

【表紙】

【提出書類】 半期報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2021年11月19日

【計算期間】 第10期中 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日

【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）

【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

【連絡場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【電話番号】 03 - 4530 - 7385

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

## (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。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本株式インデックス・マザーファンド)

(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。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(日本債券インデックス・マザーファンド)

(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。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(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）【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<br>至2013年 2月20日 | 0.0000円   |
| 第2期  | 自2013年 2月21日<br>至2014年 2月20日 | 0.0050円   |
| 第3期  | 自2014年 2月21日<br>至2015年 2月20日 | 0.0160円   |
| 第4期  | 自2015年 2月21日<br>至2016年 2月22日 | 0.0070円   |

|     |                              |         |
|-----|------------------------------|---------|
| 第5期 | 自2016年 2月23日<br>至2017年 2月20日 | 0.0140円 |
| 第6期 | 自2017年 2月21日<br>至2018年 2月20日 | 0.0150円 |
| 第7期 | 自2018年 2月21日<br>至2019年 2月20日 | 0.0110円 |
| 第8期 | 自2019年 2月21日<br>至2020年 2月20日 | 0.0150円 |
| 第9期 | 自2020年 2月21日<br>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<br>至2013年 2月20日 | 6.7% |
| 第2期 | 自2013年 2月21日<br>至2014年 2月20日 | 8.6% |
| 第3期 | 自2014年 2月21日<br>至2015年 2月20日 | 7.7% |
| 第4期 | 自2015年 2月21日<br>至2016年 2月22日 | 2.2% |
| 第5期 | 自2016年 2月23日<br>至2017年 2月20日 | 3.7% |
| 第6期 | 自2017年 2月21日<br>至2018年 2月20日 | 2.2% |
| 第7期 | 自2018年 2月21日<br>至2019年 2月20日 | 0.7% |
| 第8期 | 自2019年 2月21日<br>至2020年 2月20日 | 3.8% |
| 第9期 | 自2020年 2月21日<br>至2021年 2月22日 | 1.2% |
|     | 自2021年 2月23日<br>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。

## 2【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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>至2021年 2月22日 | 129,832,227 | 54,195,439  | 3,701,076,771 |
|     | 自2021年 2月23日<br>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。

### 3【ファンドの経理状況】

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

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(2021年2月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。

## 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<br>(2021年 2月22日現在) | 当中間計算期間末<br>(2021年 8月22日現在) |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>資産の部</b>     |                           |                             |
| <b>流動資産</b>     |                           |                             |
| 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               |
| <b>資産合計</b>     |                           |                             |
|                 | 4,756,539,726             | 4,650,961,303               |
| <b>負債の部</b>     |                           |                             |
| <b>流動負債</b>     |                           |                             |
| 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                  |
| <b>負債合計</b>     |                           |                             |
|                 | 59,426,479                | 20,153,591                  |
| <b>純資産の部</b>    |                           |                             |
| <b>元本等</b>      |                           |                             |
| 元本              | 1 3,701,076,771           | 1 3,597,339,055             |
| <b>剰余金</b>      |                           |                             |
| 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               |
| <b>純資産合計</b>    |                           |                             |
|                 | 4,697,113,247             | 4,630,807,712               |
| <b>負債純資産合計</b>  |                           |                             |
|                 | 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<br>自 2020年 2月21日<br>至 2020年 8月20日 | 当中間計算期間<br>自 2021年 2月23日<br>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<br>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<br>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<br>(2021年 2月22日現在) | 当中間計算期間末<br>(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<br>(2021年 2月22日現在)  | 当中間計算期間末<br>(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<br>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。<br><br>(2)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「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。<br><br>(3)デリバティブ取引<br>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<br>同左<br><br>(2)有価証券<br>売買目的有価証券<br>同左<br><br>(3)デリバティブ取引<br>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<br>（2021年 2月22日現在） | 当中間計算期間末<br>（2021年 8月22日現在） |
|---------------------------|---------------------------|-----------------------------|
| 1口当たり純資産額<br>（1万口当たり純資産額） | 1.2691円<br>（12,691円）      | 1.2873円<br>（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<br>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<br>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引<br>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として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<br>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<br>ファンド名 |                 |                 |

|  |                |                |
|--|----------------|----------------|
| A M C / ステート・ストリート・リス<br>クバジェット型バランス・オープン<br>(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<br>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<br>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<br>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<br>資家限定 >                      | 108,056円       | 104,103円       |
| バランスファンドVA40B < 適格機関投<br>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<br>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<br>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<br>< 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<br>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<br>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<br>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<br>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 <<br>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 <<br>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<br>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<br>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<br>限定 >                        | 310,112,500円   | 278,624,996円   |
| バランスファンドVA35A < 適格機関投<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br/>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<br/>売買目的有価証券<br/>「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<br/>「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<br/>同左</p> <p>(2)有価証券<br/>売買目的有価証券<br/>同左</p> <p>(3)デリバティブ取引<br/>同左</p> |
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <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<br>買建<br>TOPIX（先物） | 465,475,000     |       | 484,875,000 | 19,400,000 |
|      | 合 計                         | 465,475,000     |       | 484,875,000 | 19,400,000 |

| 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<br>買建<br>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<br>(1万口当たり純資産額) | 3.3455円<br>(33,455円) | 3.2831円<br>(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<br>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<br>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 <<br>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<br>家限定>                    | 43,193,295円      | 44,066,402円      |
| 世界バランス60VA <適格機関投資<br>家限定>                    | 171,276,395円     | 178,564,468円     |
| グローバルバランス40VA <適格機<br>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<br>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<br>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<br>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<br>ンド/為替ヘッジ付き <適格機関<br>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<br>額、時価及びこれ<br>らの差額 | 貸借対照表計上額は時価を計上し<br>ているため、その差額はありませ<br>ん。   | 同左   |
| 2 金融商品の時価の<br>算定方法            | (1)有価証券及びデリバティブ取引<br>以外の金融商品<br>有価証券及びデリバティブ取引以<br>外の金融商品については、短期間で<br>決済されることから、時価は帳簿価<br>額と近似しているため、当該金融商<br>品の帳簿価額を時価としておりま<br>す。<br><br>(2)有価証券<br>売買目的有価証券<br>「注記表（重要な会計方針に係る<br>事項に関する注記）」に記載して<br>おります。<br><br>(3)デリバティブ取引<br>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<br>以外の金融商品<br>同左<br><br>(2)有価証券<br>売買目的有価証券<br>同左<br><br>(3)デリバティブ取引<br>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<br>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<br/>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<br/>売買目的有価証券<br/>「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<br/>「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<br/>同左</p> <p>(2)有価証券<br/>売買目的有価証券<br/>同左</p> <p>(3)デリバティブ取引<br/>同左</p> |

|                           |  |    |
|---------------------------|--|----|
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <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<br>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<br>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<br>外の取引 | 為替予約取引<br>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 | 29,044 |

(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<br>外の取引 | 為替予約取引<br>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<br>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<br/>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<br/>売買目的有価証券<br/>「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<br/>「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<br/>同左</p> <p>(2)有価証券<br/>売買目的有価証券<br/>同左</p> <p>(3)デリバティブ取引<br/>同左</p> |
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <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<br>外の取引 | 為替予約取引<br>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<br>外の取引 | 為替予約取引<br>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) |
|--------------|-----------|-----------|

#### 4【委託会社等の概況】

##### (1)【資本金の額】

(本書提出日現在)

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2)【事業の内容及び営業の状況】

投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、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)【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。

## 5【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<br>科 目 | 前事業年度<br>(2020年3月31日現在) |       | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |       |
|------------|-------------------------|-------|-------------------------|-------|
|            | 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<br>科 目 | 前事業年度<br>(2020年3月31日現在) |      | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |     |
|------------|-------------------------|------|-------------------------|-----|
|            | 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<br>科 目 | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |       | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |       |
|------------|---------------------------------------|-------|---------------------------------------|-------|
|            | 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<br>合計 | 純資産合計     |
|---------|---------|--------|--------------|-------------|-------------|------------|-----------|
|         | 資本金     | 利益剰余金  |              |             | 利益剰余金<br>合計 |            |           |
|         |         | 利益準備金  | その他利益<br>剰余金 |             |             |            |           |
|         |         |        | 別途積立金        | 繰越利益<br>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<br>合計 | 純資産合計     |
|-------|---------|--------|--------------|-------------|-------------|------------|-----------|
|       | 資本金     | 利益剰余金  |              |             | 利益剰余金<br>合計 |            |           |
|       |         | 利益準備金  | その他利益<br>剰余金 |             |             |            |           |
|       |         |        | 別途積立金        | 繰越利益<br>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<br>売買目的有価証券<br>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<br>リース資産以外の有形固定資産<br>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。<br>建物附属設備 9～10年<br>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<br>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。<br><br>(2) 退職給付引当金<br>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。<br>退職給付見込額の期間帰属方法<br>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。<br>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br>過去勤務費用<br>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。<br>数理計算上の差異<br>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<br>財務諸表作成のための重要な事項 | 消費税等の処理方法<br>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<br>(2020年3月31日現在)  | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在) |
|--------------------------|-------------------------|
| 1. 有形固定資産の減価償却累計額        | 1. 有形固定資産の減価償却累計額       |
| 建物附属設備 68,147千円          | 建物附属設備 - 千円             |
| 器具備品 46,953千円            | 器具備品 52,734千円           |
| 関係会社に係る注記<br>該当事項はありません。 | 関係会社に係る注記<br>同左         |

(損益計算書関係)

| 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日  | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日  |
|--|--|
| 移転価格調整金の取り扱いに係る注記<br>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<br>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<br>該当事項はありません。   | 関係会社に係る注記<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>(2020年3月31日現在)   | 当事業年度<br>(2021年3月31日現在)   |
|---|---|
| 売買目的の有価証券<br>貸借対照表計上額 21,254千円<br>当事業年度の損益<br>に含まれた評価差額 4,123千円 | 売買目的の有価証券<br>貸借対照表計上額 22,281千円<br>当事業年度の損益<br>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<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 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<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日  | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|--|---------------------------------------|
| 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。<br>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<br>自 2019年4月 1日<br>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<br>自 2020年4月 1日<br>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<br>自 2019年4月 1日<br>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<br>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<br>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<br>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<br>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<br>自 2020年4月 1日<br>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<br>(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<br>(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<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日     | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日     |
|---|---|
| 1. 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<br>(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<br>(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<br>(千円) | 1年超<br>2年以内<br>(千円) | 2年超<br>3年以内<br>(千円) | 3年超<br>4年以内<br>(千円) | 4年超<br>5年以内<br>(千円) | 5年超<br>(千円) | 合計<br>(千円) |
|-------------------|--------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------|------------|
| 税務上の繰越欠損金<br>(*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<br>(千円) | 1年超<br>2年以内<br>(千円) | 2年超<br>3年以内<br>(千円) | 3年超<br>4年以内<br>(千円) | 4年超<br>5年以内<br>(千円) | 5年超<br>(千円) | 合計<br>(千円) |
|--|--------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------|------------|
|  |              |                     |                     |                     |                     |             |            |

|                   |   |   |   |   |   |           |           |
|-------------------|---|---|---|---|---|-----------|-----------|
| 税務上の繰越欠損金<br>(*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<br>算入されない項目 5.1%                      | 交際費等永久に損金に<br>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<br>法人税等の負担率 35.4%                      | 税効果会計適用後の<br>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）



| 種類          | 会社等の名称                                | 所在地                  | 資本金<br>又は<br>出資金     | 事業の内容<br>又は<br>職業           | 議決権の<br>所有(被所<br>有)割合 | 関連当事者との関係  |                        | 取引の内容                               | 取引<br>金額<br>(千円) | 科目     | 期末<br>残高<br>(千円) |
|-------------|---------------------------------------|----------------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------|------------|------------------------|-------------------------------------|------------------|--------|------------------|
|             |                                       |                      |                      |                             |                       | 役員の<br>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<br>マサチューセッツ州ボストン市 | 29百万<br>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      | 38,231                              | 前払金              | 59,280 |                  |
|             |                                       |                      |                      |                             |                       |            | 兼職社員の人件費支払等            | 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<br>ロンドン           | 62百万<br>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           | 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<br>シンガポール市    | 136万<br>シンガポール<br>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<br>249<br>投資顧問料の支払<br>21,878 | -<br>-           | -<br>- |                  |

(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<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日               | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日               |
|---|---|
| 1株当たり純資産 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、記載しておりません。 | 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、記載しておりません。 |

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

|                    | 前事業年度<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 当事業年度<br>自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 |
|--------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 当期純利益 (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<br>自 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 |
|---------------------------------------|
| 該当事項はありません。                           |

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

## 独立監査人の監査報告書

2021年6月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。

## 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。