

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成30年6月8日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ  
株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 高村 孝

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号

【事務連絡者氏名】 中川 祐子

【電話番号】 03 - 4530 - 7409

【届出の対象とした募集（売出）内国投資  
信託受益証券に係るファンドの名称】 米国株式インデックス・ファンド

【届出の対象とした募集（売出）内国投資  
信託受益証券の金額】 当初自己設定額 999万円とします。  
継続申込期間 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したことに伴い、平成29年9月13日付をもって提出した有価証券届出書（平成29年10月31日および平成30年4月27日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書により訂正済み。以下「原届出書」といいます。）の一部に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 【訂正箇所および訂正事項】

原届出書の該当情報を以下の内容に訂正します。

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

当ファンドは、米国の株式を主要投資対象としたマザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にS&P500指数（円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行う事を基本とします。

<略>

<略>

ファンドの特色

#### 1 米国株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、米国の株式に投資します。

※マザーファンド受益証券については、「投資対象とするマザーファンドの概要」をご覧ください。

#### 2 S&P500指数(円ベース)をベンチマークとします。

※ベンチマークは、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出したものです。ベンチマークとは、ファンドの運用にあたって運用成果の基準とする指標です。

#### 3 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

※ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。

#### 4 実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## 投資対象とするマザーファンドの概要

### ■ 米国株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、S&P500指数(円ベース)の動きに連動した投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	米国の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含みます。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ S&amp;P500指数(円ベース)をベンチマークとします。</li> <li>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</li> </ul>

## ■ ベンチマーク(オリジナル指数)

### S&P 500<sup>®</sup>(S&P500指数)

「S&P 500<sup>®</sup>」は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが、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(「SSGA」)に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P 500<sup>®</sup>の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P 500<sup>®</sup>に関して、S&P Dow Jones IndicesとSSGAとの間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S&P 500<sup>®</sup>はSSGAまたは当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500<sup>®</sup>の決定、構成または計算においてSSGAまたは当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 500<sup>®</sup>に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500<sup>®</sup>またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P 500<sup>®</sup>を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、SSGA、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones IndicesとSSGAとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

#### <訂正後>

当ファンドは、米国の株式を投資対象としたマザーファンド受益証券に投資することにより、中長期的にS&P500指数(円ベース)の動きに連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本とします。

<略>

<略>

ファンドの特色

#### 1 米国株式インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、米国の株式に投資します。

※マザーファンド受益証券については、「投資対象とするマザーファンドの概要」をご覧ください。

#### 2 S&P500指数(円ベース)をベンチマークとします。

※S&P500指数は、米国株式の代表的な500銘柄で構成される株価指数であり、S&P500指数(円ベース)を当ファンドおよび投資対象とするマザーファンドのベンチマークとします。  
投資成果の比較基準となるベンチマークの騰落率は、オリジナル指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が算出します。

#### 3 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

※ファミリーファンド方式については、「ファンドの仕組み」をご覧ください。

#### 4 実質的な組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

※投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

## 投資対象とするマザーファンドの概要

### ■ 米国株式インデックス・マザーファンド

運用の基本方針	中長期的な観点から、S&P500指数(円ベース)の動きに連動した投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	米国の取引所に上場されている株式(これに準ずるものを含まず。)
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> <li>・ S&amp;P500指数(円ベース)をベンチマークとします。</li> <li>・ 株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</li> <li>・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</li> </ul>

### ■ ベンチマーク(オリジナル指数)

#### S&P 500<sup>®</sup>(S&P500指数)

「S&P 500<sup>®</sup>」は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが、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(「SSGA」)に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>およびS&P<sup>®</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>は、Dow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P 500<sup>®</sup>の能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S&P 500<sup>®</sup>に関して、S&P Dow Jones IndicesとSSGAとの間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/またはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S&P 500<sup>®</sup>はSSGAまたは当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500<sup>®</sup>の決定、構成または計算においてSSGAまたは当ファンドの所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格および数量、または当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 500<sup>®</sup>に基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500<sup>®</sup>またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS&P 500<sup>®</sup>を使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、SSGA、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones IndicesとSSGAとの間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

## (2) 【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

2017年9月29日 投資信託契約締結、設定、運用開始(予定)

< 訂正後 >

2017年9月29日 投資信託契約締結、設定、運用開始

## 2 【投資方針】

### (4) 【分配方針】

< 訂正前 >

収益分配方針

毎決算時（原則として3月10日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。なお、初回決算日は2018年3月12日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

< 略 >

< 訂正後 >

収益分配方針

毎決算時（原則として3月10日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

< 略 >

### 3【投資リスク】

< 訂正前 >

(1) ~ (3) < 略 >

#### < 参考情報 > 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

< ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移 >

ファンドの年間騰落率：ありません。

分配金再投資基準価額：ありません。

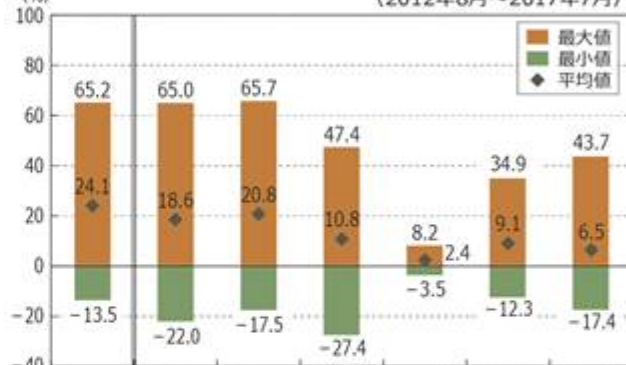
ベンチマークの年間騰落率（2012年8月～2017年7月）(%)



2012年8月 2013年8月 2014年8月 2015年8月 2016年8月 2017年7月

< ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較 >

(%) (2012年8月～2017年7月)



ベンチマーク 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

- ・有価証券届出書提出日現在、ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額はありませので、上記の左グラフは、各月末におけるファンドのベンチマークの年間騰落率の推移のみを表示したものです。
  - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
  - ・有価証券届出書提出日現在、ファンドの年間騰落率はありませので、上記の右グラフは、ベンチマークと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
  - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りませ。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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

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

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

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

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、Citigroup Index LLCに帰属します。

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

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

<訂正後>

(1) ~ (3) <略>

## <参考情報> 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

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

<ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移>



<ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較>



- ・上記の左グラフは、各月末におけるベンチマークの年間騰落率およびファンドの分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。
  - ・分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を分配時に再投資したものとみなして計算していますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。
  - ・年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
  - ・設定後1年を経過していないため、ファンドの年間騰落率はありません。代わりにベンチマークの年間騰落率を表示しています。
  - ・上記の右グラフは、ベンチマークと代表的な資産クラスについて、上記記載の5年間の年間騰落率の平均値・最大値・最小値を表示しています。
  - ・代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しています。
- ※上記のグラフは過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

## ■「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

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

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

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

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

### 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

<訂正前>

<略>

<信託報酬率の配分(税抜)>

支払先	信託報酬率(年率)	役務の内容
委託会社	<略>	<略>
販売会社	<略>	<略>
受託会社	<略>	<略>

<訂正後>

<略>

<信託報酬率の配分(税抜)>

支払先	信託報酬率(年率)	役務の内容
委託会社	<略>	<略>
販売会社	<略>	<略>
受託会社	<略>	<略>

消費税等相当額は、消費税および地方消費税に相当する金額です。

### (5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

<略>

<略>

少額投資非課税制度(NISA)、未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定

期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、当ファンドは「非課税累積投資契約にかかる非課税措置」（つみたてNISA）の適用が受けられるよう対象商品届出書を提出する予定です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の投資者に対する課税

< 略 >

上記は、2017年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 略 >

少額投資非課税制度（NISA）、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、当ファンドは「非課税累積投資契約にかかる非課税措置」（つみたてNISA）の適用対象です。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### 法人の投資者に対する課税

< 略 >

上記は、2018年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

## 5【運用状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

< 訂正・更新後 >

### （1）【投資状況】

（平成30年3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	730,731,206	99.99
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		63,368	0.01
純資産総額		730,794,574	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（米国株式インデックス・マザーファンド）

（平成30年3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	12,326,422,842	93.72



投資証券	アメリカ	345,144,722	2.62
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		480,922,225	3.66
純資産総額		13,152,489,789	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

（平成30年3月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	米国株式インデック ス・マザーファンド		345,630,123	2.2392	773,955,783	2.1142	730,731,206	99.99
									投資比率：合計	99.99

（注1）投資有価証券は1銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	99.99
合計		99.99

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

### < 参考情報 >

親投資信託受益証券（米国株式インデックス・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成30年3月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	26,899	19,121.07	514,337,801	17,824.94	479,473,254	3.65
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	40,872	10,256.40	419,199,973	9,696.52	396,316,361	3.01
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	小売	2,130	167,741.27	357,288,912	153,765.40	327,520,305	2.49
4	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	10,206	22,622.74	230,887,741	21,192.75	216,293,259	1.64
5	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービ ス	12,675	19,678.83	249,429,236	16,976.08	215,171,935	1.64
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	18,130	12,540.56	227,360,526	11,683.21	211,816,648	1.61
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	14,160	14,214.91	201,283,153	13,614.65	192,783,528	1.47
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービ ス	1,633	123,242.64	201,255,246	109,617.36	179,005,164	1.36

9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	22,517	7,921.25	178,362,885	7,926.56	178,482,495	1.36
10	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	1,560	123,327.64	192,391,120	110,185.75	171,889,775	1.31
11	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	50,484	3,476.17	175,491,107	3,186.13	160,848,970	1.22
12	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	24,795	5,544.66	137,479,983	5,532.97	137,190,219	1.04
13	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	23,191	6,186.35	143,467,763	5,568.03	129,128,378	0.98
14	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	32,550	3,936.19	128,123,049	3,787.45	123,281,692	0.94
15	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	10,159	12,453.45	126,514,626	12,115.60	123,082,477	0.94
16	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	9,549	13,227.94	126,313,621	12,708.42	121,352,786	0.92
17	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	31,266	3,906.44	122,138,903	3,770.45	117,887,127	0.90
18	アメリカ	株式	UNITED HEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	5,104	23,949.68	122,239,183	22,735.35	116,041,277	0.88
19	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	25,341	4,820.10	122,146,377	4,556.63	115,469,652	0.88
20	アメリカ	株式	HOME DEPOT	小売	6,055	19,352.67	117,180,467	18,936.21	114,658,797	0.87
21	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	13,370	8,530.00	114,046,228	8,422.70	112,611,595	0.86
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	21,876	5,206.82	113,904,446	5,080.39	111,138,760	0.85
23	アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	2,903	37,664.20	109,339,186	34,833.97	101,123,018	0.77
24	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	13,451	8,085.92	108,763,796	7,171.19	96,459,811	0.73
25	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	20,257	4,761.67	96,457,286	4,614.00	93,465,862	0.71
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	4,882	19,467.41	95,039,932	18,608.99	90,849,130	0.69
27	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	24,396	3,944.69	96,234,686	3,630.22	88,562,866	0.67
28	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	8,239	11,505.79	94,796,220	10,560.25	87,005,949	0.66
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	7,499	11,956.24	89,659,915	11,596.09	86,959,123	0.66
30	アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8,440	12,673.36	106,963,239	10,055.61	84,869,399	0.65
									投資比率：合計	36.36

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

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

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	ソフトウェア・サービス	14.23
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73
	資本財	7.18
	小売	6.23

銀行	6.19
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.67
エネルギー	5.50
ヘルスケア機器・サービス	5.49
各種金融	5.47
食品・飲料・タバコ	4.16
半導体・半導体製造装置	4.03
素材	2.76
公益事業	2.73
保険	2.56
メディア	2.46
運輸	2.06
電気通信サービス	1.85
消費者サービス	1.78
食品・生活必需品小売り	1.63
家庭用品・パーソナル用品	1.60
耐久消費財・アパレル	1.18
自動車・自動車部品	0.59
商業・専門サービス	0.57
不動産	0.07
小計	93.72
投資証券	2.62
合計	96.34

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

（注2）平成30年3月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数 先物取引	MINI S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	41	5,627,912.50	5,418,150.00	575,624,256	4.38

（注1）投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（平成30年3月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

（注2）先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### （3）【運用実績】

##### 【純資産の推移】

平成30年3月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末	純資産総額（円）	1口当たりの 純資産額（円）
---------	----------	-------------------

第1期	(平成30年 3月12日)	分配付:	755,230,732	分配付:	1.0599
		分配落:	755,230,732	分配落:	1.0599
平成29年 9月末日			9,989,984		1.0000
10月末日			109,469,486		1.0295
11月末日			264,039,072		1.0424
12月末日			478,252,791		1.0771
平成30年 1月末日			673,392,476		1.0897
2月末日			716,880,067		1.0474
3月末日			730,794,574		0.9984

## 【分配の推移】

	計算期間	一口当たりの分配金
第1期	自平成29年 9月29日 至平成30年 3月12日	0.0000円

## 【収益率の推移】

	計算期間	収益率
第1期	自平成29年 9月29日 至平成30年 3月12日	6.0%

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済口数(口)
第1期	自平成29年 9月29日 至平成30年 3月12日	1,054,830,520	342,291,731	712,538,789

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

(参考情報) 運用実績

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## <基準価額・純資産総額>

基準価額	9,984円
純資産総額	731百万円

## 分配の推移

決算期	分配金
第1期 (2018年3月12日)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

(マザーファンドのデータを表示しています。)

### <銘柄別投資比率>

順位	国/地域名	種類	銘柄名	投資比率
1	アメリカ	株式	APPLE INC	3.65%
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	3.01%
3	アメリカ	株式	AMAZON COM INC	2.49%
4	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1.64%
5	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	1.64%
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	1.61%
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	1.47%
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	1.36%
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	1.36%
10	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	1.31%

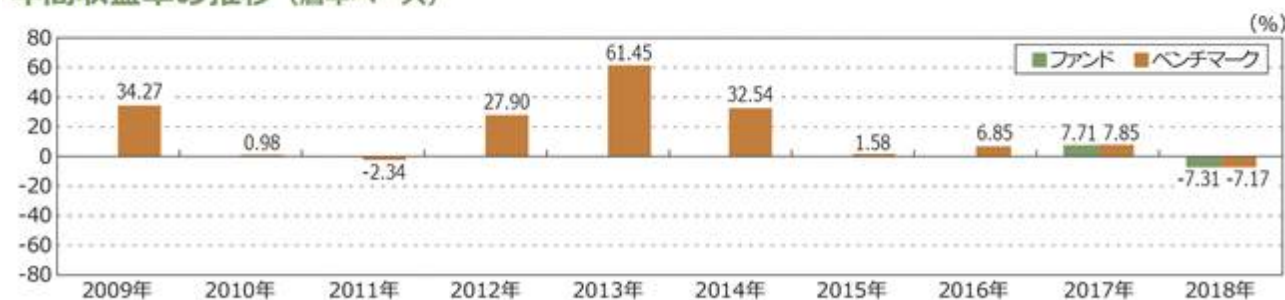
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

### <業種別投資比率>

順位	業種	投資比率
1	ソフトウェア・サービス	14.23%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.73%
3	資本財	7.18%
4	小売	6.23%
5	銀行	6.19%
6	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.67%
7	エネルギー	5.50%
8	ヘルスケア機器・サービス	5.49%
9	各種金融	5.47%
10	食品・飲料・タバコ	4.16%

(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10業種について記載しています。

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※2017年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定日から年末までで算出しています。

※2018年のファンドとベンチマークの年間収益率は年初から3月末までで算出しています。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (4)【計算期間】

<訂正前>

1) 当ファンドの計算期間は、毎年3月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。ただし、第1計算期間は2017年9月29日から2018年3月12日までとします。

2) < 略 >

< 訂正後 >

1) 当ファンドの計算期間は、毎年3月11日から翌年3月10日までとすることを原則とします。

2) < 略 >

### 第3【ファンドの経理状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

(1) 当ファンドの財務諸表は、「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）並びに同規則第2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、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) 当ファンドの第1期計算期間は、約款第36条により、平成29年9月29日から平成30年3月12日までとしております。

(3) 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、第1期計算期間(平成29年9月29日から平成30年3月12日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 米国株式インデックス・ファンド

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期
	(平成30年 3月12日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	947,795
親投資信託受益証券	755,154,454
流動資産合計	756,102,249
資産合計	756,102,249
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,795
未払受託者報酬	55,940
未払委託者報酬	783,178
未払利息	2
その他未払費用	18,602
流動負債合計	871,517
負債合計	871,517
純資産の部	
元本等	
元本	1 712,538,789
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	42,691,943
(分配準備積立金)	2,371,306
元本等合計	755,230,732
純資産合計	755,230,732
負債純資産合計	756,102,249



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期
	自 平成29年 9月29日
	至 平成30年 3月12日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,606,746
営業収益合計	1,606,746
営業費用	
支払利息	1,468
受託者報酬	55,940
委託者報酬	783,178
その他費用	18,652
営業費用合計	859,238
営業利益又は営業損失（ ）	2,465,984
経常利益又は経常損失（ ）	2,465,984
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,465,984
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	4,492,144
剰余金増加額又は欠損金減少額	67,041,127
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	67,041,127
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,391,056
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,391,056
分配金	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	42,691,943

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成30年3月10日が休日のため、当計算期間は平成29年9月29日から平成30年3月12日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 (平成30年 3月12日現在)
1 期首元本額	9,990,000円
期中追加設定元本額	1,044,840,520円
期中一部解約元本額	342,291,731円
2 受益権の総数	712,538,789口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期 自 平成29年 9月29日 至 平成30年 3月12日
1 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,371,306円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(40,320,637円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は42,691,943円(1万口当たり599円)ですが、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## 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	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(4) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。

3 金融商品に係るリスク管理体制	運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。
------------------	---

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 (平成30年 3月12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
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p>
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。

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	第1期 (平成30年 3月12日現在)	
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額	
親投資信託受益証券	4,445,928	
合計	4,445,928	

## (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。

## (関連当事者との取引に関する注記)

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）

	第1期 (平成30年 3月12日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0599円 (10,599円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

株式

該当する事項はありません。

株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額（口）	評価額（円）	備考
親投資信託 受益証券	米国株式インデックス・マザーファンド	336,536,590	755,154,454	
合計		336,536,590	755,154,454	

（注）親投資信託受益証券における券面総額は、証券数です。

第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当する事項はありません。

<参考>

当ファンドは「米国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

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

（1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（平成30年 3月12日現在）
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		368,312,912
コール・ローン		15,313,172
株式		13,781,124,421
投資証券		362,524,516
派生商品評価勘定		6,655,792
未収入金		88,127
未収配当金		25,682,790
差入委託証拠金		143,699,742
流動資産合計		14,703,401,472
資産合計		14,703,401,472

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,830,718
未払解約金		8,000
未払利息		37
その他未払費用		51
流動負債合計		2,838,806
負債合計		2,838,806
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,551,228,228
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		8,149,334,438
元本等合計		14,700,562,666
純資産合計		14,700,562,666
負債純資産合計		14,703,401,472

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成30年 3月12日現在)
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	8,988,912,960円 1,435,596,632円 3,873,281,364円
元本の内訳 ファンド名 欧米株式インデックス・ファンドVA<適格機関投資家限定> 世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定> 米国株式インデックス・ファンド2<適格機関投資家限定> 米国株式インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定> 米国株式インデックス・ファンド 計	326,151,539円 752,068,537円 3,506,925,989円 1,629,545,573円 336,536,590円 6,551,228,228円
2 受益権の総数	6,551,228,228口

## (金融商品に関する注記)

## 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	<p>当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品への投資並びにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p>
----------------	--

2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、価格変動リスク、為替変動リスク等の市場リスクに晒されております。</p> <p>デリバティブ取引には、株価指数先物取引、為替予約取引があり、株価指数先物取引はファンド資金の流出入等に伴う組入比率やキャッシュ・ポジションの調整、現物資産の流動性や取引コスト等を勘案した場合の代替など、効率的な運用に資する目的として、また為替予約取引は保有外貨建資産の売却代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払い目的に関連して利用しております。これらは、それぞれの取引種類により、株価変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク及びカウンターパーティーリスク等の信用リスクに晒されております。</p>
3 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行っております。また、業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率及び対ベンチマーク超過収益率の算出と要因分析を行っております。さらに、コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をしております。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	(平成30年 3月12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。
2 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>

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る場合、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>
---------------------------	---

## (有価証券関係に関する注記)

## 売買目的有価証券

(単位：円)

種 類	(平成30年 3月12日現在)	
	当期間の損益に含まれた評価差額	
株式	2,095,216,417	
投資証券	4,478,902	
合計	2,090,737,515	

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの期末日までを指しております。

## (デリバティブ取引等関係に関する注記)

## 取引の時価等に関する事項

## 株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	(平成30年 3月12日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			
市場取引	株価指数先物取引 買建 MINI S&P 500	457,677,814		461,494,058	3,816,244
	合 計	457,677,814		461,494,058	3,816,244

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## 通貨関連

(単位：円)

区 分	種 類	(平成30年 3月12日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
		うち1年超			



市場取引以外の取引	為替予約取引 買建			
	アメリカ・ドル	10,000,000	10,020,614	20,614
	売建			
	アメリカ・ドル	84,000,000	84,011,784	11,784
	合計	94,000,000	94,032,398	8,830

## (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。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当する事項はありません。

## ( 1口当たり情報に関する注記 )

	(平成30年 3月12日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2439円 (22,439円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	3,346	58.03	194,168.38	
	ANDEAVOR	801	102.16	81,830.16	
	APACHE CORP	2,501	35.32	88,335.32	
	BEAR NEWCO INC-CLASS A	2,349	30.24	71,033.76	
	CABOT OIL GAS CORP	3,072	25.52	78,397.44	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	7,303	3.10	22,639.30	
	CHEVRON CORPORATION	10,430	117.22	1,222,604.60	
	CIMAREX ENERGY CO	447	92.89	41,521.83	
	CONCHO RESOURCES INC	796	153.29	122,018.84	
	CONOCOPHILLIPS	6,676	55.06	367,580.56	
	DEVON ENERGY CORPORATION	2,759	32.72	90,274.48	
	EOG RESOURCES INC	2,986	102.80	306,960.80	
	EQT CORPORATION	1,106	52.44	57,998.64	
	EXXON MOBIL CORPORATION	23,412	74.56	1,745,598.72	
	HALLIBURTON CO	5,161	46.99	242,515.39	

HELMERICH & PAYNE	745	66.89	49,833.05
HESS CORP	1,402	48.46	67,940.92
KINDER MORGAN INC	11,391	16.33	186,015.03
MARATHON OIL CORP	3,943	15.22	60,012.46
MARATHON PETROLEUM CORP	2,976	70.22	208,974.72
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,850	37.72	69,782.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	1,206	23.37	28,184.22
NOBLE ENERGY INC	2,367	31.08	73,566.36
OCCIDENTAL PETROLEUM	3,895	63.67	247,994.65
ONEOK INC NEW	2,538	57.31	145,452.78
PHILLIPS 66	2,123	95.91	203,616.93
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	952	171.53	163,296.56
RANGE RESOURCES CORP	877	15.74	13,803.98
SCHLUMBERGER LTD	7,845	68.78	539,579.10
TECHNIPFMC PLC	1,769	30.78	54,449.82
VALERO ENERGY CORP	2,626	94.32	247,684.32
WILLIAMS COS	4,737	28.00	132,636.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS	1,152	171.10	197,107.20
ALBEMARLE CORP	620	101.76	63,091.20
AVERY DENNISON CORP	493	117.33	57,843.69
BALL CORP	1,878	41.81	78,519.18
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,680	41.50	69,720.00
DOWDUPONT INC	12,845	72.23	927,794.35
EASTMAN CHEMICAL CO	576	109.29	62,951.04
ECOLAB INC	1,547	134.91	208,705.77
FMC CORP	824	83.55	68,845.20
FREEPORT MCMORAN INC	8,117	18.43	149,596.31
INT'L FLAVORS FRAGRANCES	453	141.01	63,877.53
INT'L PAPER CO	2,149	55.24	118,710.76
LYONDELLBASELL INDU CL A	1,956	112.28	219,619.68
MARTIN MARIETTA MATERIALS	337	209.18	70,493.66
MONSANTO CO	2,324	123.51	287,037.24
MOSAIC CO/THE	1,905	28.25	53,816.25
NEWMONT MINING CORP HOLDING CO	3,137	37.71	118,296.27
NUCOR CORP	1,534	67.16	103,023.44
PACKAGING CORP OF AMERICA	437	119.86	52,378.82
PPG INDUSTRIES	1,491	117.65	175,416.15
PRAXAIR	1,712	160.09	274,074.08
SEALED AIR CORP	1,326	44.65	59,205.90
SHERWIN-WILLIAMS CO	485	421.16	204,262.60
VULCAN MATERIALS CO	727	121.20	88,112.40
WESTROCK COMPANY	1,352	67.07	90,678.64
3M CO	3,281	241.35	791,869.35
ACUITY BRANDS INC	290	152.69	44,280.10
ALLEGION PLC W/I	413	87.21	36,017.73
AMETEK INC	991	78.79	78,080.89
ARCONIC INC	2,906	25.19	73,202.14
BOEING CO	3,101	354.52	1,099,366.52
CATERPILLAR	3,403	158.25	538,524.75

CUMMINS ENGINE CO	924	162.37	150,029.88
DEERE & CO	1,697	167.93	284,977.21
DOVER CORP	768	102.69	78,865.92
EATON CORP PLC	2,620	83.14	217,826.80
EMERSON ELECTRIC CO	3,806	72.27	275,059.62
FASTENAL CO	1,444	57.97	83,708.68
FLOWSERVE CORP	591	45.58	26,937.78
FLUOR CORP	628	58.52	36,750.56
FORTIVE CORPORATION	1,542	80.27	123,776.34
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,100	63.52	69,872.00
GENERAL DYNAMICS CORP	1,559	229.95	358,492.05
GENERAL ELECTRIC CO	47,654	14.94	711,950.76
GRAINGER (WW)	305	280.43	85,531.15
HARRIS CORP	651	157.72	102,675.72
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,309	154.21	664,490.89
HUNTINGTON INGALLS IND	300	264.03	79,209.00
ILLINOIS TOOL WORKS	1,598	170.30	272,139.40
INGERSOLL-RAND PLC	1,437	89.63	128,798.31
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	522	60.80	31,737.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	5,540	38.54	213,511.60
L3 TECHNOLOGIES INC	476	210.40	100,150.40
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	1,367	340.49	465,449.83
MASCO CORP	1,226	42.48	52,080.48
NORTHROP GRUMMAN CORP	941	349.64	329,011.24
PACCAR INC	1,873	69.07	129,368.11
PARKER HANNIFIN CORP	758	186.58	141,427.64
PENTAIR PLC	1,076	71.82	77,278.32
QUANTA SERVICES INC	581	35.99	20,910.19
RAYTHEON COMPANY	1,615	214.81	346,918.15
ROCKWELL AUTOMATION INC	729	189.13	137,875.77
ROCKWELL COLLINS	944	137.82	130,102.08
ROPER TECHNOLOGIES INC	502	285.04	143,090.08
SMITH (A.O.) CORP	1,100	66.49	73,139.00
SNAP-ON	400	153.38	61,352.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	871	159.98	139,342.58
TEXTRON	1,273	60.40	76,889.20
TRANSDIGM GROUP INC	250	292.00	73,000.00
UNITED RENTALS INC	560	189.40	106,064.00
UNITED TECHNOLOGIES CORP	4,065	134.07	544,994.55
XYLEM INC	778	79.48	61,835.44
CINTAS CORP	396	178.30	70,606.80
EQUIFAX INC	697	124.92	87,069.24
IHS MARKIT LIMITED	1,844	49.06	90,466.64
NIELSEN HOLDINGS PLC	1,780	33.41	59,469.80
REPUBLIC SERVICES INC	1,537	68.90	105,899.30
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	866	60.51	52,401.66
STERICYCLE INC	560	64.67	36,215.20
VERISK ANALYTICS INC	1,040	105.84	110,073.60
WASTE MANAGEMENT (NEW)	2,231	87.21	194,565.51

ALASKA AIR GROUP INC	920	64.80	59,616.00
AMERICAN AIRLINES GROUP	2,580	56.07	144,660.60
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	707	91.74	64,860.18
CSX CORP	5,065	58.00	293,770.00
DELTA AIR LINES INC	3,392	56.09	190,257.28
EXPEDITORS INTL WASH INC	824	64.74	53,345.76
FEDEX CORP	1,329	247.12	328,422.48
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	428	121.80	52,130.40
KANSAS CITY SOUTHERN	505	111.65	56,383.25
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,544	145.53	224,698.32
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,825	59.70	168,652.50
UNION PACIFIC CORP	4,346	137.28	596,618.88
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	1,480	71.55	105,894.00
UNITED PARCEL SERVICE -CL B	3,858	110.38	425,846.04
APTIV PLC	1,454	92.27	134,160.58
BORGWARNER INC	1,340	51.56	69,090.40
FORD MOTOR COMPANY	20,014	10.73	214,750.22
GENERAL MOTORS CO	7,221	37.84	273,242.64
GOODYEAR TIRE & RUBBER	1,448	28.75	41,630.00
HARLEY-DAVIDSON	1,024	44.35	45,414.40
DR HORTON INC	2,274	43.80	99,601.20
GARMIN LTD	758	60.99	46,230.42
HANESBRANDS INC	2,270	20.01	45,422.70
HASBRO INC	773	91.46	70,698.58
LEGGETT & PLATT INC	828	46.41	38,427.48
LENNAR CORP-CL A	1,022	59.79	61,105.38
MATTEL	2,524	14.84	37,443.54
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	865	61.40	53,111.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	313	245.00	76,685.00
NEWELL BRANDS INC	2,529	27.32	69,092.28
NIKE B	7,435	66.30	492,940.50
PULTE GROUP INC	1,824	30.04	54,792.96
PVH CORP	381	143.07	54,509.67
RALPH LAUREN CORP	373	105.84	39,478.32
TAPESTRY INC	1,843	52.49	96,739.07
UNDER ARMOUR INC CLASS A	1,990	17.05	33,929.50
UNDER ARMOUR INC CLASS C	629	15.18	9,548.22
VF CORP	1,856	73.59	136,583.04
WHIRLPOOL CORP	351	164.06	57,585.06
BLOCK (H&R)	1,022	27.69	28,299.18
CARNIVAL CORP	2,414	67.47	162,872.58
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	132	322.16	42,525.12
DARDEN RESTAURANTS	735	94.81	69,685.35
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	1,150	81.47	93,690.50
MARRIOTT INT'L A	1,797	143.29	257,492.13
MCDONALD'S CORP	4,392	157.24	690,598.08
MGM RESORTS INTERNATIONAL	2,824	36.79	103,894.96
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	1,100	57.15	62,865.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	895	126.62	113,324.90

STARBUCKS CORP	7,702	58.46	450,258.92
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	497	121.09	60,181.73
WYNN RESORTS LTD	413	188.89	78,011.57
YUM! BRANDS INC	1,985	82.95	164,655.75
CBS CORP-CL B	1,899	52.18	99,089.82
CHARTER COMMUNICATION-A	1,058	347.59	367,750.22
COMCAST CORP-CL A	25,681	37.13	953,535.53
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	1,737	24.19	42,018.03
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	767	22.49	17,249.83
DISH NETWORK CORP-A	1,550	40.76	63,178.00
DISNEY (WALT) CO NEW	8,275	104.73	866,640.75
INTERPUBLIC GROUP OF COS	2,624	23.93	62,792.32
NEWS CORP - CLASS A	1,437	16.47	23,667.39
NEWS CORP - CLASS B	1,000	16.80	16,800.00
OMNICOM GROUP	1,270	73.73	93,637.10
TIME WARNER INC	4,367	95.26	416,000.42
TWENTY FIRST CENTURY FOX	2,330	37.21	86,699.30
TWENTY FIRST CENTURY FOX INC	6,099	37.73	230,115.27
VIACOM INC-CLASS B	1,834	32.72	60,008.48
ADOVANCE AUTO PARTS	528	118.86	62,758.08
AMAZON COM INC	2,223	1,578.89	3,509,872.47
AUTOZONE INC	156	659.40	102,866.40
BEST BUY COMPANY INC	1,371	73.82	101,207.22
BOOKING HOLDINGS INC	269	2,170.61	583,894.09
CARMAX INC	1,019	62.43	63,616.17
DOLLAR GENERAL CORP	1,252	86.94	108,848.88
DOLLAR TREE INC	1,341	92.70	124,310.70
EXPEDIA INC	678	112.22	76,085.16
FOOT LOCKER, INC.	900	42.56	38,304.00
GAP	1,457	33.07	48,182.99
GENUINE PARTS CO	792	92.62	73,355.04
HOME DEPOT	6,382	182.16	1,162,545.12
KOHL'S CORP	1,054	62.97	66,370.38
L BRANDS INC	1,410	42.26	59,586.60
LKQ CORP	1,880	39.64	74,523.20
LOWE'S COMPANIES	4,682	87.28	408,644.96
MACY'S INC	1,525	28.88	44,042.00
NETFLIX INC	2,390	331.44	792,141.60
NORDSTROM INC	936	49.99	46,790.64
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	494	250.51	123,751.94
ROSS STORES INC	2,268	77.01	174,658.68
SIGNET JEWELERS LTD	279	48.90	13,643.10
TARGET CORP	3,220	70.49	226,977.80
TIFFANY & CO	403	101.76	41,009.28
TJX COMPANIES INC	3,208	82.67	265,205.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	593	65.34	38,746.62
TRIPADVISOR INC	561	43.03	24,139.83
ULTA BEAUTY INC	320	205.92	65,894.40
COSTCO WHOLESALE CORP	2,471	188.58	465,981.18

CVS HEALTH CORPORATION	5,778	69.27	400,242.06
KROGER CO	5,081	24.08	122,350.48
SYSCO CORP	2,875	61.28	176,180.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	4,666	70.60	329,419.60
WALMART INC	8,100	88.72	718,632.00
ALTRIA GROUP INC	10,441	65.65	685,451.65
ARCHER-DANIELS-MIDLAND	2,834	43.30	122,712.20
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,340	55.05	73,767.00
CAMPBELL SOUP CO (US)	1,016	43.61	44,307.76
COCA-COLA CO	21,072	44.82	944,447.04
CONAGRA BRANDS INC	2,674	38.06	101,772.44
CONSTELLATION BRANDS INC-A	901	230.34	207,536.34
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	974	117.95	114,883.30
GENERAL MILLS	3,392	51.45	174,518.40
HORMEL FOODS CORP	1,700	33.76	57,392.00
JM SMUCKER CO	754	129.92	97,959.68
KELLOGG CO	1,348	70.25	94,697.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	703	110.54	77,709.62
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,204	81.09	97,632.36
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	8,046	44.27	356,196.42
MONSTER BEVERAGE CORP	2,466	58.06	143,175.96
PEPSICO INC	7,827	112.54	880,850.58
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	8,562	108.30	927,264.60
THE HERSHEY COMPANY	924	100.36	92,732.64
THE KRAFT HEINZ CO/THE	3,095	67.23	208,076.85
TYSON FOODS INC-CL A	1,883	75.69	142,524.27
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,252	50.59	63,338.68
CLOROX CO	720	131.57	94,730.40
COLGATE-PALMOLIVE CO	4,692	71.24	334,258.08
COTY INC	3,052	19.40	59,208.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,336	145.05	193,786.80
KIMBERLY-CLARK CORP	2,108	111.94	235,969.52
PROCTER & GAMBLE CO	14,050	80.29	1,128,074.50
ABBOTT LABORATORIES	9,565	63.60	608,334.00
AETNA INC	1,826	177.38	323,895.88
ALIGN TECHNOLOGY	440	271.74	119,565.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,037	99.00	102,663.00
ANTHEM INC	1,429	232.80	332,671.20
BAXTER INTERNATIONAL	2,775	68.89	191,169.75
BECTON DICKINSON	1,434	226.12	324,256.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	7,367	28.54	210,254.18
CARDINAL HEALTH INC	1,661	71.16	118,196.76
CENTENE CORP	1,090	102.66	111,899.40
CERNER CORP	1,926	64.91	125,016.66
CIGNA CORP	1,291	173.36	223,807.76
DANAHER CORP	3,380	103.74	350,641.20
DAVITA INC	828	72.46	59,996.88
DENTSPLY SIRONA INC	1,265	57.67	72,952.55
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,144	139.32	159,382.08

ENVISION HEALTHCARE CORP	900	42.89	38,601.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	2,993	80.75	241,684.75
HCA HEALTHCARE INC	1,648	103.90	171,227.20
HENRY SCHEIN INC	1,128	68.43	77,189.04
HOLOGIC INC	1,460	39.57	57,772.20
HUMANA	729	272.50	198,652.50
IDEXX LABORATORIES	490	203.17	99,553.30
INTUITIVE SURGICAL INC COM NEW	631	440.46	277,930.26
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	553	175.75	97,189.75
MCKESSON CORP	1,272	155.79	198,164.88
MEDTRONIC PLC	7,439	83.15	618,552.85
PATTERSON COS INC	379	25.29	9,584.91
QUEST DIAGNOSTICS INC	895	106.99	95,756.05
RESMED INC	768	99.68	76,554.24
STRYKER CORP	1,742	166.41	289,886.22
THE COOPER COS INC	310	251.43	77,943.30
UNITED HEALTH GROUP INC	5,328	225.43	1,201,091.04
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	520	126.66	65,863.20
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	509	126.55	64,413.95
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,074	120.86	129,803.64
ABBVIE INC	8,827	119.29	1,052,972.83
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,911	71.13	135,929.43
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,371	125.68	172,307.28
ALLERGAN PLC	1,878	157.28	295,371.84
AMGEN INC	3,928	191.10	750,640.80
BIOGEN INC	1,190	286.10	340,459.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,931	67.92	606,593.52
CELGENE CORP	4,512	92.56	417,608.16
GILEAD SCIENCES INC	7,453	80.72	601,606.16
ILLUMINA INC	772	250.12	193,092.64
INCYTE CORP	943	94.23	88,858.89
IQIVA HOLDINGS INC	900	105.60	95,040.00
JOHNSON & JOHNSON	14,824	133.80	1,983,451.20
LILLY (ELI) & CO	5,441	79.61	433,158.01
MERCK & CO	14,999	55.14	827,044.86
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	126	616.00	77,616.00
MYLAN NV	3,087	42.51	131,228.37
PERKINELMER INC	657	79.22	52,047.54
PERRIGO CO PLC	784	84.95	66,600.80
PFIZER	32,615	36.77	1,199,253.55
REGENERON PHARMACEUTICALS	468	341.70	159,915.60
THERMO ELECTRON CORP	2,270	217.89	494,610.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,310	176.26	230,900.60
WATERS CORPORATION	385	212.70	81,889.50
ZOETIS INC	2,767	84.52	233,866.84
BANK OF AMERICA CORP	53,859	32.72	1,762,266.48
BB&T CORPORATION	4,265	56.03	238,967.95
CITIGROUP INC	14,653	76.11	1,115,239.83
CITIZENS FINANCIAL GROUP	2,495	46.26	115,418.70

COMERICA	862	102.21	88,105.02
FIFTH THIRD BANCORP	3,592	34.21	122,882.32
HUNTINGTON BANCSHARES INC	5,165	16.50	85,222.50
JPMORGAN CHASE & CO	19,324	118.04	2,281,004.96
KEYCORP	5,188	22.15	114,914.20
M & T BANK CORP	866	196.81	170,437.46
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL IN	1,683	20.15	33,912.45
PNC BANK CORP	2,639	162.45	428,705.55
REGIONS FINANCIAL CORP	5,802	20.11	116,678.22
SUNTRUST BANKS	2,785	72.85	202,887.25
US BANCORP	8,794	55.28	486,132.32
WELLS FARGO COMPANY	24,577	58.23	1,431,118.71
ZIONS BANCORPORATION	984	57.04	56,127.36
AFFILIATED MANAGERS GROUP	400	196.11	78,444.00
AMERICAN EXPRESS	3,907	99.05	386,988.35
AMERIPRISE FINANCIAL INC	879	161.11	141,615.69
BANK NEW YORK MELLO CORP	5,587	57.23	319,744.01
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10,715	212.94	2,281,652.10
BLACKROCK INC	679	577.18	391,905.22
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	2,892	100.79	291,484.68
CBOE GLOBAL MARKETS INC	547	124.54	68,123.38
CME GROUP INC	1,872	171.42	320,898.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,128	78.42	166,877.76
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,735	57.24	99,311.40
FRANKLIN RESOURCES INC	1,848	40.46	74,770.08
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,982	270.77	536,666.14
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	3,170	75.73	240,064.10
INVESCO LTD	1,585	34.52	54,714.20
LEUCADIA NATIONAL CORP	1,710	24.50	41,895.00
MOODY'S CORPORATION	906	170.05	154,065.30
MORGAN STANLEY	8,024	58.67	470,768.08
NASDAQ INC	814	86.53	70,435.42
NAVIENT CORP	867	13.86	12,016.62
NORTHERN TRUST CORP	1,065	110.70	117,895.50
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	800	98.75	79,000.00
S&P GLOBAL INC	1,392	194.96	271,384.32
SCHWAB (CHARLES) CORP	6,660	57.70	384,282.00
STATE STREET CORP	1,964	109.83	215,706.12
SYNCHRONY FINANCIAL	4,058	37.28	151,282.24
T ROWE PRICE GROUP INC	1,433	117.60	168,520.80
AFLAC	2,152	91.68	197,295.36
ALLSTATE CORP	1,914	96.03	183,801.42
AMERICAN INT'L GROUP	4,866	56.57	275,269.62
AON PLC	1,362	148.03	201,616.86
ARTHUR J GALLAGHER & CO	901	72.63	65,439.63
ASSURANT INC	445	90.81	40,410.45
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	743	53.86	40,017.98
CHUBB LTD	2,574	144.00	370,656.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	776	77.04	59,783.04



EVEREST RE GROUP LTD	300	262.62	78,786.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS	1,760	56.13	98,788.80
LINCOLN NATIONAL CORP	1,071	78.71	84,298.41
LOEWS CORP	1,592	51.72	82,338.24
MARSH & MCLENNAN COS	2,773	85.87	238,117.51
METLIFE INC	5,828	47.84	278,811.52
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,548	63.05	97,601.40
PROGRESSIVE CORP	3,293	60.37	198,798.41
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,285	110.30	252,035.50
TORCHMARK CORP	772	87.34	67,426.48
TRAVELERS COS INC/THE ST.PAUL TRAVELERS	1,650	142.30	234,795.00
UNUM GROUP	1,207	51.19	61,786.33
WILLIS TOWERS WATSON PLC	797	164.14	130,819.58
XL GROUP LIMITED	1,371	55.67	76,323.57
CBRE GROUP INC	1,945	47.59	92,562.55
ACCENTURE PLC-CL A	3,409	161.51	550,587.59
ACTIVISION BLIZZARD INC	4,067	78.22	318,120.74
ADOBE SYSTEMS	2,821	221.11	623,751.31
AKAMA I TECHNOLOGIES	1,101	76.07	83,753.07
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	267	239.19	63,863.73
ALPHABET INC-CL A	1,622	1,160.84	1,882,882.48
ALPHABET INC-CL C	1,711	1,160.04	1,984,828.44
ANSYS INC	450	171.18	77,031.00
AUTODESK INC	1,335	139.36	186,045.60
AUTOMATIC DATA PROCESS	2,514	118.83	298,738.62
CA INC	1,833	37.12	68,040.96
CADENCE DESIGN SYS INC	1,148	39.68	45,552.64
CITRIX SYSTEMS INC	617	95.51	58,929.67
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,182	84.71	269,547.22
CSRA INC	862	40.57	34,971.34
DXC TECHNOLOGY CO	1,753	106.72	187,080.16
EBAY INC	5,267	43.81	230,747.27
ELECTRONIC ARTS	1,640	128.49	210,723.60
FACEBOOK INC-A	13,232	185.23	2,450,963.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	1,989	100.77	200,431.53
FISERV INC	1,221	148.23	180,988.83
GARTNER INC	600	122.81	73,686.00
GLOBAL PAYMENTS INC	851	117.22	99,754.22
IBM CORP	4,737	159.31	754,651.47
INTUIT CORP	1,412	177.17	250,164.04
MASTERCARD INC-CLASS A	5,146	183.24	942,953.04
MICROSOFT CORP	42,867	96.54	4,138,380.18
ORACLE CORP	16,841	52.97	892,067.77
PAYCHEX INC	1,830	66.52	121,731.60
PAYPAL HOLDINGS INC	6,214	80.71	501,531.94
RED HAT INC	1,027	155.48	159,677.96
SALESFORCE COM INC COM	3,671	127.41	467,722.11
SYMANTEC CORP	3,999	27.85	111,372.15

SYNOPSYS INC	1,000	89.73	89,730.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	982	90.74	89,106.68
VERISIGN INC	356	120.46	42,883.76
VISA INC-CLASS A SHARES	10,035	124.51	1,249,457.85
WESTERN UNION CO	3,055	20.17	61,619.35
AMPHENOL CORP-CL A	1,469	92.44	135,794.36
APPLE INC	28,495	179.98	5,128,530.10
CISCO SYSTEMS	27,113	45.37	1,230,116.81
CORNING	4,770	29.93	142,766.10
FLIR SYSTEMS INC	513	51.54	26,440.02
FS NETWORKS INC	398	147.48	58,697.04
HEWLETT-PACKARD CO	9,939	24.65	244,996.35
HP ENTERPRISE CO	9,589	19.16	183,725.24
IPG PHOTONICS CORP	200	249.28	49,856.00
JUNIPER NETWORKS INC	1,748	26.43	46,199.64
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,030	109.09	112,362.70
NETAPP INC	1,552	65.26	101,283.52
SEAGATE TECHNOLOGY	1,603	60.19	96,484.57
TE CONNECTIVITY LTD	2,060	105.75	217,845.00
WESTERN DIGITAL CORP	1,620	99.55	161,271.00
XEROX CORP	1,517	29.92	45,388.64
AT & T INC	33,955	37.05	1,258,032.75
CENTURYLINK INC	5,309	17.94	95,243.46
VERIZON COMMUNICATIONS	22,547	49.01	1,105,028.47
AES CORPORATION	3,383	10.85	36,705.55
ALLIANT ENERGY CORP	930	38.71	36,000.30
AMEREN CORPORATION	1,100	53.99	59,389.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	2,935	65.65	192,682.75
AMERICAN WATER WORKS CO INC	925	81.36	75,258.00
CENTERPOINT ENERGY INC	2,241	27.13	60,798.33
CMS ENERGY CORP	2,013	42.86	86,277.18
CONSOLIDATED EDISON	2,037	75.24	153,263.88
DOMINION ENERGY INC	3,517	72.87	256,283.79
DTE ENERGY	1,029	100.53	103,445.37
DUKE ENERGY CORP	3,776	76.13	287,466.88
EDISON INTERNATIONAL	1,874	59.38	111,278.12
ENTERGY CORP	863	76.78	66,261.14
EVERSOURCE ENERGY	1,765	57.24	101,028.60
EXELON CORP	5,836	37.50	218,850.00
FIRSTENERGY CORP	2,117	32.65	69,120.05
NEXTERA ENERGY INC	2,611	154.81	404,208.91
NISOURCE INC	1,513	22.96	34,738.48
NRG ENERGY INC COM NEW	1,836	29.75	54,621.00
PG&E CORP	3,135	42.03	131,764.05
PINNACLE WEST CAPITAL	759	76.38	57,972.42
PPL CORPORATION	3,333	27.54	91,790.82
PUBLIC SV ENTERPRISE CO	2,596	47.05	122,141.80
SCANA CORP	932	39.13	36,469.16
SEMPRA ENERGY	1,413	109.08	154,130.04

SOUTHERN CO	5,402	43.76	236,391.52	
WEC ENERGY GROUP INC	1,771	60.55	107,234.05	
XCEL ENERGY INC	2,344	43.28	101,448.32	
ADVANCED MICRO DEVICES	4,040	11.70	47,268.00	
ANALOG DEVICES	2,208	94.73	209,163.84	
APPLIED MATERIALS	5,729	61.61	352,963.69	
BROADCOM LIMITED	2,327	253.78	590,546.06	
INTEL CORP	25,917	52.19	1,352,608.23	
KLA-TENCOR CORPORATION	1,020	121.15	123,573.00	
LAM RESEARCH CORP	897	224.95	201,780.15	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,148	98.97	113,617.56	
MICRON TECHNOLOGY	6,268	54.59	342,170.12	
NVIDIA CORP	3,337	245.33	818,666.21	
QORVO INC	900	85.51	76,959.00	
QUALCOMM	8,115	63.03	511,488.45	
SKYWORKS SOLUTIONS INC.	919	113.56	104,361.64	
TEXAS INSTRUMENTS	5,553	111.53	619,326.09	
XILINX INC	1,430	76.20	108,966.00	
アメリカ・ドル 小計	1,576,753		128,855,768.31 (13,781,124,421)	
合計	1,576,753		13,781,124,421 (13,781,124,421)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

#### 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE	600	75,588.00	
		AMERICAN TOWER CORP	2,267	325,495.86	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	1,429	57,145.71	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	790	127,521.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,000	123,620.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	2,421	268,706.79	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,170	120,673.80	
		DUKE REALTY CORP	1,760	45,337.60	
		EQUINIX INC	458	180,983.28	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2,097	124,792.47	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	422	100,233.44	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	623	54,942.37	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	486	56,531.52	
		GGP INC	3,260	68,883.80	
		HCP INC	2,239	50,601.40	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	3,663	69,267.33	
		IRON MOUNTAIN INC	884	29,393.00	
		KIMCO REALTY CORP	2,612	37,821.76	
		MACERICH CO/THE	700	40,614.00	
		MID AMERICA APARTMENT COMM	499	44,590.64	
PROLOGIS INC	3,132	199,477.08			
PUBLIC STORAGE	882	176,364.72			

	REALTY INCOME CORP	2,000	101,740.00	
	REGENCY CENTERS CORP	830	49,053.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	548	91,236.52	
	SIMON PPTY (SIMON DEBART	1,568	245,501.76	
	SL GREEN REALTY CORP	177	17,630.97	
	UDR INC	1,970	69,422.80	
	VENTAS INC COM	2,360	117,268.40	
	VORNADO REALTY TRUST	799	54,499.79	
	WELLTOWER INC	2,125	113,815.00	
	WEYERHAEUSER CO	4,329	150,908.94	
	アメリカ・ドル 小計	50,100	3,389,663.55 (362,524,516)	
投資証券	小計		362,524,516 (362,524,516)	
合計			362,524,516 (362,524,516)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

3. 投資証券における券面総額は、証券数です。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の合計額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 473銘柄	97.4%		100.0%
	投資証券 32銘柄		2.6%	

(注) 組入株式時価比率及び組入投資証券時価比率は時価の合計額に対する通貨毎の比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当する事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

(平成30年3月30日現在)

資産総額	730,972,849円
負債総額	178,275円
純資産総額( - )	730,794,574円
発行済口数	731,951,246口
1口当たり純資産額( / )	0.9984円

## &lt;参考情報&gt;

## 親投資信託受益証券（米国株式インデックス・マザーファンド）

(平成30年3月30日現在)

資産総額	13,175,845,743円
負債総額	23,355,954円
純資産総額( - )	13,152,489,789円
発行済口数	6,220,984,074口
1口当たり純資産額( / )	2.1142円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です。

発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

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

###### 2) 運用実施計画の作成

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

###### 3) 運用の実行

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年3月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、136本であり、その純資産総額は1,457,767百万円です（親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。）。

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。  
また、委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規制」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 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、第20期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表ならびに第21期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 1. 財務諸表

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29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	6,002,331		1,072,151	
有価証券	6,448		24,597	
前払金	94,019		120,702	
前払費用	19,057		23,871	
未収入金	527,437		189,169	
未収還付法人税等	-		602,213	
未収委託者報酬	544,116		585,796	
未収収益	28,476		148,631	
繰延税金資産	969,336		544,801	
流動資産計	8,191,223	74.4	3,311,935	53.1
固定資産				
有形固定資産	130,133		115,733	
建物附属設備	1 103,983		92,276	
器具備品	1 22,098		20,717	
リース資産	1 4,051		1,736	
その他の有形固定資産	-		1,003	
無形固定資産	201		0	
ソフトウェア	2 201		0	
投資その他の資産	2,686,381		2,803,881	
長期差入保証金	75,114		71,695	
繰延税金資産	2,606,416		2,727,336	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	2,816,715	25.6	2,919,615	46.9
資産合計	11,007,938	100.0	6,231,550	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成28年3月31日現在)		当事業年度 (平成29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	59,514		101,842	
未払金	586,597		557,620	
未払手数料	112,932		124,844	
その他未払金	473,664		432,776	
未払費用	1,560		1,842	
未払法人税等	3,917,946		916	
未払消費税等	39,613		-	
賞与引当金	58,531		70,852	
リース債務	1,861		2,834	
流動負債計	4,665,626	42.4	735,907	11.8
固定負債				
退職給付引当金	73,140		92,798	
長期リース債務	2,834		-	



固定負債計		75,974	0.7		92,798	1.5
負債合計		4,741,600	43.1		828,706	13.3
(純資産の部)			%			%
株主資本		6,266,337	56.9		5,402,844	86.7
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	5,847,217			4,983,724		
純資産合計		6,266,337	56.9		5,402,844	86.7
負債・純資産合計		11,007,938	100.0		6,231,550	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日		当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,509,890		2,212,712	
投資顧問収入	1,578,998		1,458,677	
その他営業収益	155,119		50,406	
営業収益計	4,244,008	100.0	3,721,797	100.0
営業費用				
支払手数料	559,139		489,863	
広告宣伝費	16,680		35,172	
公告費	1,190		1,190	
調査費	410,480		417,879	
調査費	265,829		293,362	
委託調査費	142,735		122,452	
図書費	1,915		2,063	
委託計算費	151,283		142,995	
営業雑経費	42,905		38,828	
通信費	4,838		4,373	
印刷費	11,461		8,695	
協会費	10,719		10,238	
諸会費	4,744		3,751	
その他	11,140		11,770	
営業費用計	1,181,679	27.8	1,125,930	30.3
一般管理費				
給料	1,209,889		1,355,113	
役員報酬	289,386		320,210	
給料・手当	689,687		742,957	
賞与	187,055		240,448	
賞与引当金繰入額	43,760		51,497	
交際費	2,655		2,819	
旅費交通費	27,724		25,539	
租税公課	99,542		3,445	
不動産賃借料	85,870		98,463	
退職給付費用	80,570		89,895	

固定資産減価償却費		25,224			19,230	
福利厚生費		84,742			103,558	
事務手数料		522,979			684,643	
諸経費		148,610			40,555	
一般管理費計		2,287,811	53.9		2,423,266	65.1
営業利益		774,517	18.2		172,600	4.6
営業外収益						
受取利息		0			-	
有価証券運用益		-			6,845	
雑収入		278			1,326	
営業外収益計		278	0.0		8,172	0.2
営業外費用						
支払利息		174			118	
為替差損		2,081			1,479	
有価証券運用損		1,242			-	
雑損失		360			161	
営業外費用計		3,858	0.1		1,759	0.0
経常利益		770,936	18.2		179,013	4.8
特別利益						
事業再構築費用戻入		-			101,509	
特別利益計		-	-		101,509	2.7
特別損失						
事業再構築費用		101,509			-	
事務処理損失		173			32,965	
特別損失計		101,682	2.4		32,965	0.9
税引前当期純利益		669,254	15.8		247,557	6.7
法人税、住民税及び事業税		4,035,569	95.1		188,427	5.1
法人税等調整額		3,462,138	81.6		303,615	8.2
当期純利益		95,824	2.3		132,369	3.6

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			利益剰余金 合計		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337
当期変動額									
剰余金の配当	-	-	-	-	-	995,862	995,862	995,862	995,862
当期純利益	-	-	-	-	-	132,369	132,369	132,369	132,369
当期変動額合計	-	-	-	-	-	863,492	863,492	863,492	863,492
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	4,983,724	5,092,844	5,402,844	5,402,844

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。				
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>9～10年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>7年</td> </tr> </table> リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。	建物附属設備	9～10年	器具備品	7年
建物附属設備	9～10年				
器具備品	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	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括損益処理しております。</p>
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

(追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）を当事業年度から適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 16,731千円</p> <p>器具備品 17,133千円</p> <p>リース資産 2,893千円</p>	<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 29,387千円</p> <p>器具備品 21,193千円</p> <p>リース資産 5,208千円</p>
<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 11,323千円</p>	<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 11,524千円</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日

<p>移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額141,249千円は、損益計算書のその他営業収益に、また、当社がステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払った調整額519,485千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。</p>	<p>移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額48,303千円は、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684,643千円は、損益計算書の事務手数料に含まれております。</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
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株あたりの配当額	基準日	効力発生日
平成28年3月24日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	483,870.96円	平成27年9月30日	平成28年3月25日

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

当事業年度(自平成28年4月1日 至平成29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株あたりの配当額	基準日	効力発生日
平成28年12月22日 取締役会	普通株式	995,862千円	160,622.90円	平成28年9月30日	平成28年12月26日

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

## (リース取引関係)

前事業年度 自平成27年4月1日 至平成28年3月31日	当事業年度 自平成28年4月1日 至平成29年3月31日
所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
<p>リース資産の内容 社用車両であります。</p> <p>リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。</p>	

## (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、また顧客の業種等多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成28年3月31日現在

(単位：千円)

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

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

## (2) 未収委託者報酬、(3) 未収入金及び(5) 未払手数料

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

## (4) 長期差入保証金

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

## (注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

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

記載すべき事項はありません。

平成29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	1,072,151	1,072,151	
(2) 未収委託者報酬	585,796	585,796	
(3) 未収入金	189,169	189,169	
(4) 未収還付法人税等	602,213	602,213	
(5) 長期差入保証金	71,695	45,753	25,942
(6) 未払手数料	124,844	124,844	

## (注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## (1) 預金

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

## (2) 未収委託者報酬、(3) 未収入金、(4) 未収還付法人税等及び(6) 未払手数料

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

(5) 長期差入保証金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (平成28年3月31日現在)	当事業年度 (平成29年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 6,448千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,448千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 24,597千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 3,169千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
該当事項はありません。	同左

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

2. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
退職給付債務の期首残高	457,872
勤務費用	47,433
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	20,312
退職給付の支払額	15,877
退職給付債務の期末残高	469,114

## 3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
年金資産の期首残高	328,027
期待運用収益	2,421
数理計算上の差異の発生額	5,670
事業主からの拠出額	47,170
退職給付の支払額	15,877
年金資産の期末残高	367,412

## 4. 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

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



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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
積立型制度の退職給付債務	469,114
年金資産	367,412
	101,701
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	101,701
未認識数理計算上の差異	25,983
未認識過去勤務費用	34,886
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	92,798

## 5．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
退職給付費用	66,829
(1)勤務費用	47,433
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益（減算）	2,421
(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	13,096

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（平成28年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 97.7%

その他	2.3%
合計	100.0%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

当事業年度（平成29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 (平成28年3月31日現在)
(1) 割引率	0.0%
(2) 長期期待運用収益率	0.75%
(3) 退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4) 過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5) 数理計算上の差異の処理年数	1年

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

	当事業年度 (平成29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 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,211千円であります。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は17,895千円であります。

## (税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成27年4月 1日	自 平成28年4月 1日
至 平成28年3月31日	至 平成29年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：千円)
繰延税金資産（流動）		繰延税金資産（流動）	
連結納税適用に伴う影響額	647,569	連結納税適用に伴う影響額	617,391
未払事業税	236,325	賞与引当金繰入超過額	19,076
賞与引当金繰入超過額	15,182	その他	28,260
その他	70,259		
繰延税金資産（流動）合計	969,336	繰延税金資産（流動）合計	664,727
繰延税金負債（流動）との相殺	-	繰延税金負債（流動）との相殺	119,926
繰延税金資産（流動）の純額	969,336	繰延税金資産（流動）の純額	544,801
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
連結納税適用に伴う影響額	2,575,170	連結納税適用に伴う影響額	1,837,769
退職給付引当金	23,491	退職給付引当金	29,482
繰越欠損金	-	繰越欠損金	848,912
その他	7,754	その他	11,173
繰延税金資産（固定）合計	2,606,416	繰延税金資産（固定）合計	2,727,336
繰延税金負債（固定）との相殺	-	繰延税金負債（固定）との相殺	-
繰延税金資産（固定）の純額	2,606,416	繰延税金資産（固定）の純額	2,727,336
繰延税金資産合計	3,575,752	繰延税金資産合計	3,272,137
繰延税金負債（流動）		繰延税金負債（流動）	
その他	-	未払事業税	119,926
繰延税金負債（流動）合計	-	繰延税金負債（流動）合計	119,926
繰延税金資産（流動）との相殺	-	繰延税金資産（流動）との相殺	119,926
繰延税金負債（流動）の純額	-	繰延税金負債（流動）の純額	-
繰延税金負債（固定）			
事業譲受に係る調整項目	-		
繰延税金負債（固定）合計	-		
繰延税金資産（固定）との相殺	-		
繰延税金負債（固定）の純額	-		
繰延税金資産の純額	3,575,752 =====	繰延税金資産の純額	3,272,137 =====

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	33.0%	法定実効税率	30.8%
交際費等永久に損金に算入されない項目	8.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	25.4%
税率変更差異	40.5%		
その他	3.8%	その他	9.7%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	85.6%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.5%
	=====		=====

（税率変更に伴う影響）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
該当事項はありません。	同左

（資産除去債務関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日											
種 類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の所 有（被所有） 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の 関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払	167,037	未収入金	228,410
								投資顧問料の支払	118,594	未払金	205,912
								人件費等の支払	235,888		
								事務手数料の受取	141,249		
							事務手数料の支払	522,979			
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ  兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託	38,211	前払金	94,019
								人件費等の支払	133,176		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・リミテッド・カンパニー	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取	399	-	-
								投資顧問料の支払	10,659		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	290	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
---------------------------------------

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の所 有(被所有) 割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				
同一の親 会社を持 つ会社	ステート・スト リート・バン ク・アンド・ トラスト・カ パニー	米国 マサチューセツ ク州ボスト ン市	29百万 米ドル	銀行、 投資顧 問、投 資信託 業務、 及びそ れらの 関連業 務	なし	なし	助言などの投 資顧問サー ビスの提供並 びに受入れ  ソフトウェア の使用契約  人件費等及び 事務手数料の 支払	ソフトウェア使 用料の支払	184,870	未払金	298,783
								投資顧問料の支 払	93,591	前払金	74,932
								人件費等の支払	316,476		
								事務手数料の受 取	48,303		
							事務手数料の支 払	684,643			
	ステート・スト リート信託銀 行株式会 社	東京都港 区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理 の事務サー ビスの受入れ  兼職社員の 人件費支払等	投資信託計理業 務委託	32,352	前払金	45,770
							人件費等の支払	142,287			
	ステート・スト リート・グロ ーバル・アド バイザーズ・ リミテッド・ キングダム ム	英国 ロンドン	62百万ポ ンド	投資顧 問、投 資信託 業務	なし	なし	投資顧問サー ビスの受入れ	投資顧問料の支 払	10,201	-	-
	ステート・スト リート・グロ ーバル・アド バイザーズ・ シンガ ポール	シンガポ ール シンガポ ール 市	136万シ ンガポ ール	投資顧 問業	なし	なし	投資顧問サー ビスの提供及 びETF商品の 紹介	紹介料の受取	269	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

#### 親会社又は重要な関連会社に関する注記

##### (1) 親会社情報

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

##### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

##### (1株当たり情報)

前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
1株当たり純資産 1,010,699円58銭 1株当たり当期純利益 15,455円49銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	1株当たり純資産 871,426円53銭 1株当たり当期純利益 21,349円86銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日	当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
当期純利益 (千円)	95,824	132,369
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)	95,824	132,369
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

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

当事業年度 自 平成28年4月 1日 至 平成29年3月31日
該当事項はありません。

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

科 目	期 別	第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	
		金 額	構成比
(資産の部)			%
流動資産			
預金		1,720,311	
有価証券		47,809	
前払金		147,567	
前払費用		10,729	
未収入金		332,957	
未収委託者報酬		630,199	
未収収益		292,958	
繰延税金資産		656,419	
流動資産計		3,838,951	59.5
固定資産			
有形固定資産		117,240	
建物附属設備	1	85,912	
器具備品	1	30,749	



リース資産	1	578		
無形固定資産			0	
ソフトウェア		0		
投資その他の資産			2,493,174	
長期差入保証金		69,706		
繰延税金資産		2,418,618		
その他投資		4,850		
固定資産計			2,610,415	40.5
資産合計			6,449,366	100.0
(負債の部)				%
流動負債				
預り金			30,205	
未払金			295,094	
未払手数料		130,056		
その他未払金		165,038		
未払費用			1,941	
未払法人税等			5,920	
未払消費税等	2		35,028	
賞与引当金			213,969	
リース債務			1,881	
流動負債計			584,042	9.1
固定負債				
退職給付引当金			78,958	
固定負債計			78,958	1.2
負債合計			663,001	10.3
(純資産の部)				%
株主資本			5,786,364	89.7
資本金		310,000		
利益剰余金		5,476,364		
利益準備金		77,500		
その他利益剰余金				
別途積立金		31,620		
繰越利益剰余金		5,367,244		
純資産合計			5,786,364	89.7
負債・純資産合計			6,449,366	100.0

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

科 目	期 別	第21期中間会計期間	
		自 平成29年4月 1日 至 平成29年9月30日	
		金額	構成比
営業収益			%
委託者報酬		1,162,920	
投資顧問収入		834,160	
その他営業収益	1	28,712	
営業収益計		2,025,793	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		577,318	
支払手数料		259,236	
その他営業費用		318,081	
一般管理費	2	877,797	
営業費用・一般管理費計		1,455,115	71.8

営業利益		570,677	28.2
営業外収益		10,571	0.5
営業外費用		364	0.0
経常利益		580,884	28.7
特別損失		0	0.0
税引前中間純利益		580,884	28.7
法人税,住民税及び事業税		265	0.0
法人税等調整額		197,099	9.7
中間純利益		383,520	18.9

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産 合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本 合計			
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益 剰余金					利益剰余金 合計
					別途積立金	繰越利益 剰余金				
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	4,983,724	5,092,844	5,402,844	5,402,844	
当中間期変動額										
中間純利益	-	-	-	-	-	383,520	383,520	383,520	383,520	
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	383,520	383,520	383,520	383,520	
当中間期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,367,244	5,476,364	5,786,364	5,786,364	

## [重要な会計方針]

	第21期中間会計期間 自 平成29年4月 1日 至 平成29年9月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 中間決算日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備                    9～10年 器具備品                          3～7年 リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格をゼロとして算定する方法 によっております。  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア(自社利用)については、社内における見込利用 可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当中間会計期間に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理しております。</p>
5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)							
1. 有形固定資産の減価償却累計額	<table border="0"> <tr> <td>建物附属設備</td> <td>35,751千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>24,842千円</td> </tr> <tr> <td>リース資産</td> <td>6,365千円</td> </tr> </table>	建物附属設備	35,751千円	器具備品	24,842千円	リース資産	6,365千円
建物附属設備	35,751千円						
器具備品	24,842千円						
リース資産	6,365千円						
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。						

(中間損益計算書関係)

第21期中間会計期間 自 平成29年4月 1日 至 平成29年9月30日	
1. 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。当中間会計期間に、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28,585千円は、損益計算書のその他営業収益に含まれております。	

2. 減価償却実施額	
有形固定資産	10,013千円
リース資産	1,157千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第21期中間会計期間				
自 平成29年4月 1日				
至 平成29年9月30日				
発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
普通株式	6,200			6,200

## (リース取引)

第21期中間会計期間	
自 平成29年4月 1日	
至 平成29年9月30日	
所有権移転外ファイナンス・リース取引	
リース資産の内容	
社用車両であります。	
リース資産の減価償却の方法	
重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。	

## (金融商品関係)

第21期中間会計期間	
自 平成29年4月 1日	
至 平成29年9月30日	

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

平成29年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	1,720,311	1,720,311	
(2)未収入金	332,957	332,957	
(3)未収委託者報酬	630,199	630,199	
(4)長期差入保証金	69,706	45,553	24,152
(5)未払手数料	130,056	130,056	

## (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) 未収委託者報酬及び、(5) 未払手数料

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

## (4) 長期差入保証金

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

## (有価証券関係)

第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	
売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	47,809千円
当中間会計期間の損益に含まれた評価差額	3,231千円

## (資産除去債務関係)

第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	
資産除去債務の総額の期中における増減はありません。	

## (デリバティブ取引関係)

第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	
当社はデリバティブ取引を行っていないため、該当事項はありません。	

## (セグメント情報等)

第21期中間会計期間末 (平成29年9月30日現在)	

## （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。

## （セグメント関連情報）

## 1. 商品およびサービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦に所在している顧客への収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しています。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、集計対象より除いております。

## (2) 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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しています。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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。

## （1株当たり情報）

第21期中間会計期間

自 平成29年4月 1日

至 平成29年9月30日

1株当たり純資産額 933,284円64銭

1株当たり中間純利益 61,858円10銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間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株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

第21期中間会計期間	
自 平成29年4月 1日	
至 平成29年9月30日	
中間純利益(千円)	383,520
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益(千円)	383,520
期中平均株式数(株)	6,200

(重要な後発事象)

第21期中間会計期間

自 平成29年4月 1日

至 平成29年9月30日

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

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

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<訂正前>

(1) <略>

(2) 販売会社

(1) 名 称	(2) 資本金の額	(3) 事業の内容
三井住友信託銀行株式会社	<略>	<略>
マネックス証券株式会社	<略>	<略>
楽天証券株式会社	<略>	<略>
株式会社SBI証券	<略>	<略>
松井証券株式会社	<略>	<略>

2018年4月27日より受益権の募集取扱等を開始します。

<訂正後>

(1) <略>

(2) 販売会社

(1) 名 称	(2) 資本金の額	(3) 事業の内容
---------	-----------	-----------



三井住友信託銀行株式会社	< 略 >	< 略 >
マネックス証券株式会社	< 略 >	< 略 >
楽天証券株式会社	< 略 >	< 略 >
株式会社 S B I 証券	< 略 >	< 略 >
松井証券株式会社	< 略 >	< 略 >