

【表紙】	
【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2022年11月18日
【計算期間】	第11期中 自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
【ファンド名】	A M C /ステート・ストリート・リスクバジェット型 バランス・オープン（ステイブル）
【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】	菅野 真人
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【電話番号】	03-4530-7171
【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】

（2022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	4,129,357,782	84.69
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		746,475,562	15.31
純資産総額		4,875,833,344	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

＜参考情報＞

親投資信託受益証券（日本株式インデックス・マザーファンド）

（2022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	51,063,962,050	97.03
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,560,640,042	2.97
純資産総額		52,624,602,092	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

＜参考情報＞

親投資信託受益証券（日本債券インデックス・マザーファンド）

（2022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	144,168,627,500	81.96
特殊債券	日本	12,777,565,304	7.26
地方債証券	日本	10,388,376,038	5.91
社債券	日本	7,924,355,700	4.51
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		641,826,834	0.36
純資産総額		175,900,751,376	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

＜参考情報＞

親投資信託受益証券（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

（2022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	135,916,786,080	69.57
	イギリス	8,124,776,304	4.16
	カナダ	6,984,032,785	3.57
	フランス	5,829,384,911	2.98
	スイス	5,637,664,537	2.89
	オーストラリア	4,093,387,523	2.09
	ドイツ	3,946,154,051	2.02
	オランダ	2,146,370,979	1.10
	スウェーデン	1,754,528,816	0.90
	香港	1,525,733,979	0.78
	デンマーク	1,399,747,642	0.72
	スペイン	1,240,187,110	0.63
	イタリア	1,178,321,894	0.60
	シンガポール	740,358,733	0.38

	フィンランド	532,244,628	0.27
	ベルギー	503,008,804	0.26
	イスラエル	438,873,835	0.22
	ノルウェー	414,745,321	0.21
	アイルランド	303,039,433	0.16
	ポルトガル	122,661,036	0.06
	ニュージーランド	98,078,065	0.05
	オーストリア	89,168,082	0.05
	小計	183,019,254,548	93.67
投資証券	アメリカ	3,818,474,132	1.95
	オーストラリア	221,252,168	0.11
	シンガポール	82,778,205	0.04
	イギリス	73,154,548	0.04
	香港	62,243,745	0.03
	フランス	60,920,796	0.03
	カナダ	21,632,291	0.01
	ベルギー	14,906,722	0.01
	小計	4,355,362,607	2.22
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		8,023,514,557	4.11
純資産総額		195,398,131,712	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）

（2022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	52,915,771,264	52.38
	フランス	8,485,534,395	8.40
	イタリア	7,390,145,789	7.31
	ドイツ	6,302,679,794	6.23
	スペイン	4,972,190,694	4.92
	イギリス	4,188,259,064	4.14
	中国	2,922,649,422	2.89
	カナダ	2,112,662,525	2.09
	ベルギー	1,868,660,366	1.84
	オランダ	1,557,500,171	1.54
	オーストラリア	1,519,591,103	1.50
	オーストリア	1,193,903,040	1.18
	メキシコ	816,152,446	0.80
	アイルランド	625,095,278	0.61
	フィンランド	519,949,481	0.51
	マレーシア	512,179,311	0.50
	シンガポール	437,698,720	0.43
	ポーランド	407,374,023	0.40
	イスラエル	377,469,351	0.37
	デンマーク	361,320,674	0.35
	スウェーデン	252,399,181	0.24
	ノルウェー	197,840,041	0.19
	小計	99,937,026,133	98.93

コール・ローン、その他資産（負債控除後）	1,072,205,768	1.06
純資産総額	101,009,231,643	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】

2022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
第10期	（ 2022年 2月21日 ）	分配付：	4,854,785,226	分配付：	1.2675
		分配落：	4,835,634,300	分配落：	1.2625
2021年 9月末日			4,622,509,261		1.2879
10月末日			4,980,963,340		1.3028
11月末日			4,951,688,785		1.2936
12月末日			4,976,058,100		1.3005
2022年 1月末日			4,896,273,395		1.2787
2月末日			4,842,820,849		1.2598
3月末日			4,948,528,481		1.2861
4月末日			4,931,544,689		1.2813
5月末日			4,914,277,836		1.2764
6月末日			4,935,897,923		1.2831
7月末日			4,975,011,309		1.2936
8月末日			4,945,262,474		1.2861
9月末日			4,875,833,344		1.2692

【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	0.0000円

第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	0.0050円
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	0.0160円
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	0.0070円
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	0.0140円
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	0.0150円
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.0110円
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	0.0150円
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	0.0100円
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.0050円

【収益率の推移】

計算期間		収益率
第1期	自2012年 3月 9日 至2013年 2月20日	6.7%
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	8.6%
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	7.7%
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	2.2%
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	3.7%
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	2.2%
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	0.7%
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	3.8%
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	1.2%
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	0.1%
	自2022年 2月22日 至2022年 8月21日	2.7%

（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 至2013年 2月20日	199,976,258	109,100	199,867,158
第2期	自2013年 2月21日 至2014年 2月20日	1,202,700,140	1,264,903	1,401,302,395
第3期	自2014年 2月21日 至2015年 2月20日	12,384,800	5,554,258	1,408,132,937
第4期	自2015年 2月21日 至2016年 2月22日	932,006,609	7,079,090	2,333,060,456
第5期	自2016年 2月23日 至2017年 2月20日	468,679,521	90,490,774	2,711,249,203
第6期	自2017年 2月21日 至2018年 2月20日	757,459,918	92,726,355	3,375,982,766
第7期	自2018年 2月21日 至2019年 2月20日	128,819,369	85,618,294	3,419,183,841
第8期	自2019年 2月21日 至2020年 2月20日	271,844,830	65,588,688	3,625,439,983
第9期	自2020年 2月21日 至2021年 2月22日	129,832,227	54,195,439	3,701,076,771
第10期	自2021年 2月23日 至2022年 2月21日	321,813,640	192,705,055	3,830,185,356
	自2022年 2月22日 至2022年 8月21日	34,973,682	19,448,287	3,845,710,751

（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（2022年2月22日から2022年8月21日まで）の中間財務諸表について、P w C 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

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

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	前計算期間末 (2022年2月21日現在)	当中間計算期間末 (2022年8月21日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,124,559	3,713,473
コール・ローン	748,260,273	757,948,707
親投資信託受益証券	4,123,840,284	4,243,638,385
流動資産合計	4,875,225,116	5,005,300,565
資産合計	4,875,225,116	5,005,300,565
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	19,150,926	-
未払解約金	21,780	9,326
未払受託者報酬	1,343,159	1,340,955
未払委託者報酬	18,804,127	18,773,173
未払利息	2,020	6,136
その他未払費用	268,804	268,270
流動負債合計	39,590,816	20,397,860
負債合計	39,590,816	20,397,860
純資産の部		
元本等		
元本	1 3,830,185,356	1 3,845,710,751
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,005,448,944	1,139,191,954
（分配準備積立金）	256,422,903	255,139,800
元本等合計	4,835,634,300	4,984,902,705
純資産合計	4,835,634,300	4,984,902,705
負債純資産合計	4,875,225,116	5,005,300,565

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2021年2月23日 至 2021年8月22日	当中間計算期間 自 2022年2月22日 至 2022年8月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	87,987,313	150,398,101
営業収益合計	87,987,313	150,398,101
営業費用		
支払利息	350,549	359,854
受託者報酬	1,295,638	1,340,955
委託者報酬	18,138,930	18,773,173
その他費用	261,457	273,927
営業費用合計	20,046,574	20,747,909
営業利益又は営業損失（ ）	67,940,739	129,650,192
経常利益又は経常損失（ ）	67,940,739	129,650,192
中間純利益又は中間純損失（ ）	67,940,739	129,650,192
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,051,770	207,103
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	996,036,476	1,005,448,944
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,111,529	9,395,735
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,111,529	9,395,735
剰余金減少額又は欠損金増加額	44,568,317	5,095,814
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	44,568,317	5,095,814
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,033,468,657	1,139,191,954

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

（中間貸借対照表に関する注記）

区 分	前計算期間末 (2022年2月21日現在)	当中間計算期間末 (2022年8月21日現在)
1 期首元本額	3,701,076,771円	3,830,185,356円
期中追加設定元本額	321,813,640円	34,973,682円
期中一部解約元本額	192,705,055円	19,448,287円
2 受益権の総数	3,830,185,356口	3,845,710,751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 (2022年2月21日現在)	当中間計算期間末 (2022年8月21日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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 (2022年2月21日現在)	当中間計算期間末 (2022年8月21日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2625円 (12,625円)	1.2962円 (12,962円)

< 参考 >

当ファンドは「日本株式インデックス・マザーファンド」、「日本債券インデックス・マザーファンド」、「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」及び「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（1）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	(2022年2月21日現在)	(2022年8月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		8,316,271	8,288,435
コール・ローン		1,991,556,633	1,705,827,302
株式		83,096,381,980	55,505,338,580
派生商品評価勘定		3,419,580	58,113,100
未収配当金		132,421,098	79,237,900
前払金		43,753,000	—
差入委託証拠金		131,998,000	79,650,000
流動資産合計		85,364,093,562	57,436,455,317
資産合計		85,364,093,562	57,436,455,317
負債の部			
流動負債			
前受金		—	58,172,500
派生商品評価勘定		56,572,520	—
未払金		714,640	—
未払解約金		80,762,000	57,352,000
未払利息		5,377	4,603

その他未払費用		799	271
流動負債合計		138,055,336	115,529,374
負債合計		138,055,336	115,529,374
純資産の部			
元本等			
元本	1	25,294,590,585	16,068,939,954
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		59,931,447,641	41,251,985,989
元本等合計		85,226,038,226	57,320,925,943
純資産合計		85,226,038,226	57,320,925,943
負債純資産合計		85,364,093,562	57,436,455,317

（注）親投資信託の計算期間は、原則として、毎年3月6日から、翌年3月5日までであります。

（2）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 期首元本額	30,837,565,787円	25,294,590,585円
期中追加設定元本額	2,872,328,195円	941,177,745円
期中一部解約元本額	8,415,303,397円	10,166,828,376円
元本の内訳		
ファンド名		
A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	68,904,278円	71,256,342円
日本株式インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	859,722,220円	711,187,148円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,114,502円	3,024,306円

バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	41,611,804円	29,249,139円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	101,750円	100,359円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,929,213円	2,907,543円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	9,020,758円	6,489,113円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	4,714,525,381円	4,482,887,110円
日本株式インデックス・ファンドVA1＜適格機関投資家限定＞	325,274,735円	275,479,760円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	2,688,492円	2,674,597円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	675,167,737円	621,642,760円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	516,333,400円	489,725,013円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	33,446,008円	32,752,737円
日本株式インデックス・ファンドM＜適格機関投資家限定＞	74,771,376円	73,194,324円
日本株式インデックス・ファンドS＜適格機関投資家限定＞	8,228,214,822円	76,840,219円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	129,494,025円	110,492,736円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,698,014,258円	1,582,726,331円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	255,626,431円	225,546,727円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	1,176,319,740円	1,070,031,605円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	36,795,063円	34,099,343円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	13,711,613円	11,882,418円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	15,816,264円	15,146,245円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	7,558,463円	6,759,845円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	415,348,450円	385,645,534円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	1,503,156円	1,418,011円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	2,349,417円	2,284,241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＞	77,848,054円	49,060,510円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	230,562,712円	222,120,969円

世界分散ファンドV A 2 5 A < 適格機関投資家限定 >	1,078,407,897円	997,638,063円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	72,763,467円	72,608,486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 >	67,019,425円	211,203,516円
T a d リスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル） < 適格機関投資家限定 >	48,862,230円	48,625,862円
ステート・ストリート日本株式インデックス・オープン	3,993,393,519円	3,780,157,877円
世界バランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	4,150,810円	3,321,479円
世界バランス 6 0 V A < 適格機関投資家限定 >	25,623,020円	9,898,366円
グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	212,618円	206,514円
グローバルバランス 4 0 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	370,701,614円	332,001,594円
グローバルバランス 4 0 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	13,814,006円	12,751,050円
グローバルバランス 5 0 V A < 適格機関投資家限定 >	4,867,857円	3,902,162円
計	25,294,590,585円	16,068,939,954円
2 受益権の総数	25,294,590,585口	16,068,939,954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	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 「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。	(3)デリバティブ取引 同左
	金融商品の時価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。 「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。	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	（2022年2月21日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	2,137,161,000	—	2,084,080,000	53,081,000
合 計		2,137,161,000	—	2,084,080,000	53,081,000

（単位：円）

区 分	種 類	（2022年8月21日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	1,737,777,500	—	1,795,950,000	58,172,500
合 計		1,737,777,500	—	1,795,950,000	58,172,500

（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）

	（ 2022年2月21日現在 ）	（ 2022年8月21日現在 ）
1口当たり純資産額 （ 1万口当たり純資産額 ）	3.3693円 （ 33,693円 ）	3.5672円 （ 35,672円 ）

「日本債券インデックス・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

（１）貸借対照表

（単位：円）

区 分	注記 番号	（ 2022年2月21日現在 ）	（ 2022年8月21日現在 ）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		2,062,791	1,946,411
コール・ローン		432,597,182	313,743,203
国債証券		147,653,807,100	146,088,102,700
地方債証券		11,144,083,947	10,526,065,528
特殊債券		13,784,162,928	13,096,018,657
社債券		7,426,485,500	7,921,261,400
未収利息		405,851,717	396,190,196
前払費用		6,750,206	5,245,953
流動資産合計		180,855,801,371	178,348,574,048
資産合計		180,855,801,371	178,348,574,048
負債の部			
流動負債			
未払金		100,000,000	—
未払解約金		80,291,183	16,306,643
未払利息		1,168	846
その他未払費用		740	475
流動負債合計		180,293,091	16,307,964
負債合計		180,293,091	16,307,964
純資産の部			
元本等			
元本	1	142,408,879,533	141,191,837,376
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		38,266,628,747	37,140,428,708
元本等合計		180,675,508,280	178,332,266,084
純資産合計		180,675,508,280	178,332,266,084
負債純資産合計		180,855,801,371	178,348,574,048

（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	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 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。
-------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 期首元本額	125,544,496,076円	142,408,879,533円
期中追加設定元本額	28,194,208,595円	6,682,703,194円
期中一部解約元本額	11,329,825,138円	7,899,745,351円
元本の内訳		
ファンド名		
A M C / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	1,146,597,358円	1,183,666,872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＞	4,145,561,580円	3,882,826,019円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	7,433,390円	20,936,565円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	263,966,341円	189,975,642円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	490,392円	498,527円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	11,910,967円	11,940,358円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	32,015,457円	24,302,551円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	12,634,152,650円	12,269,909,368円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	7,178,062円	7,202,048円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	4,869,450,738円	4,642,539,566円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	2,068,538,926円	2,003,312,907円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	12,884,484円	12,917,978円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	1,387,394,179円	1,219,085,074円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,818,271,354円	6,502,935,112円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,595,439,627円	1,435,378,979円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	5,531,075,725円	5,220,857,287円

バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	147,547,330円	142,205,402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＞	86,760,881円	87,422,299円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	74,286,355円	63,606,742円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	42,156,723円	41,089,071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＞	18,130,385,917円	20,071,962,014円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	60,836,011円	55,736,008円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	3,667,881,617円	3,545,838,816円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	17,564,426円	16,986,094円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	12,541,551円	12,613,610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＞	461,330,787円	296,290,127円
日本債券インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	856,700,066円	937,732,554円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	2,518,868,674円	2,447,025,885円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	9,583,442,330円	9,131,120,360円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	14,884,709円	14,662,249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＞	319,947,884円	323,773,535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＞	384,138,329円	721,885,161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＞	213,778,261円	216,771,584円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	4,736,282,762円	3,087,438,825円
日本債券インデックス・ファンドF＜適格機関投資家限定＞	56,331,731,561円	57,543,306,871円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	27,942,699円	22,987,992円
世界バランス60VA＜適格機関投資家限定＞	102,209,601円	42,178,701円
グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,409,812円	1,381,954円
グローバルバランス40VA2＜適格機関投資家限定＞	3,955,098,488円	3,622,522,923円
グローバルバランス40VA3＜適格機関投資家限定＞	90,264,950円	85,345,910円

グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	38,526,579円	31,667,836円
計	142,408,879,533円	141,191,837,376円
2 受益権の総数	142,408,879,533口	141,191,837,376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	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	同左
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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）

	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2687円 （12,687円）	1.2630円 （12,630円）

「外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2022年2月21日現在)	(2022年8月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		4,969,966,480	3,944,398,919
金銭信託		8,261,676	12,463,334
コール・ローン		1,978,482,245	2,565,055,460
株式		185,167,372,213	202,200,190,734
投資証券		4,298,547,977	5,130,126,738
派生商品評価勘定		12,622,312	671,859,252
未収入金		41,041,575	987,058
未収配当金		191,050,228	295,834,567
差入委託証拠金		1,728,779,788	554,407,207
流動資産合計		198,396,124,494	215,375,323,269
資産合計		198,396,124,494	215,375,323,269
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		496,985,663	2,251,978
未払解約金		159,043,000	253,385,000
未払利息		5,342	6,922
その他未払費用		1,022	498
流動負債合計		656,035,027	255,644,398
負債合計		656,035,027	255,644,398
純資産の部			
元本等			
元本	1	47,184,065,744	45,067,220,909
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		150,556,023,723	170,052,457,962
元本等合計		197,740,089,467	215,119,678,871
純資産合計		197,740,089,467	215,119,678,871
負債純資産合計		198,396,124,494	215,375,323,269

(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	株式、投資証券 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。
-------------------	---

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 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。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として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。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。
4 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21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	49,551,945,295円 5,521,606,426円 7,889,485,977円	47,184,065,744円 2,944,192,714円 5,061,037,549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	5,315,474,460円	5,210,310,989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	6,330,330,821円	6,325,443,824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	76,275,626円	75,599,042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）	60,143,809円	56,867,496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）	2,519,322,111円	66,826,017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）	26,407,556円	27,032,919円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	442,691円	1,169,982円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	33,036,075円	22,309,536円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	49,318円	46,483円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	2,344,219円	2,267,573円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,738,262円	3,299,337円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	3,736,418,535円	3,410,120,490円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	917,334円	871,202円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	353,728,849円	316,230,354円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	356,336,772円	325,788,039円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	30,378,834円	28,768,287円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	100,653,224円	83,569,763円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,330,879,336円	1,210,054,517円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	199,866,073円	170,539,992円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	695,802,297円	610,976,261円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	29,233,539円	25,887,941円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	21,780,444円	18,300,363円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	24,915,442円	23,516,626円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	12,031,668円	10,309,032円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	138,919,975円	126,599,874円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	392,345円	367,652円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	745,981円	702,807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＞	339,221,706円	201,439,115円

4 資産インデックスバランス V A 2 0 < 適格機関投資家限定 >	120,992,558円	113,462,092円
4 資産インデックスバランス V A 5 0 < 適格機関投資家限定 >	20,325,527円	18,638,864円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）年金 < 適格機関投資家限定 >	18,650,429円	18,663,041円
T a d リスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）< 適 格機関投資家限定 >	12,601,924円	12,480,181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	319,209,613円	399,341,057円
ステート・ストリート先進国株式イ ンデックス・オープン（為替ヘッジ あり）	2,880,952,979円	2,692,721,280円
全世界株式インデックス・ファンド	1,331,079,869円	1,669,604,965円
世界バランス 4 0 V A < 適格機関投 資家限定 >	9,938,569円	7,540,309円
世界バランス 6 0 V A < 適格機関投 資家限定 >	101,883,747円	37,493,554円
グローバルバランス 4 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	502,546円	476,444円
グローバルバランス 4 0 V A 2 < 適 格機関投資家限定 >	869,697,340円	749,321,524円
グローバルバランス 4 0 V A 3 < 適 格機関投資家限定 >	32,663,503円	29,443,624円
グローバルバランス 5 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	15,348,108円	12,087,110円
ワールドエクイティ・ファンド V L < 適格機関投資家限定 >	19,709,431,730円	20,950,731,351円
計	47,184,065,744円	45,067,220,909円
2 受益権の総数	47,184,065,744口	45,067,220,909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	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 貸借対照表計上 額、時価及びこれ らの差額	貸借対照表計上額は時価を計上し ているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の 算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以 外の金融商品については、短期間で 決済されることから、時価は帳簿価 額と近似しているため、当該金融商 品の帳簿価額を時価としておりま す。	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (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。 金融商品の時価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。 「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。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左 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	（2022年2月21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	6,458,191,465	—	6,022,145,457	436,046,008
	S&P 60	365,306,541	—	366,846,440	1,539,899
	SPI 200	269,229,821	—	265,965,480	3,264,341
	FTSE100INDEX	341,950,183	—	350,475,214	8,525,031
	FSMI INDEX	326,381,294	—	312,378,760	14,002,534
	EURO STOXX 50	991,411,651	—	959,733,133	31,678,518
合 計		8,752,470,955	—	8,277,544,484	474,926,471

（単位：円）

区 分	種 類	（2022年8月21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	5,332,958,342	—	5,872,142,762	539,184,420
	S&P 60	271,047,697	—	283,556,473	12,508,776
	SPI 200	217,700,710	—	231,129,990	13,429,280
	FTSE100INDEX	317,755,699	—	330,418,176	12,662,477
	FSMI INDEX	201,526,540	—	206,385,348	4,858,808
	EURO STOXX 50	757,639,057	—	803,535,810	45,896,753
	合 計	7,098,628,045	—	7,727,168,559	628,540,514

(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	(2022年2月21日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,545,014,055	—	1,539,170,976	5,843,079
	カナダ・ドル	95,586,435	—	94,799,460	786,975
	オーストラリア・ドル	55,485,313	—	55,414,092	71,221
	イギリス・ポンド	65,630,371	—	65,734,326	103,955
	ユーロ	234,835,417	—	232,095,980	2,739,437
	売建				
	アメリカ・ドル	74,781,855	—	74,772,880	8,975
	カナダ・ドル	5,436,960	—	5,417,112	19,848
	オーストラリア・ドル	42,048,405	—	42,180,876	132,471
	イギリス・ポンド	7,815,880	—	7,825,515	9,635
	ユーロ	9,140,530	—	9,127,370	13,160
	合 計	2,135,775,221	—	2,126,538,587	9,436,880

(単位：円)

区 分	種 類	(2022年8月21日現在)			
		契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		

市場取引以 外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	1,973,644,746	—	2,011,883,700	38,238,954
	カナダ・ドル	110,123,569	—	111,241,700	1,118,131
	オーストラリア・ドル	77,048,983	—	77,954,679	905,696
	イギリス・ポンド	150,945,100	—	150,770,484	174,616
	ユーロ	317,118,359	—	320,060,450	2,942,091
	売建				
	アメリカ・ドル	202,899,820	—	204,415,900	1,516,080
	カナダ・ドル	9,396,720	—	9,464,742	68,022
	オーストラリア・ドル	18,557,052	—	18,784,260	227,208
	イギリス・ポンド	30,879,250	—	30,802,572	76,678
	スイス・フラン	5,690,800	—	5,692,752	1,952
	シンガポール・ドル	6,836,620	—	6,879,558	42,938
	ユーロ	89,103,276	—	89,287,250	183,974
	合 計	2,992,244,295	—	3,037,238,047	41,066,760

(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。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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)

	(2022年2月21日現在)	(2022年8月21日現在)
1口当たり純資産額	4.1908円	4.7733円
(1万口当たり純資産額)	(41,908円)	(47,733円)

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(2022年2月21日現在)	(2022年8月21日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		404,762,831	457,632,394
金銭信託		434,636	494,191

コール・ローン		104,085,365	101,708,599
国債証券		112,815,109,040	99,918,576,308
派生商品評価勘定		150,640	276,600
未収利息		745,402,426	604,590,922
前払費用		18,948,737	23,777,053
流動資産合計		114,088,893,675	101,107,056,067
資産合計		114,088,893,675	101,107,056,067
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		581,280	12,540
未払金		605,654,872	117,268,665
未払解約金		224,535,783	9,871,572
未払利息		281	274
その他未払費用		87	40
流動負債合計		830,772,303	127,153,091
負債合計		830,772,303	127,153,091
純資産の部			
元本等			
元本	1	44,829,220,968	38,091,999,605
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		68,428,900,404	62,887,903,371
元本等合計		113,258,121,372	100,979,902,976
純資産合計		113,258,121,372	100,979,902,976
負債純資産合計		114,088,893,675	101,107,056,067

（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	国債証券 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。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として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。

3 その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 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。
------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 期首元本額	56,125,021,105円	44,829,220,968円
期中追加設定元本額	7,492,685,110円	2,728,076,566円
期中一部解約元本額	18,788,485,247円	9,465,297,929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	6,525,734,988円	6,555,728,104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	27,752,805円	25,962,121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）	864,844,189円	838,596,660円
外国債券インデックス・ファンド / 為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	2,727,903,184円	1,970,143,799円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	945,432,342円	819,033,209円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,477,413円	3,899,918円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	131,144,952円	89,989,917円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	81,946円	78,230円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	5,901,645円	5,800,679円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	4,039,197円	2,913,139円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	6,334,376,233円	5,784,126,712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＞	78,290,488円	77,240,933円

バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,522,649円	1,481,289円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	2,140,003,570円	1,920,192,647円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,128,658,937円	1,037,190,225円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	25,724,700円	24,353,924円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	696,774,062円	577,347,148円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	3,408,874,554円	3,073,408,325円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	796,702,791円	676,454,789円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	2,375,871,421円	2,107,004,030円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	74,144,512円	66,753,894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＞	159,210,423円	—円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	93,357,417円	75,359,603円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	56,178,677円	51,556,067円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	40,736,429円	35,065,155円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	560,225,202円	511,584,229円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	2,022,530円	1,838,924円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	1,874,506円	1,830,619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＞	916,323,583円	561,891,400円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	838,619,218円	771,838,569円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,464,119,127円	1,305,143,632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＞	600,045,110円	409,537,488円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	29,466,570円	27,797,572円
Ta dリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド（ステイブル）年金＜適格機関投資家限定＞	193,067,286円	183,423,886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＞	565,394,934円	341,741,187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＞	278,379,509円	482,539,916円

T a dリスクバジェット型マルチ配 分戦略ファンド（ステイブル）＜適 格機関投資家限定＞	127,780,936円	122,812,793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	103,024,464円	192,221,521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）	5,435,093,427円	4,708,730,505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＞	3,896,322,199円	1,682,031,916円
世界バランス４０ＶＡ＜適格機関投 資家限定＞	19,489,997円	15,246,272円
世界バランス６０ＶＡ＜適格機関投 資家限定＞	85,830,664円	33,691,965円
グローバルバランス４０ＶＡ＜適格 機関投資家限定＞	984,013円	913,539円
グローバルバランス４０ＶＡ２＜適 格機関投資家限定＞	990,434,150円	851,278,605円
グローバルバランス４０ＶＡ３＜適 格機関投資家限定＞	63,125,976円	56,350,932円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格 機関投資家限定＞	12,858,043円	9,873,618円
計	44,829,220,968円	38,091,999,605円
2 受益権の総数	44,829,220,968口	38,091,999,605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	（2022年2月21日現在）	（2022年8月21日現在）
1 貸借対照表計上 額、時価及びこれ らの差額	貸借対照表計上額は時価を計上し ているため、その差額はありませ ん。	同左
2 金融商品の時価の 算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以 外の金融商品については、短期間で 決済されることから、時価は帳簿価 額と近似しているため、当該金融商 品の帳簿価額を時価としておりま す。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る 事項に関する注記）」に記載してお ります。	(1)有価証券及びデリバティブ取引 以外の金融商品 同左 (2)有価証券 売買目的有価証券 同左

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 「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。	(3)デリバティブ取引 同左
	金融商品の時価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。 「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。	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	（2022年2月21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	333,795,800	—	333,662,110	133,690
	イギリス・ポンド	46,983,000	—	46,965,510	17,490
	ユーロ	287,108,800	—	286,803,440	305,360
	売建				
	アメリカ・ドル	103,428,000	—	103,552,740	124,740
	ユーロ	104,440,000	—	104,289,360	150,640
	合 計	875,755,600	—	875,273,160	430,640

（単位：円）

区 分	種 類	（2022年8月21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	26,979,400	—	27,256,000	276,600
	ユーロ	27,491,800	—	27,479,260	12,540
	合 計	54,471,200	—	54,735,260	264,060

（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。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額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）

	（ 2022年2月21日現在 ）	（ 2022年8月21日現在 ）
1口当たり純資産額	2.5264円	2.6509円
（ 1万口当たり純資産額 ）	（ 25,264円 ）	（ 26,509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。

2022年9月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、124本であり、その純資産総額は2,908,007百万円です(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（2021年4月1日から2022年3月31日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

１．財務諸表

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2021年3月31日現在)			当事業年度 (2022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		3,455,294			4,391,110	
有価証券		22,281			23,294	
前払金		59,450			119,649	
前払費用		20,090			29,290	
未収入金		795,709			688,466	
未収還付法人税等		592			-	
未収委託者報酬		651,298			685,229	
未収収益		41,992			42,751	
流動資産計		5,046,710	70.1		5,979,793	75.8
固定資産						
有形固定資産		4,695			375	
建物附属設備	1	-			0	
器具備品	1	4,695			375	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		2,149,769			1,904,306	
長期差入保証金		55,283			71,694	
繰延税金資産		2,088,211			1,826,336	
その他投資		6,275			6,275	
固定資産計		2,154,465	29.9		1,904,682	24.2
資産合計		7,201,176	100.0		7,884,475	100.0

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2021年3月31日現在)			当事業年度 (2022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		141,855			172,682	
未払金		300,612			344,370	
未払手数料	163,883			177,539		
その他未払金	136,728			166,831		
未払費用		11,026			11,699	
未払法人税等		-			296,332	
未払消費税等		79,008			30,068	
賞与引当金		76,891			74,876	
流動負債計		609,394	8.5		930,030	11.8
固定負債						
退職給付引当金		81,500			84,840	
固定負債計		81,500	1.1		84,840	1.1
負債合計		690,894	9.6		1,014,871	12.9
(純資産の部)			%			%

株主資本		6,510,281	90.4		6,869,604	87.1
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	6,091,161			6,450,484		
純資産合計		6,510,281	90.4		6,869,604	87.1
負債・純資産合計		7,201,176	100.0		7,884,475	100.0

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日			当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		
	金 額	構成比		金 額	構成比	
営業収益		%			%	
委託者報酬		2,468,063		2,655,508		
投資顧問収入		2,871,928		3,030,659		
その他営業収益		78,227		85,660		
営業収益計		5,418,219	100.0	5,771,828	100.0	
営業費用						
支払手数料		631,100		711,649		
広告宣伝費		28,458		53,735		
公告費		1,140		1,140		
調査費		527,766		712,486		
調査費	268,033			407,466		
委託調査費	259,021			304,641		
図書費	711			378		
委託計算費		242,239		485,872		
営業雑経費		38,381		29,696		
通信費	4,038			3,997		
印刷費	11,238			7,276		
協会費	18,183			12,853		
諸会費	5			55		
その他	4,915			5,512		
営業費用計		1,469,086	27.1	1,994,579	34.6	
一般管理費						
給料		1,307,873		1,568,661		
役員報酬	235,947			425,268		
給料・手当	800,039			787,766		
賞与	210,310			285,950		
賞与引当金繰入額	61,576			69,676		
交際費		728		1,607		
旅費交通費		801		676		
租税公課		6,244		32,240		
不動産賃借料		91,686		60,478		
退職給付費用		71,604		74,675		
固定資産減価償却費		20,149		2,571		
福利厚生費		126,174		130,238		

諸経費		202,081			186,753	
一般管理費計		1,827,345	33.7		2,057,903	35.7
営業利益		2,121,787	39.2		1,719,345	29.8
営業外収益						
為替差益		123			18	
有価証券運用益		1,026			1,013	
雑収入		36			881	
営業外収益計		1,186	0.0		1,913	0.0
営業外費用						
移転価格調整金		1,306,329			363,220	
為替差損		656			214	
有価証券運用損		-			1	
雑損失		193			329	
営業外費用計		1,307,179	24.1		363,766	6.3
経常利益		815,794	15.1		1,357,491	23.5
特別利益						
事業再構築費用戻入		102			7,084	
特別利益計		102	0.0		7,084	0.1
特別損失						
事務処理損失		8,806			146	
固定資産除却損		45,130			2,326	
特別損失計		53,937	1.0		2,472	0.0
税引前当期純利益		761,960	14.1		1,362,102	23.6
法人税、住民税及び事業税		530	0.0		261,905	4.5
法人税等調整額		281,513	5.2		261,874	4.5
当期純利益		479,916	8.9		838,322	14.5

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益剰余金				株主資本 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金		利益剰余金 合計		
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,091,161	6,200,281	6,510,281	6,510,281
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(479,000)	(479,000)	(479,000)	(479,000)
当期純利益	-	-	-	838,322	838,322	838,322	838,322
当期変動額合計	-	-	-	359,322	359,322	359,322	359,322
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604

〔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	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。 器具備品 3～7年
3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4. 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生 of 翌事業年度に一括損益処理しております。
5. 収益の計上方法	(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託約款に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資信託約款毎に、日々の純資産総額に信託報酬率を乗じた金額で収益を認識しております。 (2) 投資顧問収入 投資顧問収入は、投資顧問契約に定められた履行義務の充足状況に基づき、投資顧問毎に計算基礎額に投資顧問料率を乗じた金額で収益を認識しております。
6. その他 財務諸表作成のための重要な事項	消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

（収益認識に関する会計基準等の適用）

「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 令和2年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。この変更による当財務諸表への影響はありません。

（時価の算定に関する会計基準等の適用）

「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）等を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。この変更による当財務諸表への影響はありません。

表示方法の変更

従来、損益計算書の「一般管理費」の「事務手数料」に含めていたステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーに支払う「移転価格調整金」は、グループ内の精算の目的等をより適切に反映させるため、当事業年度より「営業外費用」の「移転価格調整金」として表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の損益計算書において「一般管理費」の「事務手数料」として表示していた1,306,329千円を「営業外費用」の「移転価格調整金」として組替えて表示しています。

この変更により、従来の方と比べて、当事業年度の営業利益は363,220千円、前事業年度の営業利益は1,306,329千円、それぞれ増加しています。経常利益以下に影響はありません。

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 1,826,336千円

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。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (2021年3月31日現在)	当事業年度 (2022年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 52,734千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,399千円
関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左

（損益計算書関係）

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額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、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。	移転価格調整金の取り扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することとしております。当事業年度にステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニーから当社に支払われた調整額85,395千円は、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363,220千円は、損益計算書の営業外費用である移転価格調整金に含まれております。

関係会社に係る注記 該当事項はありません。	関係会社に係る注記 同左
--------------------------	-----------------

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

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

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

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

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

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

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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
2021年6月24日 定時株主総会	普通株式	479,000千円	77,258.06円	2021年3月31日	2021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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	利益剰余金	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28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。

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。

2022年3月31日現在

預金、未収入金、未収委託者報酬、未収収益、未払手数料及びその他未払金は、短期間で決済されるため、時価が帳簿価額に近似することから、注記を省略しております。

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

2022年3月31日現在、前項にて注記を省略しているため、記載を省略しております。

（有価証券関係）

前事業年度 (2021年3月31日現在)	当事業年度 (2022年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 22,281千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,026千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 23,294千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 1,011千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
---------------------------------------	---------------------------------------

2011年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。 また、2000年9月29日より退職給付信託を設定しております。	同左
--	----

2．退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
退職給付債務の期首残高	450,505
勤務費用	58,354
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	10,018
退職給付の支払額	18,668
退職給付債務の期末残高	480,173

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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
年金資産の期首残高	368,935
期待運用収益	2,728

数理計算上の差異の発生額	2,919
事業主からの拠出額	52,354
退職給付の支払額	18,668
年金資産の期末残高	402,431

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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
積立型制度の退職給付債務	450,505
年金資産	368,935
	<u>81,570</u>
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
	<u>81,500</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	81,500

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
積立型制度の退職給付債務	480,173
年金資産	402,431
	<u>77,742</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	77,742
未認識数理計算上の差異	7,098
	<u>84,840</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

5. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	52,417
(1)勤務費用	<u>55,966</u>
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	55,694
(1)勤務費用	58,354
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,728
(4)過去勤務費用の費用処理額	0
(5)数理計算上の差異の費用処理額	69
(6)その他	-

6．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2022年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定） 98.1%

その他 1.9%

合計 100.0%

長期期待運用収益率の設定方法

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

7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (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

	当事業年度 (2022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 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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,980千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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） 繰延税金資産 賞与引当金繰入超過額 21,034 退職給付引当金 26,660 (注) 繰越欠損金 1,987,863 その他 52,654 繰延税金資産 合計 2,088,211 繰延税金負債との相殺 - 繰延税金資産の純額 2,088,211	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 賞与引当金繰入超過額 19,674 退職給付引当金 27,681 (注) 繰越欠損金 1,727,082 その他 51,898 繰延税金資産 合計 1,826,336 繰延税金負債との相殺 - 繰延税金資産の純額 1,826,336

（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（2021年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	-	848,990	1,138,872	1,987,863
繰延税金資産	-	-	-	-	848,990	1,138,872	(*) 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。

当事業年度（2022年3月31日現在）

	1年以内 (千円)	1年超 2年以内 (千円)	2年超 3年以内 (千円)	3年超 4年以内 (千円)	4年超 5年以内 (千円)	5年超 (千円)	合計 (千円)
税務上の繰越欠損金 (*1)	-	-	-	597,044	157,331	972,706	1,727,082
繰延税金資産	-	-	-	597,044	157,331	972,706	(*) 1,727,082

(*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1,727,082千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,727,082千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（2021年3月31日現在）	当事業年度（2022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 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に 算入されない項目</td><td>6.8%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr> <td></td><td></td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の 法人税等の負担率</td><td>37.0%</td></tr> <tr> <td></td><td>=====</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	6.8%	その他	0.4%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	37.0%		=====	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 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>30.6%</td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に 算入されない項目</td><td>8.0%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td></td><td></td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の 法人税等の負担率</td><td>38.4%</td></tr> <tr> <td></td><td>=====</td></tr> </table>	法定実効税率	30.6%	交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%	その他	0.2%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%		=====
法定実効税率	30.6%																								
交際費等永久に損金に 算入されない項目	6.8%																								
その他	0.4%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	37.0%																								
	=====																								
法定実効税率	30.6%																								
交際費等永久に損金に 算入されない項目	8.0%																								
その他	0.2%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	38.4%																								
	=====																								

（資産除去債務関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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み、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14,661千円であります。当事業年度において、本社オフィスの一部解約等に伴う原状回復費用の精算が行われたことから、資産除去債務の総額は、20,679千円減少しました。

（収益認識関係）

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社は、「（セグメント情報）」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社は、「（セグメント情報）」に記載のとおり、投資運用業の単一セグメントであり、営業収益のうち委託者報酬と投資顧問収入は、顧客との契約から生じる収益であります。

(1) 収益の分解情報

損益計算書に記載のとおりです。

(2) 収益を理解するための基礎となる情報

重要な会計方針「5.収益の計上方法」に記載のとおりです。

(3) 当期及び翌期以降の収益の金額を理解するための情報

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

（セグメント情報）

1.セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2.セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

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

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

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

前事業年度 自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日											
種 類	会社等の 名称	所在地	資本金 又は 出資金	事業の内容 又は 職業	議決権の 所有（被所 有）割合	関連当事者との関係 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	210,494	前払金	170
								投資顧問料の支払	182,861		
								人件費等の支払	178,279	未払金	19,408
								事務手数料の受取	77,977		
								移転価格調整金の支払	1,306,329		
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	38,231	前払金	59,280
								兼職社員の人件費支払等	133,561		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	17,282	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポールシンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	249	-	-
								投資顧問料の支払	21,878		

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 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。
2. 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。
3. 役務料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて支払われております。
4. 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。
5. ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて計算されております。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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 役員の 兼任等	事業上の関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	ソフトウェア使用料の支払	351,919	前払金	598
								投資顧問料の支払	221,949		
								ソフトウェアの使用契約	396,782	未払金	28,457
								人件費等及び事務手数料の受取	85,395		
	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	移転価格調整金の支払	363,220		
								投資信託計理業務委託	38,999	前払金	119,051
								兼職社員の人件費支払等	127,476		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ	投資顧問料の支払	19,193	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	264	-	-
								投資顧問料の支払	24,400		

(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

1. 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。
2. 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。
3. 役務料については、当社との間で締結された役務提供契約に基づいて支払われております。

- 4．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。
- 5．ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役務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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
1株当たり純資産 1,050,045円38銭 1株当たり当期純利益 77,405円89銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	1株当たり純資産 1,108,000円68銭 1株当たり当期純利益 135,213円36銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

（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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日	当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
当期純利益（千円）	479,916	838,322
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）	479,916	838,322
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 2020年4月 1日 至 2021年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022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

2022年6月22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2021年4月1日から2022年3月31日までの第25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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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、継続企業の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す。

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

2022年11月 7 日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御 中

P w C 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2022年2月22日から2022年8月21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2022年8月21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（2022年2月22日から2022年8月21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．上記の中間監査報告書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。