64
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	76,939	15,513.23	1,193,572,495	15,894.87	1,222,936,049	0.62
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	90,513	12,263.72	1,110,026,450	13,481.70	1,220,269,546	0.62
17	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	242,287	3,242.32	785,572,567	4,820.39	1,167,918,897	0.59
18	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	13,179	47,566.41	626,877,841	84,110.32	1,108,489,933	0.56
19	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO NEW	メディア・娯楽	57,064	16,467.90	939,724,747	19,326.34	1,102,838,585	0.56
20	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	27,814	37,943.11	1,055,349,895	39,529.02	1,099,460,295	0.56
21	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	35,122	23,664.36	831,139,820	28,987.27	1,018,091,248	0.52
22	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	15,028	53,391.43	802,366,500	64,656.18	971,653,133	0.49
23	アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	13,907	54,990.77	764,756,677	67,046.79	932,419,780	0.47

24	アメリカ	株式	SALESFORCE COM INC COM	ソフトウェア・ サービス	30,627	27,445.97	840,588,006	30,274.35	927,212,823	0.47
25	アメリカ	株式	COMCAST CORP- CL A	メディア・娯楽	144,012	5,787.38	833,452,629	6,259.68	901,469,842	0.46
26	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	22,068	36,254.10	800,055,690	40,525.43	894,315,277	0.45
27	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	132,951	4,492.46	597,278,219	6,701.76	891,006,970	0.45
28	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	176,188	4,169.01	734,531,295	4,871.87	858,366,370	0.44
29	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	132,382	4,778.98	632,651,459	6,209.32	822,002,412	0.42
30	アメリカ	株式	THERMO ELECTRON CORP	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	12,371	50,773.62	628,120,542	64,868.83	802,492,320	0.41
									投資比率：合計	29.39

(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) 2021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	12.07
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.36
	メディア・娯楽	7.31
	資本財	6.13
	銀行	6.06
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.80
	小売	5.57
	ヘルスケア機器・サービス	5.06
	各種金融	4.60
	半導体・半導体製造装置	4.53
	素材	3.94
	食品・飲料・タバコ	3.67
	エネルギー	3.28
	保険	2.95
	公益事業	2.75
	自動車・自動車部品	2.08
	運輸	1.87
	消費者サービス	1.84
	耐久消費財・アパレル	1.82
	家庭用品・パーソナル用品	1.67
電気通信サービス	1.60	
食品・生活必需品小売り	1.38	
商業・専門サービス	1.22	
不動産	0.40	
	小計	94.96
投資証券		2.20
合計		97.16

(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）2021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	167	37,138,266.43	36,320,412.50	4,064,980,567	2.07
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ ドイツ金融先物 取引所	買建	ユーロ	124	5,167,575.00	5,038,120.00	654,250,263	0.33
	S&P 60	モントリオール 取引所	買建	カナダ・ド ル	10	2,451,507.80	2,404,200.00	211,112,802	0.11
	FTSE100INDEX	インターコンチ ネンタル取引所	買建	イギリス・ ポンド	19	1,337,415.00	1,344,250.00	202,215,527	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	2,405,800.00	2,332,200.00	187,648,812	0.10
	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	13	1,566,110.00	1,512,940.00	181,371,247	0.09

（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（2021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）

（2021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	1.500	2023/03/31	15,000,000	11,495.08	1,724,263,126	11,411.46	1,711,720,227	1.21
2	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	10,000,000	11,483.60	1,148,360,409	11,382.17	1,138,217,659	0.80
3	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/11/30	9,300,000	11,566.23	1,075,659,622	11,435.51	1,063,502,746	0.75
4	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.375	2024/08/15	8,300,000	11,944.38	991,384,282	11,788.32	978,430,870	0.69
5	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.625	2023/02/28	8,300,000	11,734.91	973,997,791	11,579.78	961,122,183	0.68
6	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	0.875	2030/11/15	8,500,000	10,678.28	907,654,412	10,602.67	901,227,055	0.64
7	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/03/31	7,300,000	11,820.47	862,894,455	11,665.47	851,579,607	0.60
8	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	8,000,000	10,511.73	840,938,900	10,394.57	831,565,600	0.59
9	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/02/29	7,000,000	11,806.74	826,472,368	11,657.16	816,001,725	0.58
10	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/08/31	6,900,000	11,449.06	789,985,570	11,350.26	783,168,064	0.55
11	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.625	2025/03/31	6,300,000	12,197.53	768,444,468	11,946.58	752,634,897	0.53

12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2023/05/31	6,300,000	11,567.98	728,782,818	11,452.12	721,483,974	0.51
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	6,100,000	11,983.30	730,981,868	11,755.53	717,087,613	0.51
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	6,300,000	11,497.64	724,351,486	11,296.92	711,706,275	0.50
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2024/05/15	6,000,000	11,956.96	717,418,128	11,790.50	707,430,579	0.50
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	5,900,000	12,088.23	713,205,823	11,825.92	697,729,386	0.49
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2026/02/28	5,800,000	12,180.13	706,447,784	11,967.57	694,119,099	0.49
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	6,000,000	11,607.76	696,465,920	11,474.86	688,491,620	0.49
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.750	2026/03/31	6,200,000	11,103.28	688,403,551	11,101.93	688,320,236	0.49
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2028/05/31	6,000,000	11,360.31	681,619,031	11,157.89	669,473,958	0.47
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2023/05/15	5,800,000	11,593.33	672,413,614	11,470.48	665,288,326	0.47
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2031/02/15	6,000,000	10,776.91	646,615,176	10,821.26	649,275,900	0.46
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.500	2023/08/15	5,500,000	11,836.62	651,014,596	11,660.22	641,312,530	0.45
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2027/09/30	6,000,000	10,800.71	648,043,029	10,662.56	639,753,954	0.45
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2024/11/15	5,200,000	11,982.15	623,072,070	11,776.08	612,356,290	0.43
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2023/09/30	5,200,000	11,980.68	622,995,683	11,766.46	611,856,144	0.43
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2025/02/28	5,100,000	12,242.56	624,370,640	11,988.99	611,438,634	0.43
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.750	2028/02/15	5,000,000	12,546.84	627,342,204	12,228.13	611,406,715	0.43
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2024/09/30	5,200,000	11,916.41	619,653,822	11,717.93	609,332,701	0.43
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	5,200,000	11,733.40	610,137,124	11,533.00	599,716,323	0.42
										投資比率：合計	16.47

（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）2021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	-	99.02
合計		99.02

（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）2021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】

2021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
第8期	(2020年 2月20日)	分配付：	4,636,953,719	分配付：	1.2790
		分配落：	4,582,572,120	分配落：	1.2640
第9期	(2021年 2月22日)	分配付：	4,734,124,014	分配付：	1.2791
		分配落：	4,697,113,247	分配落：	1.2691
2020年 9月末日			4,678,330,047		1.2681
10月末日			4,637,742,384		1.2553
11月末日			4,703,738,207		1.2739
12月末日			4,734,609,999		1.2813
2021年 1月末日			4,724,893,479		1.2767
2月末日			4,706,796,699		1.2624
3月末日			4,766,498,135		1.2772
4月末日			4,764,227,017		1.2765
5月末日			4,802,167,004		1.2851
6月末日			4,810,988,459		1.2861
7月末日			4,639,818,669		1.2906
8月末日			4,645,422,644		1.2929
9月末日			4,622,509,261		1.2879

【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
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100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%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%
	自2021年 2月23日 至2021年 8月22日	1.4%

（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
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771
	自2021年 2月23日 至2021年 8月22日	62,101,168	165,838,884	3,597,339,055

(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

(2021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	12,879円
純資産総額	4,623百万円

分配の推移

決算期	分配金
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
第8期 (2020年2月20日)	150円
第9期 (2021年2月22日)	100円
設定来累計	930円

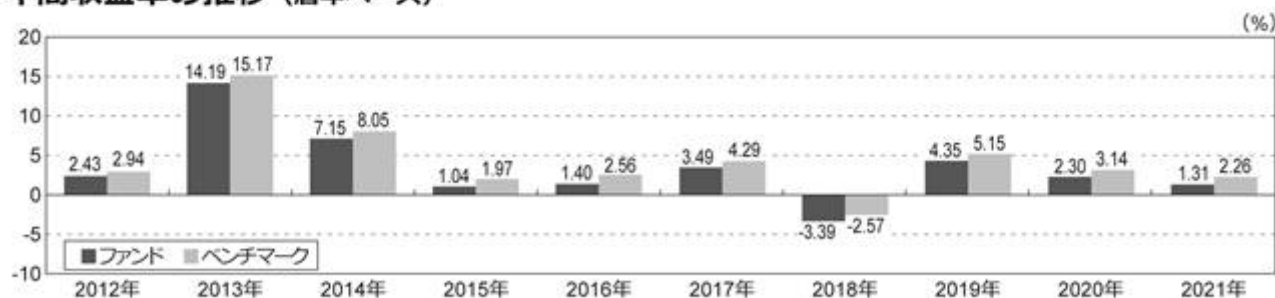
※分配金は1万円当たり、税引前です。

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	45.05%	US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.500%	2023/03/31	1.21%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	1.625%	2022/11/15	0.80%
		US TREASURY N/B	アメリカ	国債証券	—	2.000%	2022/11/30	0.75%
日本債券 インデックス・マザー・ファンド	30.08%	第4 2 8 回利付国債(2年)	日本	国債証券	—	0.005%	2023/09/01	1.94%
		第1 4 1 回利付国債(5年)	日本	国債証券	—	0.100%	2024/09/20	1.61%
		第3 6 3 回利付国債(10年)	日本	国債証券	—	0.100%	2031/06/20	1.43%
日本株式 インデックス・マザー・ファンド	5.27%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	—	—	3.56%
		ソニーグループ	日本	株式	電気機器	—	—	2.75%
		キーエンス	日本	株式	電気機器	—	—	2.32%
外国株式 インデックス・オープン・ マザー・ファンド	5.08%	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	—	—	4.27%
		MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・ サービス	—	—	3.64%
		AMAZON COM INC	アメリカ	株式	小売	—	—	2.69%

※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。

※2021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(2021年2月23日から2021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 (2021年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (2021年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	562,108	1,966,778
コール・ローン	729,542,983	703,872,577
親投資信託受益証券	4,026,434,635	3,945,121,948
流動資産合計	4,756,539,726	4,650,961,303
資産合計		
	4,756,539,726	4,650,961,303
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,010,767	-
未払解約金	2,439,613	453,557
未払受託者報酬	1,314,096	1,295,638
未払委託者報酬	18,397,201	18,138,930
未払利息	1,992	5,692
その他未払費用	262,810	259,774
流動負債合計	59,426,479	20,153,591
負債合計		
	59,426,479	20,153,591
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,701,076,771	1 3,597,339,055
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	996,036,476	1,033,468,657
(分配準備積立金)	267,726,376	255,982,028
元本等合計	4,697,113,247	4,630,807,712
純資産合計		
	4,697,113,247	4,630,807,712
負債純資産合計		
	4,756,539,726	4,650,961,303

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2020年 2月21日 至 2020年 8月20日	当中間計算期間 自 2021年 2月23日 至 2021年 8月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	38,987,304	87,987,313
営業収益合計	38,987,304	87,987,313
営業費用		
支払利息	338,307	350,549
受託者報酬	1,251,703	1,295,638
委託者報酬	17,523,803	18,138,930
その他費用	262,416	261,457
営業費用合計	19,376,229	20,046,574
営業利益又は営業損失()	19,611,075	67,940,739
経常利益又は経常損失()	19,611,075	67,940,739
中間純利益又は中間純損失()	19,611,075	67,940,739
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()	542,632	3,051,770
期首剰余金又は期首欠損金()	957,132,137	996,036,476
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,362,854	17,111,529
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,362,854	17,111,529
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,561,625	44,568,317
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,561,625	44,568,317
中間剰余金又は中間欠損金()	992,087,073	1,033,468,657

(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 (2021年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (2021年 8月22日現在)
1 期首元本額	3,625,439,983円	3,701,076,771円
期中追加設定元本額	129,832,227円	62,101,168円
期中一部解約元本額	54,195,439円	165,838,884円
2 受益権の総数	3,701,076,771口	3,597,339,055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 (2021年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (2021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。 (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）

	前計算期間末 (2021年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (2021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)	1.2691円 (12,691円)	1.2873円 (12,873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	(2021年 2月22日現在)	(2021年 8月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		326,844	7,712,775
コール・ローン		424,200,395	2,769,063,808
株式		102,630,639,840	83,564,524,770
派生商品評価勘定		19,894,820	
未収入金			2,646,700
未収配当金		138,709,857	101,628,031
前払金			83,685,000
差入委託証拠金		24,000,000	100,480,000
流動資産合計		103,237,771,756	86,629,741,084
資産合計		103,237,771,756	86,629,741,084
負債の部			
流動負債			

前受金		17,025,000	
派生商品評価勘定		511,320	83,788,620
未払解約金		54,490,000	
未払利息		1,158	7,466
その他未払費用		95	2,818
流動負債合計		72,027,573	83,798,904
負債合計		72,027,573	83,798,904
純資産の部			
元本等			
元本	1	30,837,565,787	26,361,217,131
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		72,328,178,396	60,184,725,049
元本等合計		103,165,744,183	86,545,942,180
純資産合計		103,165,744,183	86,545,942,180
負債純資産合計		103,237,771,756	86,629,741,084

（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	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
1 期首元本額	39,957,438,054円	30,837,565,787円
期中追加設定元本額	4,496,542,874円	1,640,555,464円
期中一部解約元本額	13,616,415,141円	6,116,904,120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)	77,885,317円	68,213,610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 >	966,270,156円	866,080,340円
バランスファンドVA30A < 適格機関投 資家限定 >	1,800,931円	3,163,616円
バランスファンドVA30B < 適格機関投 資家限定 >	59,201,981円	47,095,374円
バランスファンドVA40A < 適格機関投 資家限定 >	108,056円	104,103円
バランスファンドVA40B < 適格機関投 資家限定 >	3,085,321円	2,973,842円
バランスファンドVA50A < 適格機関投 資家限定 >	10,424,368円	6,146,907円
バランスファンドVA50B < 適格機関投 資家限定 >	5,334,743,584円	5,056,259,608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 >	305,896,023円	339,437,572円
バランスファンドVA50C < 適格機関投 資家限定 >	2,807,158円	2,717,178円
バランスファンドVA25A < 適格機関投 資家限定 >	806,857,855円	754,559,392円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関 投資家限定 >	572,925,014円	550,762,527円
バランスファンドVA75A < 適格機関投 資家限定 >	42,340,565円	34,166,393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 >	76,543,985円	74,845,930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 >	8,413,872,369円	8,235,478,448円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家 限定 >	156,975,461円	140,277,725円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家 限定 >	1,923,669,346円	1,773,925,658円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家 限定 >	310,112,500円	278,624,996円
バランスファンドVA35A < 適格機関投 資家限定 >	1,384,202,736円	1,268,373,795円
バランスファンドVA40C < 適格機関投 資家限定 >	42,681,797円	39,162,619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 >	4,358,069,504円	- 円
グローバル4資産30VA < 適格機関 投資家限定 >	15,785,928円	14,614,550円
グローバル4資産45VA < 適格機関 投資家限定 >	17,029,816円	16,311,209円
4資産バランス30VA2 < 適格機関 投資家限定 >	9,311,206円	8,041,077円
バランスファンドVA25B < 適格機 関投資家限定 >	485,099,134円	454,933,266円

バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	1,890,835円	1,719,835円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	2,455,575円	2,391,692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>	283,343,486円	145,385,610円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	262,441,846円	247,379,219円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,254,941,539円	1,165,372,211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>	76,579,661円	72,622,657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>	195,842,569円	235,387,767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>	42,010,156円	75,334,621円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	2,812,488,573円	3,909,971,575円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	7,210,502円	6,792,395円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	48,644,371円	46,203,233円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	531,262円	297,976円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	447,501,796円	395,536,300円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	17,116,080円	14,932,178円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	6,867,425円	5,620,127円
計	30,837,565,787円	26,361,217,131円
2 受益権の総数	30,837,565,787口	26,361,217,131口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	(2021年 2月22日現在)	(2021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	(2021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）	465,475,000		484,875,000	19,400,000
	合 計	465,475,000		484,875,000	19,400,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2021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 TOPIX（先物）	3,037,640,000		2,953,955,000	83,685,000
	合 計	3,037,640,000		2,953,955,000	83,685,000

（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）

	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
1口当たり純資産額	3.3455円	3.2831円
（1万口当たり純資産額）	（33,455円）	（32,831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	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		480,027	2,036,587
コール・ローン		537,238,230	645,789,829
国債証券		131,463,667,900	134,295,767,000
地方債証券		9,657,449,106	10,169,551,600
特殊債券		13,188,803,752	13,513,188,871
社債券		5,377,069,500	5,843,318,000
未収利息		398,230,776	381,150,012
前払費用		4,603,376	3,604,919
流動資産合計		160,627,542,667	164,854,406,818
資産合計		160,627,542,667	164,854,406,818
負債の部			
流動負債			
未払解約金		116,223,662	183,890,000
未払利息		1,467	1,741
その他未払費用		449	1,355
流動負債合計		116,225,578	183,893,096

負債合計		116,225,578	183,893,096
純資産の部			
元本等			
元本	1	125,544,496,076	127,338,668,686
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		34,966,821,013	37,331,845,036
元本等合計		160,511,317,089	164,670,513,722
純資産合計		160,511,317,089	164,670,513,722
負債純資産合計		160,627,542,667	164,854,406,818

（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	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
1 期首元本額	126,399,340,034円	125,544,496,076円
期中追加設定元本額	26,451,548,900円	8,205,650,937円
期中一部解約元本額	27,306,392,858円	6,411,478,327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）	2,571,141,239円	1,079,553,488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＞	3,871,359,299円	4,143,854,044円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	10,676,170円	20,701,874円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	357,638,147円	285,179,376円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	468,118円	488,618円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	10,979,168円	11,656,022円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	34,477,913円	21,106,619円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	13,113,361,295円	13,213,475,149円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,695,414円	7,069,970円

バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	5,563,179,910円	5,286,781,268円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	2,171,224,162円	2,164,151,617円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	15,063,032円	12,835,654円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	1,604,024,819円	1,456,610,603円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	6,919,420,511円	6,989,608,351円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	1,792,997,772円	1,691,761,861円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	6,025,578,625円	5,815,070,610円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	157,078,081円	153,663,306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 >	91,251,969円	89,982,870円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	74,700,763円	75,695,216円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	38,790,804円	41,883,142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 >	13,977,472,080円	16,795,686,471円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	64,180,659円	62,482,028円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	3,950,442,911円	3,909,323,116円
バランスファンドVA20A < 適格機関投資家限定 >	19,594,067円	19,376,739円
バランスファンドVA35B < 適格機関投資家限定 >	12,233,807円	12,515,844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 >	1,947,793,322円	917,644,815円
日本債券インデックス・ファンド < 適格機関投資家限定 >	757,728,345円	752,479,748円
4資産インデックスバランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	2,661,470,507円	2,608,992,610円
世界分散ファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	10,519,759,389円	10,046,004,838円
4資産インデックスバランスVA50 < 適格機関投資家限定 >	15,881,612円	14,843,046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 >	788,219,500円	365,487,062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 >	552,279,862円	280,160,440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 >	436,094,205円	379,181,551円

ステート・ストリート日本債券イン デックス・オープン	1,866,281,311円	3,611,767,716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>	38,484,657,457円	40,494,395,588円
世界バランス40VA <適格機関投資 家限定>	43,193,295円	44,066,402円
世界バランス60VA <適格機関投資 家限定>	171,276,395円	178,564,468円
グローバルバランス40VA <適格機 関投資家限定>	3,017,858円	1,940,643円
グローバルバランス40VA2 <適格 機関投資家限定>	4,149,548,243円	4,142,460,197円
グローバルバランス40VA3 <適格 機関投資家限定>	102,436,216円	96,270,822円
グローバルバランス50VA <適格機 関投資家限定>	47,471,449円	43,894,884円
全世界株式ロー・カーボン・ファ ンド/為替ヘッジ付き <適格機関 投資家限定>	543,356,375円	円
計	125,544,496,076円	127,338,668,686円
2 受益権の総数	125,544,496,076口	127,338,668,686口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2021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 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）

	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
1口当たり純資産額	1.2785円	1.2932円
（1万口当たり純資産額）	（12,785円）	（12,932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	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		938,867,363	2,225,262,202
金銭信託		549,323	5,184,779
コール・ローン		712,950,439	1,861,455,187
株式		167,983,926,515	186,025,396,089
投資証券		3,658,871,131	4,408,481,074
派生商品評価勘定		75,222,683	142,171,700
未収入金		593,235	5,309,934
未収配当金		183,590,687	260,454,760
差入委託証拠金		879,525,962	1,120,321,182
流動資産合計		174,434,097,338	196,054,036,907
資産合計		174,434,097,338	196,054,036,907
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,154,822	15,853,357
未払金			127,052,551
未払解約金		396,904,700	53,960,000
未払利息		1,947	5,019
その他未払費用		55	2,175
流動負債合計		399,061,524	196,873,102

負債合計		399,061,524	196,873,102
純資産の部			
元本等			
元本	1	49,551,945,295	48,030,381,407
剰余金			
剰余金又は欠損金()		124,483,090,519	147,826,782,398
元本等合計		174,035,035,814	195,857,163,805
純資産合計		174,035,035,814	195,857,163,805
負債純資産合計		174,434,097,338	196,054,036,907

(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礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2021年 8月22日現在)
1 期首元本額	56,526,014,844円	49,551,945,295円
期中追加設定元本額	16,720,868,331円	3,431,026,444円
期中一部解約元本額	23,694,937,880円	4,952,590,332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	5,576,571,210円	5,441,457,710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	6,332,118,187円	6,350,591,161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	64,335,681円	71,351,259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)	73,584,902円	57,384,168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)	1,570,973,014円	2,734,422,658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)	41,545,913円	30,378,840円
バランスファンドVA30A < 適格機関投資家限定 >	878,687円	1,338,818円
バランスファンドVA30B < 適格機関投資家限定 >	56,407,364円	38,322,428円
バランスファンドVA40A < 適格機関投資家限定 >	62,473円	52,173円
バランスファンドVA40B < 適格機関投資家限定 >	2,925,442円	2,486,580円
バランスファンドVA50A < 適格機関投資家限定 >	6,675,997円	3,412,180円
バランスファンドVA50B < 適格機関投資家限定 >	5,090,361,978円	4,146,437,034円
バランスファンドVA50C < 適格機関投資家限定 >	1,148,238円	1,006,370円

バランスファンドVA25A < 適格機関投資家限定 >	513,754,778円	412,515,546円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関投資家限定 >	480,192,247円	394,988,592円
バランスファンドVA75A < 適格機関投資家限定 >	45,764,215円	33,154,236円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	149,026,914円	114,576,255円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	1,843,084,679円	1,479,018,201円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家限定 >	297,277,842円	227,623,436円
バランスファンドVA35A < 適格機関投資家限定 >	999,902,745円	779,558,098円
バランスファンドVA40C < 適格機関投資家限定 >	40,774,505円	31,982,348円
グローバル4資産30VA < 適格機関投資家限定 >	29,495,917円	24,755,084円
グローバル4資産45VA < 適格機関投資家限定 >	31,802,987円	27,403,050円
4資産バランス30VA2 < 適格機関投資家限定 >	17,267,699円	13,227,001円
バランスファンドVA25B < 適格機関投資家限定 >	206,701,315円	159,828,173円
バランスファンドVA20A < 適格機関投資家限定 >	628,755円	468,572円
バランスファンドVA35B < 適格機関投資家限定 >	943,567円	818,943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 >	1,522,054,177円	667,697,117円
4資産インデックスバランスVA20 < 適格機関投資家限定 >	167,893,887円	137,039,058円
4資産インデックスバランスVA50 < 適格機関投資家限定 >	28,344,188円	21,604,089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 >	23,956,376円	20,288,508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 >	13,432,765円	21,027,553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	222,467,876円	289,732,821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)	3,745,579,689円	3,236,598,352円
全世界株式インデックス・ファンド	699,297,276円	964,054,761円
世界バランス40VA < 適格機関投資家限定 >	20,449,789円	16,878,527円
世界バランス60VA < 適格機関投資家限定 >	224,746,309円	190,414,740円

グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,456,834円	759,487円
グローバルバランス４０ＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	1,205,737,914円	985,777,336円
グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格機関投資家限定＞	47,100,555円	36,857,632円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	25,249,624円	18,659,199円
ワールドエクイティ・ファンドＶＬ＜適格機関投資家限定＞	18,129,970,785円	18,844,433,313円
計	49,551,945,295円	48,030,381,407円
2 受益権の総数	49,551,945,295口	48,030,381,407口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2021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	（2021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	1,447,421,485		1,502,909,209	55,487,724
	S&P 60	105,591,512		109,495,711	3,904,199
	SPI 200	82,021,180		84,005,262	1,984,082
	FTSE100INDEX	87,128,909		87,973,366	844,457
	FSMI INDEX	86,685,385		87,502,983	817,598
	EURO STOXX 50	213,218,291		223,277,136	10,058,845
	合 計	2,022,066,762		2,095,163,667	73,096,905

（単位：円）

区 分	種 類	（2021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	3,839,827,200		3,966,092,732	126,265,532
	S&P 60	184,973,122		187,467,079	2,493,957
	SPI 200	171,880,488		173,902,500	2,022,012
	FTSE100INDEX	222,647,470		221,360,328	1,287,142
	FSMI INDEX	198,743,739		207,581,927	8,838,188
	EURO STOXX 50	613,133,357		613,404,774	271,417

合 計	5,231,205,376		5,369,809,340	138,603,964
-----	---------------	--	---------------	-------------

(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	(2021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	453,869,765		453,564,000	305,765
	カナダ・ドル	7,507,670		7,533,000	25,330
	オーストラリア・ドル	8,213,864		8,318,000	104,136
	イギリス・ポンド	14,711,284		14,796,000	84,716
	ユーロ	33,212,061		33,259,200	47,139
	売建				
	アメリカ・ドル	360,974,200		360,775,800	198,400
	カナダ・ドル	14,203,600		14,230,700	27,100
	オーストラリア・ドル	18,195,800		18,299,600	103,800
	イギリス・ポンド	36,945,500		36,992,500	47,000
	スイス・フラン	12,951,800		12,940,400	11,400
	香港・ドル	5,441,600		5,440,000	1,600
	シンガポール・ドル	4,782,600		4,784,400	1,800
	スウェーデン・クローナ	5,102,400		5,100,000	2,400
	ユーロ	49,866,200		49,884,900	18,700
	合 計		1,025,978,344		1,025,918,500

(単位：円)

区 分	種 類	(2021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	1,737,386,595		1,730,457,225	6,929,370
	カナダ・ドル	50,881,984		49,717,774	1,164,210
	オーストラリア・ドル	34,776,035		33,795,162	980,873
	イギリス・ポンド	80,987,264		79,436,559	1,550,705
	ユーロ	178,797,133		177,191,586	1,605,547
	売建				
	アメリカ・ドル	245,849,075		246,109,472	260,397
	オーストラリア・ドル	8,001,340		7,859,340	142,000

	ユーロ	14,187,448	14,123,967	63,481
	合 計	2,350,866,874	2,338,691,085	12,285,621

(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)

	(2021年 2月22日現在)	(2021年 8月22日現在)
1口当たり純資産額	3.5122円	4.0778円
(1万口当たり純資産額)	(35,122円)	(40,778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	(2021年 2月22日現在)	(2021年 8月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		261,226,148	476,191,979
金銭信託		49,454	291,024
コール・ローン		64,184,472	104,484,236
国債証券		138,129,530,256	140,603,477,724
派生商品評価勘定		105,000	3,817,710
未収入金		391,445,888	1,780,994,336
未収利息		941,126,587	812,108,355
前払費用		32,892,599	25,151,599
流動資産合計		139,820,560,404	143,806,516,963
資産合計		139,820,560,404	143,806,516,963
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		128,000	
未払解約金		263,144,116	2,036,326,834
未払利息		175	281

その他未払費用		4	195
流動負債合計		263,272,295	2,036,327,310
負債合計		263,272,295	2,036,327,310
純資産の部			
元本等			
元本	1	56,125,021,105	55,110,682,637
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		83,432,267,004	86,659,507,016
元本等合計		139,557,288,109	141,770,189,653
純資産合計		139,557,288,109	141,770,189,653
負債純資産合計		139,820,560,404	143,806,516,963

(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礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2021年 8月22日現在)
1 期首元本額	73,334,845,875円	56,125,021,105円
期中追加設定元本額	13,977,898,071円	4,859,244,335円
期中一部解約元本額	31,187,722,841円	5,873,582,803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	6,452,831,744円	6,549,920,649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	26,257,605円	26,198,832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）	88,566,395円	812,863,019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＞	4,747,875,742円	3,095,078,311円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,307,563,720円	1,130,075,022円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	2,175,827円	4,175,400円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	183,758,012円	143,752,021円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	78,138円	81,647円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	5,656,170円	5,868,899円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,384,806円	2,642,537円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,797,722,184円	6,653,435,904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＞	91,789,915円	88,060,132円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,478,376円	1,518,864円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,499,101,282円	2,327,378,451円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,220,574,038円	1,175,814,315円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	31,271,771円	25,678,264円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	825,024,786円	734,544,228円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,569,958,212円	3,497,506,268円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	933,979,159円	843,554,679円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,678,768,938円	2,505,515,658円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	81,154,270円	76,960,823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＞	158,208,287円	158,518,550円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	97,480,808円	95,302,449円

グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	54,679,175円	56,445,865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>	7,101,345,280円	8,417,368,824円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	44,247,215円	41,826,358円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	624,624,601円	596,635,312円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	2,339,798円	2,233,484円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	1,903,450円	1,895,176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>	3,486,611,388円	1,715,067,831円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	914,770,303円	870,987,057円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	1,655,521,939円	1,536,354,217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>	1,062,611,625円	1,000,135,191円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	33,554,864円	29,830,537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>	円	167,135,548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>	292,329,694円	435,396,314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>	91,235,383円	122,956,038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>	円	173,476,257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	88,152,516円	92,783,553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)	3,832,211,540円	4,445,629,800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>	3,702,495,339円	4,149,380,393円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	31,267,872円	30,982,685円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	148,264,459円	149,485,703円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	2,191,947円	1,366,535円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	1,058,247,755円	1,036,550,195円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	74,604,035円	67,607,723円

グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	16,150,742円	14,707,119円
計	56,125,021,105円	55,110,682,637円
2 受益権の総数	56,125,021,105口	55,110,682,637口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	(2021年 2月22日現在)	(2021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

通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2021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	52,850,000		52,745,000	105,000
	ユーロ	204,528,000		204,656,000	128,000
	合 計	257,378,000		257,401,000	23,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2021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 売建				
	アメリカ・ドル	934,830,000		934,041,200	788,800
	カナダ・ドル	43,355,000		42,868,600	486,400
	オーストラリア・ドル	39,675,000		39,299,550	375,450
	イギリス・ポンド	151,010,000		149,897,200	1,112,800
	ポーランド・ズロチ	5,629,400		5,603,440	25,960
	ユーロ	835,516,500		834,488,200	1,028,300
	合 計	2,010,015,900		2,006,198,190	3,817,710

（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）

	（2021年 2月22日現在）	（2021年 8月22日現在）
1口当たり純資産額	2.4865円	2.5725円

(1万口当たり純資産額)	(24,865円)	(25,725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】

(2021年9月30日現在)

資産総額	4,627,436,609円
負債総額	4,927,348円
純資産総額(-)	4,622,509,261円
発行済口数	3,589,225,169口
1口当たり純資産額(/)	1.2879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）

(2021年9月30日現在)

資産総額	91,855,137,916円
負債総額	434,443,651円
純資産総額(-)	91,420,694,265円
発行済口数	25,590,026,544口
1口当たり純資産額(/)	3.5725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）

(2021年9月30日現在)

資産総額	181,787,220,920円
負債総額	784,431,417円
純資産総額(-)	181,002,789,503円
発行済口数	140,554,583,440口
1口当たり純資産額(/)	1.2878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）

(2021年9月30日現在)

資産総額	196,890,689,339円
負債総額	335,570,271円
純資産総額(-)	196,555,119,068円
発行済口数	48,010,006,408口
1口当たり純資産額(/)	4.0940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）

(2021年9月30日現在)

資産総額	141,718,899,141円
負債総額	203,273,863円
純資産総額(-)	141,515,625,278円
発行済口数	55,233,693,068口
1口当たり純資産額(/)	2.5621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。

2021年9月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、127本であり、その純資産総額は2,598,172百万円です（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（2020年4月1日から2021年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

1. 財務諸表

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2020年3月31日現在)		当事業年度 (2021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	3,114,127		3,455,294	
有価証券	21,254		22,281	
前払金	39,342		59,450	
前払費用	9,920		20,090	
未収入金	902,862		795,709	
未収還付法人税等	-		592	
未収委託者報酬	660,964		651,298	
未収収益	40,244		41,992	
流動資産計	4,788,718	65.6	5,046,710	70.1
固定資産				
有形固定資産	69,492		4,695	
建物附属設備	59,016		-	
器具備品	10,475		4,695	
無形固定資産	0		0	
ソフトウェア	0		0	
投資その他の資産	2,445,819		2,149,769	
長期差入保証金	69,819		55,283	
繰延税金資産	2,369,725		2,088,211	
その他投資	6,275		6,275	
固定資産計	2,515,312	34.4	2,154,465	29.9
資産合計	7,304,030	100.0	7,201,176	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (2020年3月31日現在)		当事業年度 (2021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	137,851		141,855	
未払金	350,943		300,612	
未払手数料	140,557		163,883	
その他未払金	210,386		136,728	
未払費用	11,122		11,026	
未払法人税等	3,635		-	
未払消費税等	72,142		79,008	
賞与引当金	67,981		76,891	
流動負債計	643,675	8.8	609,394	8.5
固定負債				
退職給付引当金	96,989		81,500	
固定負債計	96,989	1.3	81,500	1.1
負債合計	740,665	10.1	690,894	9.6

(純資産の部)			%			%
株主資本		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
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	6,144,244			6,091,161		
純資産合計		6,563,364	89.9		6,510,281	90.4
負債・純資産合計		7,304,030	100.0		7,201,176	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度		当事業年度	
	自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日		自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
		%		%
営業収益				
委託者報酬	2,392,782		2,468,063	
投資顧問収入	2,907,674		2,871,928	
その他営業収益	66,452		78,227	
営業収益計	5,366,908	100.0	5,418,219	100.0
営業費用				
支払手数料	520,256		631,100	
広告宣伝費	30,443		28,458	
公告費	1,140		1,140	
調査費	632,099		527,766	
調査費	369,545		268,033	
委託調査費	261,450		259,021	
図書費	1,102		711	
委託計算費	265,563		242,239	
営業雑経費	39,755		38,381	
通信費	4,801		4,038	
印刷費	15,648		11,238	
協会費	16,300		18,183	
諸会費	-		5	
その他	3,005		4,915	
営業費用計	1,489,258	27.7	1,469,086	27.1
一般管理費				
給料	1,322,366		1,307,873	
役員報酬	197,080		235,947	
給料・手当	848,305		800,039	
賞与	253,121		210,310	
賞与引当金繰入額	23,858		61,576	
交際費	10,725		728	
旅費交通費	8,872		801	
租税公課	8,801		6,244	
不動産賃借料	97,021		91,686	
退職給付費用	106,349		71,604	

固定資産減価償却費		22,666			20,149	
福利厚生費		126,755			126,174	
事務手数料		1,057,318			1,306,329	
諸経費		186,258			202,081	
一般管理費計		2,947,135	54.9		3,133,675	57.8
営業利益		930,515	17.3		815,458	15.1
営業外収益						
為替差益		166			123	
有価証券運用益		3,384			1,026	
雑収入		63			36	
営業外収益計		3,614	0.1		1,186	0.0
営業外費用						
為替差損		289			656	
有価証券運用損		4,123			-	
雑損失		490			193	
営業外費用計		4,903	0.1		849	0.0
経常利益		929,225	17.3		815,794	15.1
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			102	
特別利益計		-	0.0		102	0.0
特別損失						
事業再構築費用		102,351			-	
事務処理損失		-			8,806	
固定資産除却損		-			45,130	
特別損失計		102,351	1.9		53,937	1.0
税引前当期純利益		826,874	15.4		761,960	14.1
法人税,住民税及び事業税		530	0.0		530	0.0
法人税等調整額		292,691	5.5		281,513	5.2
当期純利益		533,652	9.9		479,916	8.9

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本					株主資本 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	6,100,591	6,209,711	6,519,711	6,519,711
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	490,000	490,000	490,000	490,000
当期純利益	-	-	-	533,652	533,652	533,652	533,652
当期変動額合計	-	-	-	43,652	43,652	43,652	43,652
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株 主 資 本					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	6,144,244	6,253,364	6,563,364	6,563,364
当期変動額							

剰余金の配当	-	-	-	(533,000)	(533,000)	(533,000)	(533,000)
当期純利益	-	-	-	479,916	479,916	479,916	479,916
当期変動額合計	-	-	-	53,083	53,083	53,083	53,083
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281

[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

(会計上の見積りの開示に関する会計基準の適用)

「会計上の見積りの開示に関する会計基準」（企業会計基準第31号 2020年3月31日）を当事業年度の年度末に係る財務諸表から適用し、個別注記表に重要な会計上の見積りに関する注記を記載しております。

会計上の見積りに関する注記

会計上の見積りにより、当事業年度に係る財務諸表にその額を計上した項目であって、翌事業年度に係る財務諸表に重要な影響を及ぼす可能性があるものは、次のとおりです。

繰延税金資産 2,088,211千円

繰延税金資産の認識は、将来の事業計画に基づく課税所得の発生および金額によって見積もっております。

当該見積りは、将来の不確実な経済条件の変動などによって影響を受ける可能性があり、実際に発生した課税所得の時期および金額が見積りと異なった場合や将来の税法の改正等により、翌事業年度の財務諸表において、繰延税金資産の金額に重要な影響を与える可能性があります。

(追加情報)

繰延税金資産の回収可能性については、新型コロナウイルス感染症（COVID-19）の収束時期が不透明であることから、当社が顧客から収受する等顧問料等に一定の影響があるとの仮定を基に今後の業績見通し等を勘案し、繰延税金資産を計上しております。

なお、当該金額は現時点での最善の見積もりではあるものの、新型コロナウイルス感染症の感染拡大の状況や経済への影響等により、翌事業年度以降の財務諸表に影響を及ぼす可能性があります。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (2020年3月31日現在)	当事業年度 (2021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 68,147千円 器具備品 46,953千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 - 千円 器具備品 52,734千円
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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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65,925千円は、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1,057,318千円は、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77,977千円は、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1,306,329千円は、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 2019年4月1日 至 2020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

（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	効力発生日
2019年6月26日 定時株主総会	普通株式	490,000千円	79,032.25円	2019年3月31日	2019年6月27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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	利益剰余金	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6月25日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式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

（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	効力発生日
2020年6月24日 定時株主総会	普通株式	533,000千円	85,967.74円	2020年3月31日	2020年6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

（決議）	株式の種類	配当金の総額	配当の原資	1株当たりの配当額	基準日	効力発生日
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	利益剰余金	77,258.06円	2021年3月31日	2021年6月25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。

2020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	3,114,127	3,114,127	
(2) 未収入金	902,862	902,862	
(3) 未収委託者報酬	660,964	660,964	
(4) 預り金	137,851	137,851	
(5) 未払手数料	140,557	140,557	
(6) その他未払金	210,386	210,386	

(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。

2021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	3,455,294	3,455,294	
(2) 未収入金	795,709	795,709	
(3) 未収委託者報酬	651,298	651,298	
(4) 預り金	141,855	141,855	
(5) 未払手数料	163,883	163,883	
(6) その他未払金	136,728	136,728	

(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 (2020年3月31日現在)		当事業年度 (2021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	21,254千円	貸借対照表計上額	22,281千円
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	4,123千円	に含まれた評価差額	1,026千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
該当事項はありません。	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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
退職給付債務の期首残高	502,405
勤務費用	57,391
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	53,802
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
退職給付債務の期末残高	420,524

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
退職給付債務の期首残高	420,524
勤務費用	55,967
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	25,944
退職給付の支払額	<u>51,930</u>
退職給付債務の期末残高	450,505

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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
年金資産の期首残高	396,905
期待運用収益	2,938
数理計算上の差異の発生額	28,742
事業主からの拠出額	54,241
退職給付の支払額	<u>85,470</u>
年金資産の期末残高	339,872

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
年金資産の期首残高	339,872
期待運用収益	2,511
数理計算上の差異の発生額	25,875
事業主からの拠出額	52,607
退職給付の支払額	51,930
年金資産の期末残高	368,935

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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
積立型制度の退職給付債務	420,524
年金資産	399,872
	80,651
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	80,651
未認識数理計算上の差異	25,059
未認識過去勤務費用	8,721
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	96,989

(単位：千円)

	当事業年度
	自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
積立型制度の退職給付債務	450,505
年金資産	368,935
	81,570
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	81,570
未認識数理計算上の差異	69
未認識過去勤務費用	-
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	81,500

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度
	自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	86,784
(1)勤務費用	57,391

(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,938
(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	20,411
(6)その他	3,198

(単位：千円)

	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	52,417
(1)勤務費用	55,966
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,510
(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	25,059
(6)その他	15,300

6．年金資産に関する事項

前事業年度（2020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。

当事業年度（2021年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.9%

その他 2.1%

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 (2020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 (2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,564千円であります。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

当社の確定拠出制度への要拠出額は19,186千円であります。

(税効果会計関係)

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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	連結納税適用に伴う影響額
賞与引当金繰入超過額	賞与引当金繰入超過額
退職給付引当金	退職給付引当金
繰越欠損金	(注) 繰越欠損金
その他	その他
繰延税金資産 合計	繰延税金資産 合計
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	繰延税金資産の純額

(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

前事業年度(2020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)	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,652,186	1,652,186

(*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1,652,186千円(法定実効税率を乗じた金額)について、繰延税金資産1,652,186千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。

当事業年度(2021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)	-	-	-	-	-	1,987,863	1,987,863
繰延税金資産	-	-	-	-	-	1,987,863	1,987,863

(*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1,987,863千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,987,863千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。

前事業年度（2020年3月31日現在）	当事業年度（2021年3月31日現在）
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 30.6%	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 5.1%	交際費等永久に損金に 算入されない項目 6.8%
その他 0.3%	その他 0.4%
税効果会計適用後の 法人税等の負担率 35.4%	税効果会計適用後の 法人税等の負担率 37.0%
=====	=====

（資産除去債務関係）

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

前事業年度 自 2019年4月 1日 至 2020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	ソフトウェア使用料の支払	309,576	前払金	694
								投資顧問料の支払	189,363		
								ソフトウェアの使用契約	129,383	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	65,925		
							事務手数料の支払	1,057,318			
	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	投資信託計理業務委託	37,991	前払金	38,648
							兼職社員の人件費支払等	138,065			
	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受入れ	投資顧問料の支払	13,752	-	-
	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 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	526 22,050	- -	- -

(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 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021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	ソフトウェア使用料の支払	210,494	前払金	170
								投資顧問料の支払	182,861		
								ソフトウェアの使用契約	178,279	未払金	
								人件費等及び事務手数料の受取	77,977		
							事務手数料の支払	1,306,329			
	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	投資信託計理業務委託	38,231	前払金	59,280
							兼職社員の人件費支払等	人件費等の支払	122,715		
	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受入れ	投資顧問料の支払	17,282	-	-
	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	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受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	249	-	-
								投資顧問料の支払	21,878		

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
1株当たり純資産 1,058,607円22銭	1株当たり純資産 1,050,045円38銭
1株当たり当期純利益 86,073円06銭	1株当たり当期純利益 77,405円89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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日	当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
当期純利益 (千円)	533,652	479,916
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)	533,652	479,916
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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
該当事項はありません。

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。)。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。 ）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（2021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：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2021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 (2021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 (2021年6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 (2021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	10,858百万円 (2021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

2021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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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2021年2月23日から2021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。

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2021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（2021年2月23日から2021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。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合

は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

-
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2021年6月30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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤雅人
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2020年4月1日から2021年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査役に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以 上

(注) 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せん。