

【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】

2024年5月20日

【発行者名】

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式
会社

【代表者の役職氏名】

代表取締役 新原 謙介

【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】

久保 政喜

【電話番号】

03-4530-7297

【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】ステート・ストリート・グローバル債券インデックス・
オープン（隔月分配型）【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】当初申込期間 100万円を上限とします。
継続申込期間 3兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】

該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出したことに伴い、2023年12月21日付をもって提出した有価証券届出書（2024年2月26日付で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】****（2）【ファンドの沿革】**

<訂正前>

2024年1月11日 信託契約締結、設定、運用開始（予定）

<訂正後>

2024年1月11日 信託契約締結、設定、運用開始

3【投資リスク】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

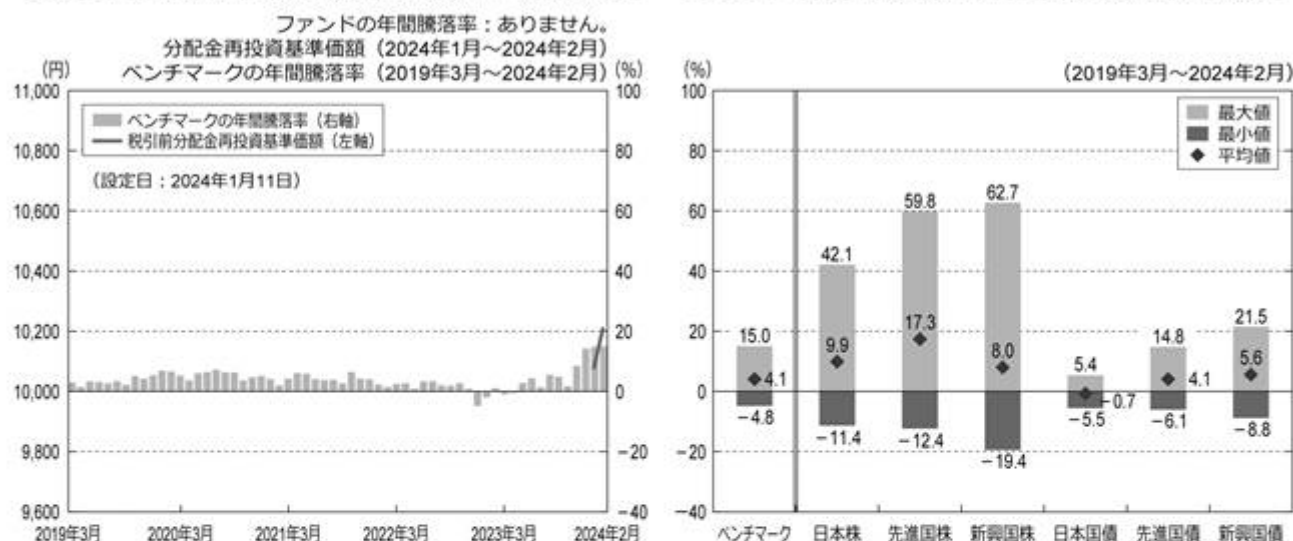
<訂正・更新後>

(1)～(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。
 - ・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:TOPIX(東証株価指数、配当込み)

TOPIX(東証株価指数、配当込み)は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社に帰属します。

先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)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、円換算ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング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、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。

先進国国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)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。

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

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

<略>

上記は、2023年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。 なお、NISAは2024年1月1日以降の内容です。

<略>

<訂正後>

<略>

上記は、2024年2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>

(参考情報) ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間におけるファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率 (①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
0.10%	0.06%	0.04%

※対象期間は2024年1月11日～2024年2月20日です。

※上記は、対象期間の運用報告書に記載されている総経費率(原則として、購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含まれていません。)です。平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。

※その他費用とは監査費用や有価証券の保管費用等です。

※詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

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】

(2024年2月29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	1,194,037	100.00
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		13	0.00
純資産総額		1,194,050	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

<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）

(2024年2月29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	43,884,526,403	46.87
	中国	7,856,400,978	8.39
	フランス	7,510,227,967	8.02
	イタリア	6,784,391,916	7.25
	ドイツ	5,864,906,759	6.26
	イギリス	4,822,090,612	5.15
	スペイン	4,488,563,396	4.79
	カナダ	1,847,425,814	1.97
	ベルギー	1,598,383,143	1.71
	オランダ	1,331,052,287	1.42
	オーストラリア	1,248,283,603	1.33
	オーストリア	1,097,586,159	1.17
	メキシコ	801,480,201	0.86
	アイルランド	537,398,487	0.58
	ポーランド	488,428,813	0.52
	フィンランド	476,837,251	0.51
	マレーシア	470,552,303	0.50
	シンガポール	375,537,581	0.40
	イスラエル	317,545,550	0.34
	デンマーク	254,121,917	0.27
	ニュージーランド	228,200,282	0.24
	スウェーデン	194,822,836	0.21
	ノルウェー	164,650,412	0.18
小計		92,643,414,670	98.94
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		993,617,792	1.06
純資産総額		93,637,032,462	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(2024年2月29日現在)

順位	国／地域名	種類	銘柄名	業種	数量 （口）	簿価 単価 （円）	簿価金額 （円）	評価 単価 （円）	評価金額 （円）	投資 比率 （％）
----	-------	----	-----	----	-----------	-----------------	-------------	-----------------	-------------	-----------------

1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券インデック ス・マザー・ファンド	—	408,791	2.9081	1,188,845	2.9209	1,194,037	100.00
---	----	---------------	-------------------------	---	---------	--------	-----------	--------	-----------	--------

（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資産の時価比率です。

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	-	100.00
合 計		100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（2024年2月29日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2029/08/15	8,000,000	13,150.66	1,052,053,275	13,165.96	1,053,277,463	1.12
2	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.910	2028/10/14	42,000,000	2,151.04	903,437,073	2,155.03	905,116,452	0.97
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875	2025/04/30	5,800,000	14,886.31	863,406,192	14,883.95	863,269,647	0.92
4	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.690	2026/08/12	39,100,000	2,119.77	828,831,102	2,122.26	829,805,313	0.89
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2029/02/15	5,800,000	13,940.50	808,549,371	13,954.04	809,334,496	0.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	2025/05/15	5,200,000	14,571.43	757,714,724	14,576.14	757,959,563	0.81
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2025/03/31	5,000,000	14,692.09	734,604,535	14,693.26	734,663,387	0.78
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500	2025/03/31	5,000,000	14,351.90	717,595,301	14,361.32	718,066,144	0.77
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2027/11/30	5,300,000	13,123.00	695,519,201	13,135.95	696,205,461	0.74
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2025/07/31	4,600,000	14,663.84	674,536,643	14,661.48	674,428,349	0.72
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2027/01/31	4,800,000	13,858.69	665,217,468	13,863.40	665,443,473	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/08/15	4,500,000	14,466.67	651,000,339	14,470.79	651,185,735	0.70
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2027/05/15	4,200,000	14,147.08	594,177,737	14,151.79	594,375,491	0.63
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	4,000,000	14,451.37	578,054,869	14,453.72	578,149,044	0.62
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2026/11/15	4,050,000	14,115.89	571,693,773	14,122.36	571,955,975	0.61
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/05/15	4,000,000	14,131.78	565,271,466	14,135.31	565,412,716	0.60
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.250	2025/08/31	4,000,000	14,067.04	562,681,822	14,077.63	563,105,584	0.60

18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2026/09/30	4,000,000	14,021.72	560,869,075	14,028.20	561,128,041	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2027/02/28	4,100,000	13,675.06	560,677,794	13,680.95	560,919,100	0.60
20	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.890	2031/11/18	25,800,000	2,158.55	556,908,435	2,161.83	557,754,183	0.60
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2031/05/15	4,400,000	12,584.47	553,716,961	12,612.13	554,934,087	0.59
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2030/08/15	4,600,000	11,951.78	549,781,883	11,981.79	551,162,633	0.59
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	2032/05/15	3,900,000	13,572.07	529,310,772	13,596.79	530,274,828	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750	2029/01/31	3,800,000	13,364.89	507,866,194	13,379.61	508,425,318	0.54
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2032/02/15	4,000,000	12,605.66	504,226,568	12,630.97	505,238,884	0.54
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250	2027/02/15	3,500,000	14,155.32	495,436,508	14,158.86	495,560,103	0.53
27	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.260	2025/02/24	23,500,000	2,100.36	493,585,559	2,102.22	494,021,943	0.53
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2026/08/15	3,500,000	14,008.77	490,307,251	14,011.13	490,389,654	0.52
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2026/08/31	3,500,000	13,952.27	488,329,707	13,955.22	488,432,708	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2031/11/15	4,000,000	12,180.13	487,205,572	12,210.74	488,429,766	0.52

（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資産の時価比率です。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率（％）
国債証券	-	98.94
合 計		98.94

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

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。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

2024年2月29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。

特定期間	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特定期間	自2024年 1月11日	分配付： 1,015,520	分配付： 1.0155
	至2024年 2月20日	分配落： 1,015,520	分配落： 1.0155
	2024年 1月末日	1,007,866	1.0079
	2月末日	1,194,050	1.0209

【分配の推移】

特定期間	計算期間	一口当たりの分配金
------	------	-----------

第1特定期間	自2024年 1月11日 至2024年 2月20日	0.0000円
--------	------------------------------	---------

【収益率の推移】

特定期間	計算期間	収益率
第1特定期間	自2024年 1月11日 至2024年 2月20日	1.6%

（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】

特定期間	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1特定期間	自2024年 1月11日 至2024年 2月20日	1,000,000	—	1,000,000

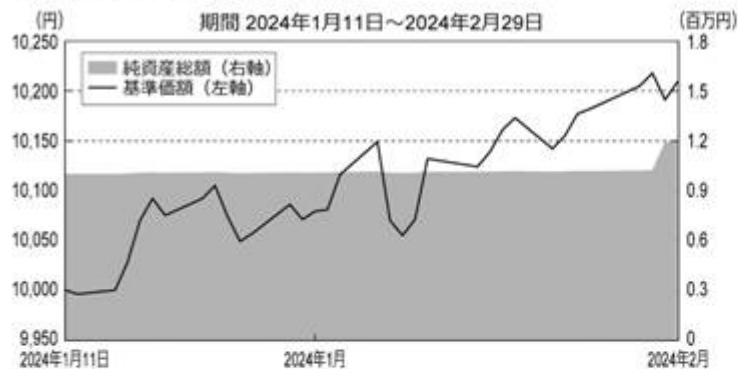
（注１）日本国外における設定、解約はありません。

（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

（2024年2月29日現在）

基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	10,209円
純資産総額	1.2百万円

分配の推移

決算期	分配金
第1期（2024年2月20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>

	国／地域名	種類	銘柄名	利率	償還日	投資比率
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625%	2029/08/15	1.12%
2	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.910%	2028/10/14	0.97%
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.875%	2025/04/30	0.92%
4	中国	国債証券	CHINESE GOVERNMENT BOND	2.690%	2026/08/12	0.89%
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625%	2029/02/15	0.86%
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.125%	2025/05/15	0.81%
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625%	2025/03/31	0.78%
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.500%	2025/03/31	0.77%
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625%	2027/11/30	0.74%
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.875%	2025/07/31	0.72%

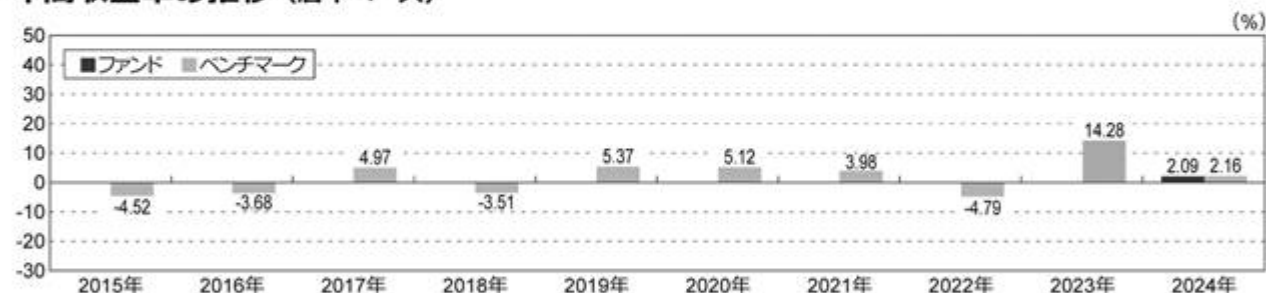
（注）投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

<国／地域別投資比率>

	国／地域名	投資比率
1	アメリカ	46.87%
2	中国	8.39%
3	フランス	8.02%
4	イタリア	7.25%
5	ドイツ	6.26%
6	イギリス	5.15%
7	スペイン	4.79%
8	カナダ	1.97%
9	ベルギー	1.71%
10	オランダ	1.42%

（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ヶ国／地域について記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）



※2024年のファンドとベンチマークの年間収益率は設定時から2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】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

- 1)～2) <略>
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 4)～11) <略>

<訂正後>

- 1)～2) <略>
- 3) 当ファンドの取得申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 4)～11) <略>

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

- 1) <略>
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込受付締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 3)～10) <略>

<訂正後>

- 1) <略>
- 2) 当ファンドの換金申込みの申込締切時間は、原則として販売会社の営業日の午後3時までとし、この受付時刻を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。なお、2024年11月5日より東京証券取引所の取引時間が午後3時30分までに変更される予定です。これにより、ファンドの申込締切時間が変更される場合があります。詳しくは販売会社にお問合せください。
- 3)～10) <略>

第3【ファンドの経理状況】

< 訂正前 >

< 略 >

< 訂正後 >

（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）当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

（３）当ファンドの第1期計算期間は、約款第36条により、2024年1月11日から2024年2月20日までとしております。このため、当特定期間は2024年1月11日から2024年2月20日までとしております。

（４）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（2024年1月11日から2024年2月20日まで）の財務諸表について、PwC Japan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】

ステート・ストリート・グローバル債券インデックス・オープン（隔月分配型）

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

当期 （2024年2月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	1
コール・ローン	97
親投資信託受益証券	1,015,489
流動資産合計	1,015,587
資産合計	1,015,587
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	33
未払委託者報酬	20
その他未払費用	14
流動負債合計	67
負債合計	67
純資産の部	
元本等	
元本	1,000,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,520
（分配準備積立金）	15,520
元本等合計	1,015,520
純資産合計	1,015,520
負債純資産合計	1,015,587

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

当期	
自 2024年1月11日	
至 2024年2月20日	
営業収益	
有価証券売買等損益	15,589
営業収益合計	15,589
営業費用	
支払利息	2
受託者報酬	33
委託者報酬	20
その他費用	14
営業費用合計	69
営業利益又は営業損失（　）	15,520
経常利益又は経常損失（　）	15,520
当期純利益又は当期純損失（　）	15,520
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（　）	-
期首剰余金又は期首欠損金（　）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（　）	15,520

(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。
-------------------	--

(重要な会計上の見積りに関する注記)

当期 (2024年2月20日現在)
当特定期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌特定期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	当期 (2024年2月20日現在)
1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	—円
期中一部解約元本額	—円
2 受益権の総数	1,000,000口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当期 自 2024年1月11日 至 2024年2月20日
1 分配金の計算過程	(2024年1月11日から2024年2月20日までの計算期間) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,412円)、費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(13,108円)、収益調整金(0円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は15,520円(1万口当たり155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、業務部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析を行います。コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しており、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	当期 (2024年2月20日現在)
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
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。
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る場合、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	当期 (2024年2月20日現在)
	最終計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	15,589
合計	15,589

(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)

	当期 (2024年2月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0155円 (10,155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	評価額 (円)	備考
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	349,518	1,015,489	
合 計		349,518	1,015,489	

(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「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、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。

「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	(2024年2月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		456,460,285
金銭信託		625,559
コール・ローン		80,832,760
国債証券		92,206,308,892
派生商品評価勘定		47,940
未収利息		677,680,675
前払費用		35,779,517
流動資産合計		93,457,735,628
資産合計		93,457,735,628
負債の部		
流動負債		
未払金		211,471,183
未払解約金		17,668,896

未払利息		217
その他未払費用		219
流動負債合計		229,140,515
負債合計		229,140,515
純資産の部		
元本等		
元本	1	32,087,499,983
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		61,141,095,130
元本等合計		93,228,595,113
純資産合計		93,228,595,113
負債純資産合計		93,457,735,628

（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。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

（2024年2月20日現在）

当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（2024年2月20日現在）
1 期首元本額	34,693,435,914円
期中追加設定元本額	608,341,275円
期中一部解約元本額	3,214,277,206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	6,522,141,699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	29,972,360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）	796,641,718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＞	2,648,325,399円
外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	517,318,076円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,365,542円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	49,349,187円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	79,545円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	1,907,466円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	1,436,172円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	5,226,113,526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＞	65,074,366円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,259,139円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,389,443,841円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	901,135,728円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	19,758,715円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	422,909,834円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	2,726,042,591円

4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	508,872,030円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	1,718,423,064円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	59,284,371円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	60,485,928円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	48,955,179円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	23,931,189円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	409,339,503円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	1,291,345円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	1,051,916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＞	643,266,255円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	663,700,649円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,073,298,832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＞	178,832,429円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	28,574,469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＞	182,418,457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＞	64,152,607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＞	174,506,643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	271,289,355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）	2,341,135,762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＞	1,564,858,301円
ステート・ストリート・グローバル債券インデックス・オープン（隔月分配型）	349,518円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	10,472,898円

世界バランス 60 V A < 適格機関投資家限定 >	6,432,090円
グローバルバランス 40 V A < 適格機関投資家限定 >	608,168円
グローバルバランス 40 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	691,277,057円
グローバルバランス 40 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	30,445,613円
グローバルバランス 50 V A < 適格機関投資家限定 >	9,971,451円
計	32,087,499,983円
2 受益権の総数	32,087,499,983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	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、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。 デリバティブ取引には、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いる為替予約取引があり、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。
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	（2024年2月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。

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 「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 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。 「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。

（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	（2024年2月20日現在）	
	当期間の損益に 含まれた評価差額	
国債証券	261,111,573	
合 計	261,111,573	

（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

通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（2024年2月20日現在）			
		契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	30,023,400	—	30,071,340	47,940
	合 計	30,023,400	—	30,071,340	47,940

（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。

（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）

	(2024年2月20日現在)
1口当たり純資産額	2.9054円
(1万口当たり純資産額)	(29,054円)

（３）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	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
-----	-----	-----	------	-----	----

国債証券	アメリカ・ドル	US TREASURY N/B 0.25% 25/05/31	2,500,000.00	2,358,105.47	
		US TREASURY N/B 0.25% 25/08/31	4,000,000.00	3,734,531.24	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/07/31	3,500,000.00	3,053,750.00	
		US TREASURY N/B 0.38% 27/09/30	3,200,000.00	2,776,249.98	
		US TREASURY N/B 0.5% 25/03/31	5,000,000.00	4,762,695.30	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/06/30	2,000,000.00	1,758,671.88	
		US TREASURY N/B 0.5% 27/10/31	2,000,000.00	1,738,203.12	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/11/30	5,300,000.00	4,616,175.76	
		US TREASURY N/B 0.63% 27/12/31	2,950,000.00	2,561,314.46	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/05/15	2,800,000.00	2,240,437.50	
		US TREASURY N/B 0.63% 30/08/15	4,600,000.00	3,648,914.07	
		US TREASURY N/B 0.75% 26/03/31	1,200,000.00	1,108,453.12	
		US TREASURY N/B 0.88% 26/06/30	2,600,000.00	2,390,679.69	
		US TREASURY N/B 0.88% 26/09/30	2,200,000.00	2,007,671.86	
		US TREASURY N/B 0.88% 30/11/15	4,000,000.00	3,209,375.00	
		US TREASURY N/B 1.13% 27/02/28	4,100,000.00	3,721,230.47	
		US TREASURY N/B 1.13% 31/02/15	3,650,000.00	2,968,333.99	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/05/15	1,000,000.00	609,296.88	
		US TREASURY N/B 1.13% 40/08/15	1,700,000.00	1,025,910.15	
		US TREASURY N/B 1.25% 26/11/30	3,000,000.00	2,750,976.57	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/03/31	1,400,000.00	1,238,015.63	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/05/31	2,800,000.00	2,464,656.26	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/06/30	2,600,000.00	2,283,734.38	
		US TREASURY N/B 1.25% 28/09/30	600,000.00	523,617.18	
		US TREASURY N/B 1.25% 31/08/15	4,000,000.00	3,226,250.00	
		US TREASURY N/B 1.25% 50/05/15	1,500,000.00	748,769.53	
		US TREASURY N/B 1.38% 26/08/31	3,500,000.00	3,241,054.67	
		US TREASURY N/B 1.38% 28/10/31	1,400,000.00	1,226,367.18	
		US TREASURY N/B 1.38% 28/12/31	1,000,000.00	872,460.94	
		US TREASURY N/B 1.38% 31/11/15	4,000,000.00	3,233,593.76	
		US TREASURY N/B 1.38% 40/11/15	1,700,000.00	1,067,281.25	
		US TREASURY N/B 1.38% 50/08/15	2,700,000.00	1,392,925.78	
		US TREASURY N/B 1.5% 26/08/15	3,500,000.00	3,254,179.67	
		US TREASURY N/B 1.5% 27/01/31	4,800,000.00	4,415,062.51	
		US TREASURY N/B 1.5% 28/11/30	2,400,000.00	2,110,781.24	
		US TREASURY N/B 1.5% 30/02/15	1,500,000.00	1,279,628.91	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/02/15	3,000,000.00	2,829,609.36	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/05/15	4,000,000.00	3,751,718.76	
		US TREASURY N/B 1.63% 26/09/30	4,000,000.00	3,722,500.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 29/08/15	8,000,000.00	6,982,500.00	
		US TREASURY N/B 1.63% 31/05/15	4,400,000.00	3,675,031.27	
		US TREASURY N/B 1.63% 50/11/15	800,000.00	441,718.75	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/01/31	3,800,000.00	3,370,718.75	
		US TREASURY N/B 1.75% 29/11/15	3,000,000.00	2,625,000.00	
		US TREASURY N/B 1.88% 32/02/15	4,000,000.00	3,346,562.48	
		US TREASURY N/B 1.88% 41/02/15	1,400,000.00	954,679.68	
		US TREASURY N/B 1.88% 51/02/15	3,650,000.00	2,148,652.36	

US TREASURY N/B 1.88% 51/11/15	2,400,000.00	1,404,562.51	
US TREASURY N/B 2.0% 25/02/15	100,000.00	97,093.75	
US TREASURY N/B 2.0% 25/08/15	4,500,000.00	4,320,703.12	
US TREASURY N/B 2.0% 26/11/15	4,050,000.00	3,794,343.75	
US TREASURY N/B 2.0% 41/11/15	800,000.00	549,156.24	
US TREASURY N/B 2.0% 50/02/15	2,200,000.00	1,348,960.93	
US TREASURY N/B 2.0% 51/08/15	1,600,000.00	969,062.49	
US TREASURY N/B 2.13% 25/05/15	5,200,000.00	5,028,968.77	
US TREASURY N/B 2.25% 25/11/15	4,000,000.00	3,836,562.48	
US TREASURY N/B 2.25% 26/03/31	2,300,000.00	2,193,085.92	
US TREASURY N/B 2.25% 27/02/15	3,500,000.00	3,288,222.66	
US TREASURY N/B 2.25% 27/08/15	2,000,000.00	1,862,500.00	
US TREASURY N/B 2.25% 27/11/15	2,800,000.00	2,596,890.63	
US TREASURY N/B 2.25% 41/05/15	1,250,000.00	903,466.80	
US TREASURY N/B 2.25% 46/08/15	200,000.00	134,234.37	
US TREASURY N/B 2.25% 49/08/15	1,000,000.00	653,007.81	
US TREASURY N/B 2.25% 52/02/15	2,100,000.00	1,350,890.62	
US TREASURY N/B 2.38% 27/05/15	4,200,000.00	3,943,570.30	
US TREASURY N/B 2.38% 29/05/15	3,000,000.00	2,731,289.06	
US TREASURY N/B 2.38% 49/11/15	1,700,000.00	1,140,726.55	
US TREASURY N/B 2.38% 51/05/15	4,000,000.00	2,657,031.24	
US TREASURY N/B 2.5% 26/02/28	3,000,000.00	2,877,539.07	
US TREASURY N/B 2.5% 45/02/15	900,000.00	645,785.15	
US TREASURY N/B 2.5% 46/05/15	1,000,000.00	707,656.25	
US TREASURY N/B 2.63% 25/03/31	5,000,000.00	4,875,585.95	
US TREASURY N/B 2.63% 25/12/31	3,000,000.00	2,891,718.75	
US TREASURY N/B 2.63% 26/01/31	2,300,000.00	2,214,199.21	
US TREASURY N/B 2.63% 27/05/31	1,800,000.00	1,702,265.61	
US TREASURY N/B 2.63% 29/02/15	5,800,000.00	5,366,359.40	
US TREASURY N/B 2.75% 25/02/28	1,200,000.00	1,173,281.25	
US TREASURY N/B 2.75% 25/06/30	2,900,000.00	2,821,269.52	
US TREASURY N/B 2.75% 28/02/15	2,300,000.00	2,166,222.66	
US TREASURY N/B 2.75% 32/08/15	3,100,000.00	2,756,699.21	
US TREASURY N/B 2.75% 42/08/15	1,200,000.00	924,937.50	
US TREASURY N/B 2.75% 42/11/15	1,000,000.00	768,125.00	
US TREASURY N/B 2.75% 47/08/15	500,000.00	367,285.15	
US TREASURY N/B 2.75% 47/11/15	1,000,000.00	733,398.44	
US TREASURY N/B 2.88% 25/07/31	4,600,000.00	4,476,914.07	
US TREASURY N/B 2.88% 25/11/30	2,300,000.00	2,228,304.67	
US TREASURY N/B 2.88% 28/05/15	3,400,000.00	3,208,085.94	
US TREASURY N/B 2.88% 28/08/15	1,500,000.00	1,411,816.41	
US TREASURY N/B 2.88% 32/05/15	3,900,000.00	3,513,046.87	
US TREASURY N/B 2.88% 43/05/15	300,000.00	234,011.71	
US TREASURY N/B 2.88% 45/08/15	1,100,000.00	840,554.68	
US TREASURY N/B 2.88% 46/11/15	800,000.00	605,218.75	
US TREASURY N/B 2.88% 49/05/15	500,000.00	373,144.53	
US TREASURY N/B 2.88% 52/05/15	1,500,000.00	1,111,816.41	

US TREASURY N/B 3.0% 25/09/30	2,500,000.00	2,431,835.95	
US TREASURY N/B 3.0% 42/05/15	1,200,000.00	964,453.12	
US TREASURY N/B 3.0% 45/05/15	1,100,000.00	860,964.84	
US TREASURY N/B 3.0% 45/11/15	1,000,000.00	779,765.62	
US TREASURY N/B 3.0% 47/02/15	900,000.00	695,320.30	
US TREASURY N/B 3.0% 47/05/15	1,000,000.00	771,250.00	
US TREASURY N/B 3.0% 48/02/15	550,000.00	422,468.75	
US TREASURY N/B 3.0% 48/08/15	1,500,000.00	1,149,433.59	
US TREASURY N/B 3.0% 49/02/15	1,700,000.00	1,300,632.80	
US TREASURY N/B 3.0% 52/08/15	1,800,000.00	1,369,898.44	
US TREASURY N/B 3.13% 27/08/31	3,200,000.00	3,067,750.01	
US TREASURY N/B 3.13% 28/11/15	1,700,000.00	1,613,937.50	
US TREASURY N/B 3.13% 41/11/15	950,000.00	783,712.89	
US TREASURY N/B 3.13% 42/02/15	1,400,000.00	1,150,898.43	
US TREASURY N/B 3.13% 43/02/15	700,000.00	569,351.56	
US TREASURY N/B 3.13% 44/08/15	1,100,000.00	885,027.34	
US TREASURY N/B 3.13% 48/05/15	1,500,000.00	1,178,085.93	
US TREASURY N/B 3.25% 29/06/30	2,800,000.00	2,658,796.86	
US TREASURY N/B 3.38% 33/05/15	2,200,000.00	2,043,765.63	
US TREASURY N/B 3.38% 42/08/15	1,300,000.00	1,103,019.52	
US TREASURY N/B 3.38% 48/11/15	2,050,000.00	1,682,521.48	
US TREASURY N/B 3.5% 28/01/31	1,900,000.00	1,840,847.66	
US TREASURY N/B 3.5% 33/02/15	1,800,000.00	1,691,226.55	
US TREASURY N/B 3.5% 39/02/15	400,000.00	360,609.37	
US TREASURY N/B 3.63% 28/03/31	2,500,000.00	2,432,226.55	
US TREASURY N/B 3.63% 43/08/15	600,000.00	524,554.68	
US TREASURY N/B 3.63% 44/02/15	800,000.00	697,906.24	
US TREASURY N/B 3.63% 53/02/15	1,100,000.00	948,019.52	
US TREASURY N/B 3.75% 41/08/15	800,000.00	723,312.49	
US TREASURY N/B 3.75% 43/11/15	700,000.00	622,453.12	
US TREASURY N/B 3.88% 25/04/30	5,800,000.00	5,730,445.29	
US TREASURY N/B 3.88% 26/01/15	1,000,000.00	985,703.12	
US TREASURY N/B 3.88% 33/08/15	2,000,000.00	1,932,500.00	
US TREASURY N/B 3.88% 40/08/15	900,000.00	833,976.55	
US TREASURY N/B 3.88% 43/05/15	800,000.00	726,625.00	
US TREASURY N/B 4.0% 28/06/30	2,300,000.00	2,269,812.50	
US TREASURY N/B 4.0% 42/11/15	300,000.00	277,886.71	
US TREASURY N/B 4.0% 52/11/15	900,000.00	831,234.37	
US TREASURY N/B 4.13% 32/11/15	2,200,000.00	2,169,320.31	
US TREASURY N/B 4.13% 53/08/15	850,000.00	802,984.37	
US TREASURY N/B 4.25% 39/05/15	500,000.00	490,351.56	
US TREASURY N/B 4.25% 40/11/15	1,000,000.00	968,671.88	
US TREASURY N/B 4.38% 28/11/30	350,000.00	351,121.09	
US TREASURY N/B 4.38% 30/11/30	1,500,000.00	1,504,453.12	
US TREASURY N/B 4.38% 38/02/15	400,000.00	401,546.87	
US TREASURY N/B 4.38% 39/11/15	750,000.00	743,232.42	
US TREASURY N/B 4.38% 40/05/15	500,000.00	493,632.81	

US TREASURY N/B 4.38% 43/08/15	500,000.00	486,328.12	
US TREASURY N/B 4.5% 33/11/15	2,100,000.00	2,131,500.00	
US TREASURY N/B 4.5% 36/02/15	520,000.00	534,401.56	
US TREASURY N/B 4.5% 38/05/15	300,000.00	304,289.06	
US TREASURY N/B 4.63% 25/06/30	500,000.00	498,535.15	
US TREASURY N/B 4.63% 28/09/30	1,800,000.00	1,822,500.00	
US TREASURY N/B 4.75% 41/02/15	1,800,000.00	1,850,484.38	
US TREASURY N/B 4.75% 43/11/15	350,000.00	357,929.68	
US TREASURY N/B 4.75% 53/11/15	950,000.00	997,648.41	
US TREASURY N/B 5.0% 25/08/31	1,500,000.00	1,503,984.37	
US TREASURY N/B 5.0% 25/09/30	2,000,000.00	2,006,718.75	
US TREASURY N/B 5.0% 37/05/15	200,000.00	214,296.87	
US TREASURY N/B 5.38% 31/02/15	500,000.00	534,414.06	
US TREASURY N/B 6.0% 26/02/15	2,000,000.00	2,051,796.88	
US TREASURY N/B 6.13% 27/11/15	300,000.00	317,707.03	
US TREASURY N/B 6.25% 30/05/15	900,000.00	993,937.50	
アメリカ・ドル小計	330,570,000.00	290,711,635.50 (43,717,215,745)	

カナダ・ドル	CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/09/01	1,650,000.00	1,554,085.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 27/06/01	1,200,000.00	1,097,196.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 30/06/01	1,090,000.00	946,425.20	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/06/01	1,100,000.00	1,037,674.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 31/06/01	1,720,000.00	1,488,642.80	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 53/12/01	820,000.00	564,324.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/06/01	550,000.00	513,496.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 32/06/01	1,710,000.00	1,514,136.60	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 51/12/01	850,000.00	630,334.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 25/06/01	3,350,000.00	3,252,247.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 33/06/01	300,000.00	280,254.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 48/12/01	430,000.00	379,384.70	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 55/12/01	150,000.00	130,573.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 64/12/01	360,000.00	311,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/01	300,000.00	285,081.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 45/12/01	450,000.00	450,238.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 37/06/01	450,000.00	516,573.00	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 29/06/01	750,000.00	825,892.50	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/06/01	700,000.00	817,551.00	
カナダ・ドル小計		17,930,000.00	16,595,510.30 (1,848,407,936)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 30/12/21	1,400,000.00	1,152,181.89	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 31/11/21	910,000.00	725,752.68	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 32/05/21	2,250,000.00	1,803,709.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 51/06/21	500,000.00	282,505.63	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 28/05/21	700,000.00	658,269.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/21	700,000.00	645,011.26	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 27/11/21	650,000.00	627,125.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 35/06/21	490,000.00	425,380.57	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 2.75% 41/05/21	400,000.00	318,355.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 47/03/21	340,000.00	265,441.19	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 25/04/21	50,000.00	49,582.98	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 29/04/21	370,000.00	359,896.91	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 39/06/21	350,000.00	306,026.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 3.75% 37/04/21	350,000.00	330,962.94	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.25% 26/04/21	1,650,000.00	1,665,544.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 33/04/21	1,980,000.00	2,032,720.76	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 27/04/21	930,000.00	957,299.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 54/06/21	130,000.00	134,840.77	
	オーストラリア・ドル小計	14,150,000.00	12,740,606.61 (1,251,254,974)	

イギリス・ bond	UK GILT BOND 0.25% 31/07/31	1,390,000.00	1,055,051.70	
	UK GILT BOND 0.38% 30/10/22	800,000.00	632,502.40	
	UK GILT BOND 0.88% 29/10/22	810,000.00	683,636.76	
	UK GILT BOND 1.13% 39/01/31	650,000.00	414,565.66	
	UK GILT BOND 1.25% 27/07/22	900,000.00	818,424.00	
	UK GILT BOND 1.5% 26/07/22	1,150,000.00	1,078,801.20	
	UK GILT BOND 1.63% 28/10/22	500,000.00	450,050.00	
	UK GILT BOND 1.63% 71/10/22	970,000.00	439,798.00	
	UK GILT BOND 1.75% 37/09/07	700,000.00	513,156.28	
	UK GILT BOND 1.75% 49/01/22	900,000.00	520,463.70	
	UK GILT BOND 1.75% 57/07/22	880,000.00	459,609.92	
	UK GILT BOND 2.0% 25/09/07	1,650,000.00	1,587,531.00	
	UK GILT BOND 2.5% 65/07/22	820,000.00	513,768.42	
	UK GILT BOND 3.25% 33/01/31	900,000.00	842,715.90	
	UK GILT BOND 3.25% 44/01/22	450,000.00	370,071.92	
	UK GILT BOND 3.5% 45/01/22	800,000.00	679,445.12	
	UK GILT BOND 3.5% 68/07/22	650,000.00	526,350.37	
	UK GILT BOND 3.75% 52/07/22	970,000.00	836,172.01	
	UK GILT BOND 4.0% 60/01/22	920,000.00	828,239.20	
	UK GILT BOND 4.25% 27/12/07	1,050,000.00	1,054,473.00	
	UK GILT BOND 4.25% 32/06/07	1,050,000.00	1,065,781.50	
	UK GILT BOND 4.25% 36/03/07	850,000.00	847,189.56	
	UK GILT BOND 4.25% 39/09/07	430,000.00	418,648.00	
	UK GILT BOND 4.25% 40/12/07	650,000.00	628,615.00	
	UK GILT BOND 4.25% 46/12/07	850,000.00	803,520.30	
	UK GILT BOND 4.25% 49/12/07	650,000.00	611,704.86	
	UK GILT BOND 4.25% 55/12/07	950,000.00	891,765.00	
	UK GILT BOND 4.5% 34/09/07	900,000.00	922,197.60	
	UK GILT BOND 4.5% 42/12/07	750,000.00	742,545.00	
	UK GILT BOND 4.75% 30/12/07	800,000.00	835,478.72	
	UK GILT BOND 4.75% 38/12/07	600,000.00	619,560.00	
	UK GILT BOND 4.75% 43/10/22	100,000.00	101,710.14	
	UK GILT BOND 5.0% 25/03/07	1,720,000.00	1,722,808.07	
	UK GILT BOND 6.0% 28/12/07	700,000.00	759,839.08	
イギリス・bond小計		28,860,000.00	25,276,189.39 (4,784,782,652)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 50/03/01	160,000.00	127,875.38	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.88% 51/10/01	190,000.00	153,012.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 25/06/01	455,000.00	448,947.59	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.38% 39/07/01	240,000.00	220,801.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 42/04/01	370,000.00	357,897.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.75% 46/03/01	110,000.00	105,404.63	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 2.88% 30/09/01	650,000.00	642,813.54	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.0% 72/08/01	90,000.00	91,548.76	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.38% 33/09/01	350,000.00	359,049.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 3.5% 27/03/01	850,000.00	859,969.03	
シンガポール・ドル小計		3,465,000.00	3,367,319.38 (376,028,554)	
マレーシア・リングット	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 27/05/31	1,000,000.00	1,000,148.11	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.58% 32/07/15	300,000.00	294,092.91	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.76% 40/05/22	200,000.00	192,960.94	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.9% 26/11/30	2,500,000.00	2,528,620.15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 3.96% 25/09/15	1,550,000.00	1,562,282.29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.07% 50/06/15	850,000.00	831,345.27	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 30/04/15	1,700,000.00	1,772,043.17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.64% 33/11/07	3,100,000.00	3,298,505.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.74% 46/03/15	1,550,000.00	1,677,324.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.92% 48/07/06	450,000.00	497,899.93	
	MALAYSIAN GOVERNMENT BOND 4.94% 43/09/30	1,130,000.00	1,245,991.48	
マレーシア・リングット小計		14,330,000.00	14,901,214.17 (467,728,251)	

ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND GOVERNMENT	540,000.00	524,074.06	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	800,000.00	664,833.32	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	30,000.00	27,700.59	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	1,150,000.00	933,107.34	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	290,000.00	178,932.90	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT	205,000.00	134,265.91	
ニュージーランド・ドル小計		3,015,000.00	2,462,914.12 (227,400,861)	
スウェーデン・クローナ	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/12	4,200,000.00	3,906,844.91	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 0.75% 29/11/12	1,400,000.00	1,277,300.08	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/11/12	3,000,000.00	2,865,979.38	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 2.5% 25/05/12	2,100,000.00	2,081,016.33	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND 3.5% 39/03/30	2,950,000.00	3,270,075.00	
スウェーデン・クローナ小計		13,650,000.00	13,401,215.70 (193,781,579)	
ノルウェー・クローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.38% 30/08/19	2,200,000.00	1,896,113.12	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 26/02/19	2,700,000.00	2,569,185.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 27/02/17	3,000,000.00	2,819,685.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 1.75% 29/09/06	1,700,000.00	1,528,198.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 2.13% 32/05/18	1,300,000.00	1,144,023.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 33/08/15	950,000.00	888,251.52	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 42/10/06	750,000.00	737,536.50	
ノルウェー・クローネ小計		12,600,000.00	11,582,992.54 (165,984,283)	
デンマーク・クローネ	DANISH GOVERNMENT BOND 0.25% 52/11/15	2,090,000.00	1,108,467.03	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/11/15	3,400,000.00	3,161,987.08	
	DANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/11/15	2,050,000.00	1,842,569.93	
	DANISH GOVERNMENT BOND 1.75% 25/11/15	1,600,000.00	1,571,223.04	
	DANISH GOVERNMENT BOND 4.5% 39/11/15	3,160,000.00	3,912,857.99	
デンマーク・クローネ小計		12,300,000.00	11,597,105.07 (251,889,122)	

メキシコ・ペソ	MEXICAN GOVERNMENT BOND 10.0% 36/11/20	7,200,000.00	7,626,384.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 5.75% 26/03/05	19,000,000.00	17,490,319.09	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.5% 27/06/03	19,500,000.00	18,423,970.89	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 31/05/29	11,500,000.00	10,603,000.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 34/11/23	5,500,000.00	4,952,035.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 7.75% 42/11/13	4,300,000.00	3,685,487.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 47/11/07	9,100,000.00	7,908,537.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.0% 53/07/31	4,000,000.00	3,442,640.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 29/05/31	10,500,000.00	10,192,455.00	
	MEXICAN GOVERNMENT BOND 8.5% 38/11/18	7,000,000.00	6,548,290.00	
メキシコ・ペソ小計		97,600,000.00	90,873,117.98 (801,573,599)	
イスラエル・シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	1,957,900.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,300,000.00	1,255,735.00	
	ISRAEL FIXED BOND	1,400,000.00	1,316,210.00	
	ISRAEL FIXED BOND	880,000.00	746,548.00	
	ISRAEL FIXED BOND	950,000.00	1,052,932.50	
	ISRAEL FIXED BOND	1,240,000.00	1,110,978.00	
	ISRAEL FIXED BOND	150,000.00	121,927.50	
イスラエル・シェケル小計		7,920,000.00	7,562,231.00 (312,983,348)	
ポーランド・ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND 0.75% 25/04/25	620,000.00	590,624.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 30/10/25	2,500,000.00	1,944,972.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND 1.75% 32/04/25	1,370,000.00	1,045,386.72	
	POLAND GOVERNMENT BOND 2.5% 26/07/25	3,000,000.00	2,828,424.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 3.25% 25/07/25	2,580,000.00	2,516,661.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND 5.75% 29/04/25	3,220,000.00	3,287,268.37	
	POLAND GOVERNMENT BOND 6.0% 33/10/25	640,000.00	663,252.48	
ポーランド・ズロチ小計		13,930,000.00	12,876,589.47 (481,802,061)	

中国・人民 元	CHINA GOVERNMENT BOND	23,500,000.00	23,582,119.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,200,000.00	21,237,299.28	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,019,998.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,017,221.19	
	CHINA GOVERNMENT BOND	39,100,000.00	39,599,202.21	
	CHINA GOVERNMENT BOND	21,000,000.00	21,117,590.97	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,123,254.55	
	CHINA GOVERNMENT BOND	19,500,000.00	19,770,473.77	
	CHINA GOVERNMENT BOND	42,000,000.00	43,163,664.18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	17,900,000.00	18,099,937.80	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,034,905.42	
	CHINA GOVERNMENT BOND	5,100,000.00	5,200,036.95	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,079,885.54	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,007,913.87	
	CHINA GOVERNMENT BOND	18,300,000.00	19,021,192.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	25,800,000.00	26,607,507.49	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,519,942.60	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,133,980.57	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,500,000.00	8,538,457.99	
	CHINA GOVERNMENT BOND	13,200,000.00	15,996,600.97	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,500,000.00	12,202,169.59	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,100,000.00	15,856,573.62	
中国・人民元小計		362,700,000.00	373,929,929.31 (7,803,394,123)	

ユーロ	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/20	820,000.00	697,692.90	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/20	550,000.00	453,622.40	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.0% 40/10/20	250,000.00	150,289.75	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.5% 29/02/20	350,000.00	314,230.35	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 26/10/20	700,000.00	664,046.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 28/02/20	700,000.00	648,662.00	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.75% 51/03/20	390,000.00	225,591.99	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 20/06/30	150,000.00	67,062.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.2% 25/10/20	230,000.00	223,341.96	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 47/02/20	335,000.00	246,922.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.5% 86/11/02	120,000.00	71,197.49	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.1% 17/09/20	190,000.00	142,432.17	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.4% 34/05/23	300,000.00	286,095.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.9% 33/02/20	550,000.00	550,995.50	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.15% 44/06/20	240,000.00	239,877.60	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.8% 62/01/26	195,000.00	222,996.73	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.15% 37/03/15	400,000.00	446,244.80	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.85% 26/03/15	350,000.00	363,303.85	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.25% 27/07/15	650,000.00	722,276.10	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.1% 30/06/22	400,000.00	340,191.60	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.35% 32/06/22	200,000.00	163,633.25	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 40/06/22	280,000.00	179,870.64	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 71/06/22	260,000.00	108,140.50	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 25/06/22	400,000.00	387,661.20	

BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 27/06/22	380,000.00	357,031.66	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 28/06/22	750,000.00	694,194.75	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.9% 29/06/22	580,000.00	529,855.40	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 31/06/22	900,000.00	796,425.30	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.25% 33/04/22	450,000.00	393,453.90	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.45% 37/06/22	300,000.00	245,524.80	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.6% 47/06/22	350,000.00	251,333.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 50/06/22	450,000.00	319,506.52	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.9% 38/06/22	300,000.00	256,215.00	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.15% 66/06/22	160,000.00	119,599.20	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 57/06/22	580,000.00	449,535.96	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.0% 34/06/22	450,000.00	452,107.80	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.75% 45/06/22	340,000.00	361,442.78	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.0% 32/03/28	950,000.00	1,032,041.21	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.25% 41/03/28	370,000.00	417,431.41	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/28	480,000.00	495,481.92	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.0% 35/03/28	500,000.00	593,253.25	
BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.5% 28/03/28	800,000.00	887,027.20	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/09/15	30,000.00	25,142.94	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 31/09/15	230,000.00	188,877.03	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 36/04/15	250,000.00	177,042.10	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.13% 52/04/15	180,000.00	83,277.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.25% 40/09/15	150,000.00	95,123.85	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/04/15	430,000.00	409,235.05	

FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 27/09/15	120,000.00	111,062.76	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 28/09/15	300,000.00	272,058.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/09/15	170,000.00	150,793.57	
FINNISH GOVERNMENT BOND 0.75% 31/04/15	280,000.00	244,020.95	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.13% 34/04/15	200,000.00	169,065.00	
FINNISH GOVERNMENT BOND 1.38% 47/04/15	170,000.00	123,015.96	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.63% 42/07/04	245,000.00	228,670.75	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.75% 28/07/04	200,000.00	200,541.60	
FINNISH GOVERNMENT BOND 2.95% 55/04/15	80,000.00	78,166.90	
FINNISH GOVERNMENT BOND 3.0% 33/09/15	50,000.00	50,511.73	
FINNISH GOVERNMENT BOND 4.0% 25/07/04	320,000.00	323,604.48	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 26/02/25	650,000.00	613,744.95	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 29/11/25	1,400,000.00	1,202,579.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 30/11/25	2,300,000.00	1,919,833.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/11/25	1,800,000.00	1,458,902.52	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.0% 32/05/25	1,850,000.00	1,476,172.35	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.25% 26/11/25	2,280,000.00	2,128,544.16	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 25/05/25	900,000.00	870,277.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 26/05/25	2,800,000.00	2,658,124.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 29/05/25	1,600,000.00	1,431,046.40	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 40/05/25	900,000.00	595,773.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.5% 72/05/25	190,000.00	72,895.02	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/05/25	2,230,000.00	2,058,758.30	
FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 28/11/25	1,250,000.00	1,143,549.88	

FRENCH GOVERNMENT BOND 0.75% 53/05/25	530,000.00	278,417.74	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 25/11/25	1,950,000.00	1,884,492.51	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.0% 27/05/25	1,250,000.00	1,183,256.25	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 34/05/25	1,500,000.00	1,281,379.99	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.25% 36/05/25	1,100,000.00	901,037.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 31/05/25	1,700,000.00	1,565,926.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/25	1,100,000.00	754,448.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 39/06/25	1,200,000.00	1,001,934.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 1.75% 66/05/25	850,000.00	570,101.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 32/11/25	800,000.00	750,458.08	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.0% 48/05/25	1,200,000.00	941,580.00	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.5% 30/05/25	2,100,000.00	2,077,954.80	
FRENCH GOVERNMENT BOND 2.75% 27/10/25	2,600,000.00	2,602,361.37	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.0% 54/05/25	350,000.00	326,027.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.25% 45/05/25	1,190,000.00	1,184,948.11	
FRENCH GOVERNMENT BOND 3.5% 26/04/25	1,700,000.00	1,722,380.50	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 38/10/25	900,000.00	992,330.10	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 55/04/25	930,000.00	1,044,270.96	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.0% 60/04/25	570,000.00	648,979.20	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.5% 41/04/25	950,000.00	1,112,246.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 4.75% 35/04/25	1,400,000.00	1,634,808.78	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.5% 29/04/25	1,480,000.00	1,676,992.44	
FRENCH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/10/25	1,300,000.00	1,588,312.70	
FRENCH GOVERNMENT BOND 6.0% 25/10/25	750,000.00	785,827.50	

GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 25/10/10	900,000.00	859,708.08	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 26/08/15	2,500,000.00	2,342,712.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 29/08/15	630,000.00	554,954.92	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/02/15	700,000.00	609,736.28	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 30/08/15	900,000.00	776,505.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/02/15	1,100,000.00	937,444.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,200,000.00	1,011,202.80	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 31/08/15	1,200,000.00	1,011,493.44	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 35/05/15	600,000.00	456,361.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 50/08/15	1,300,000.00	669,531.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.0% 52/08/15	880,000.00	431,866.16	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 27/02/15	1,850,000.00	1,728,973.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 28/08/15	1,350,000.00	1,229,169.60	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.25% 29/02/15	600,000.00	541,265.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 25/02/15	600,000.00	583,792.78	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 26/02/15	2,000,000.00	1,911,700.00	
GERMAN GOVERNMENT BOND 0.5% 27/08/15	1,750,000.00	1,636,090.75	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.0% 25/08/15	1,950,000.00	1,893,052.68	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.25% 48/08/15	1,150,000.00	876,827.85	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.7% 32/08/15	2,330,000.00	2,215,713.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 1.8% 53/08/15	750,000.00	632,218.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.2% 34/02/15	300,000.00	294,558.91	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 44/07/04	950,000.00	931,946.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 2.5% 46/08/15	1,050,000.00	1,032,932.25	

GERMAN GOVERNMENT BOND 2.6% 33/08/15	900,000.00	916,178.40	
GERMAN GOVERNMENT BOND 3.25% 42/07/04	350,000.00	381,367.14	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/04	580,000.00	673,153.22	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.25% 39/07/04	600,000.00	724,168.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/07/04	800,000.00	875,917.45	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 34/07/04	1,050,000.00	1,271,283.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 4.75% 40/07/04	680,000.00	872,250.96	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.5% 31/01/04	1,100,000.00	1,317,035.50	
GERMAN GOVERNMENT BOND 5.63% 28/01/04	1,300,000.00	1,449,813.30	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.25% 30/01/04	850,000.00	1,028,663.20	
GERMAN GOVERNMENT BOND 6.5% 27/07/04	1,200,000.00	1,351,123.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.0% 31/10/18	100,000.00	81,948.80	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.35% 32/10/18	100,000.00	82,265.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.4% 35/05/15	170,000.00	131,231.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.55% 41/04/22	70,000.00	47,204.08	
IRISH GOVERNMENT BOND 0.9% 28/05/15	420,000.00	392,162.40	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.0% 26/05/15	650,000.00	625,751.10	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.1% 29/05/15	220,000.00	204,090.04	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.3% 33/05/15	190,000.00	168,482.12	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.35% 31/03/18	500,000.00	459,794.50	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.5% 50/05/15	405,000.00	291,934.12	
IRISH GOVERNMENT BOND 1.7% 37/05/15	220,000.00	190,632.20	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.0% 45/02/18	250,000.00	209,660.00	
IRISH GOVERNMENT BOND 2.4% 30/05/15	320,000.00	316,196.48	

IRISH GOVERNMENT BOND 5.4% 25/03/13	100,000.00	102,128.32	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.6% 31/08/01	1,230,000.00	993,020.82	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 0.9% 31/04/01	700,000.00	584,626.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 26/12/01	2,100,000.00	1,994,143.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.35% 30/04/01	1,000,000.00	885,400.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.5% 25/06/01	850,000.00	830,049.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.6% 26/06/01	3,100,000.00	2,992,978.70	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 30/12/01	1,000,000.00	887,595.92	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.65% 32/03/01	1,750,000.00	1,510,468.75	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.7% 51/09/01	420,000.00	252,309.12	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 1.8% 41/03/01	970,000.00	687,330.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 25/12/01	2,000,000.00	1,957,557.34	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 28/02/01	2,600,000.00	2,483,910.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.05% 27/08/01	1,000,000.00	963,197.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.2% 27/06/01	1,200,000.00	1,163,700.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.25% 36/09/01	900,000.00	743,924.94	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 33/09/01	1,230,000.00	1,101,782.34	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.45% 50/09/01	600,000.00	429,420.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.7% 47/03/01	550,000.00	426,416.65	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 28/12/01	1,100,000.00	1,076,770.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.8% 67/03/01	550,000.00	395,098.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 2.95% 38/09/01	500,000.00	435,759.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.0% 29/08/01	1,400,000.00	1,374,130.80	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.25% 46/09/01	600,000.00	512,562.00	

ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.35% 35/03/01	700,000.00	662,893.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.45% 48/03/01	600,000.00	526,740.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.5% 30/03/01	900,000.00	903,877.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 3.85% 49/09/01	600,000.00	558,072.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.0% 37/02/01	1,150,000.00	1,148,677.50	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.2% 34/03/01	450,000.00	462,791.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.4% 33/05/01	900,000.00	945,016.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 26/03/01	1,500,000.00	1,536,684.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.5% 53/10/01	100,000.00	101,537.62	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 28/09/01	1,270,000.00	1,347,188.91	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 4.75% 44/09/01	500,000.00	529,135.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 25/03/01	780,000.00	791,655.54	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 34/08/01	850,000.00	930,318.73	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 39/08/01	800,000.00	870,539.20	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.0% 40/09/01	850,000.00	924,702.25	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.25% 29/11/01	1,400,000.00	1,535,688.00	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 5.75% 33/02/01	1,050,000.00	1,208,729.36	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 6.0% 31/05/01	800,000.00	925,629.60	
ITALIAN GOVERNMENT BOND 7.25% 26/11/01	900,000.00	993,916.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 30/07/15	500,000.00	425,056.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 31/07/15	800,000.00	662,416.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 38/01/15	450,000.00	305,400.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.0% 52/01/15	550,000.00	262,647.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 25/07/15	520,000.00	499,980.43	

NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.25% 29/07/15	250,000.00	221,305.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 26/07/15	950,000.00	901,004.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.5% 40/01/15	370,000.00	261,344.46	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 27/07/15	700,000.00	658,037.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.75% 28/07/15	700,000.00	647,405.85	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.0% 54/01/15	180,000.00	152,583.37	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.5% 33/01/15	650,000.00	643,601.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.75% 47/01/15	540,000.00	536,786.46	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.25% 44/01/15	100,000.00	106,244.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.75% 42/01/15	500,000.00	563,852.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.0% 37/01/15	500,000.00	564,025.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.5% 28/01/15	700,000.00	773,512.36	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.1% 31/04/30	1,550,000.00	1,257,904.05	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.5% 30/04/30	850,000.00	731,675.07	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.6% 29/10/31	750,000.00	657,974.25	
SPANISH GOVERNMENT BOND 0.7% 32/04/30	2,200,000.00	1,818,559.60	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 42/07/30	680,000.00	437,535.80	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.0% 50/10/31	550,000.00	293,843.55	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.3% 26/10/31	1,150,000.00	1,101,732.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/04/30	1,100,000.00	1,034,936.76	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.4% 28/07/30	900,000.00	843,982.20	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 27/10/31	1,100,000.00	1,044,099.10	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 29/04/30	600,000.00	557,673.46	
SPANISH GOVERNMENT BOND 1.45% 71/10/31	270,000.00	130,061.16	

	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.5% 27/04/30	1,600,000.00	1,531,291.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.6% 25/04/30	750,000.00	735,263.03	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.85% 35/07/30	870,000.00	745,492.84	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.9% 52/10/31	500,000.00	331,041.00	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 1.95% 30/07/30	750,000.00	704,073.17	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.15% 25/10/31	1,550,000.00	1,527,224.30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.35% 33/07/30	1,200,000.00	1,115,780.40	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.7% 48/10/31	520,000.00	428,449.12	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 2.9% 46/10/31	440,000.00	381,772.60	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.45% 66/07/30	350,000.00	314,493.90	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 3.9% 39/07/30	400,000.00	411,436.45	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.2% 37/01/31	950,000.00	1,022,134.45	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.65% 25/07/30	1,050,000.00	1,071,016.27	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.7% 41/07/30	800,000.00	905,336.88	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 4.9% 40/07/30	900,000.00	1,035,307.80	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 28/10/31	750,000.00	822,395.25	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.15% 44/10/31	400,000.00	479,897.13	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.75% 32/07/30	1,050,000.00	1,252,971.82	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 5.9% 26/07/30	1,800,000.00	1,920,814.20	
	SPANISH GOVERNMENT BOND 6.0% 29/01/31	800,000.00	912,358.65	
	ユーロ小計	194,260,000.00	182,302,592.35 (29,522,081,804)	
国債証券合計			92,206,308,892 (92,206,308,892)	
合 計			92,206,308,892 (92,206,308,892)	

（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。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	有価証券の合計額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 157銘柄	100.0%	47.4%
カナダ・ドル	国債証券 19銘柄	100.0%	2.0%
オーストラリア・ドル	国債証券 18銘柄	100.0%	1.4%
イギリス・ポンド	国債証券 34銘柄	100.0%	5.2%
シンガポール・ドル	国債証券 10銘柄	100.0%	0.4%
マレーシア・リンギット	国債証券 11銘柄	100.0%	0.5%
ニュージーランド・ドル	国債証券 6銘柄	100.0%	0.2%
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェー・クローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
メキシコ・ペソ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.9%
イスラエル・シェケル	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
中国・人民元	国債証券 22銘柄	100.0%	8.5%
ユーロ	国債証券 236銘柄	100.0%	32.0%

（注）組入債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】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

< 訂正・更新後 >

【純資産額計算書】

（2024年2月29日現在）

資産総額	1,194,068円
負債総額	18円
純資産総額（ - ）	1,194,050円
発行済口数	1,169,660口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0209円

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（2024年2月29日現在）

資産総額	93,663,875,680円
負債総額	26,843,218円
純資産総額（ - ）	93,637,032,462円
発行済口数	32,057,062,256口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9209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年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

投資運用の意思決定機構

1) 運用基本方針の決定

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

2) 運用実施計画の作成

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

3) 運用の実行

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

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

2024年2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3,587,060百万円です(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、以下「中間財務諸表等規則」という）ならびに同規則第38条第1項及び第57条第1項の規定に基づき、「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26期事業年度（2022年4月1日から2023年3月31日まで）の財務諸表ならびに第27期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の中間財務諸表について、EY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 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023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		4,391,110			4,944,755	
有価証券		23,294			24,319	
前払金		119,649			232,900	
前払費用		29,290			34,419	
未収入金		688,466			615,211	
未収委託者報酬		685,229			665,966	
未収収益		42,751			36,568	
流動資産計		5,979,793	75.8		6,554,141	80.5
固定資産						
有形固定資産		375			112	
建物附属設備	1	0			0	
器具備品	1	375			112	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		1,904,306			1,586,165	
長期差入保証金		71,694			42,548	
繰延税金資産		1,826,336			1,537,341	
その他投資		6,275			6,275	
固定資産計		1,904,682	24.2		1,586,278	19.5
資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2022年3月31日現在)			当事業年度 (2023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		172,682			211,213	
未払金		344,370			341,855	
未払手数料	177,539			180,016		
その他未払金	166,831			161,839		
未払費用		11,699			12,884	
未払法人税等		296,332			176,932	
未払消費税等		30,068			25,106	
賞与引当金		74,876			92,579	
流動負債計		930,030	11.8		860,572	10.6
固定負債						
退職給付引当金		84,840			76,260	
固定負債計		84,840	1.1		76,260	0.9
負債合計		1,014,871	12.9		936,833	11.5
(純資産の部)			%			%
株主資本		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5

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	6,450,484			6,784,466		
純資産合計		6,869,604	87.1		7,203,586	88.5
負債・純資産合計		7,884,475	100.0		8,140,419	100.0

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度			当事業年度		
	自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	金 額	構成比	自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	金 額	構成比
			%			%
営業収益						
委託者報酬		2,655,508			2,681,106	
投資顧問収入		3,030,659			2,805,885	
その他営業収益	1	85,660			12,640	
営業収益計		5,771,828	100.0		5,499,631	100.0
営業費用						
支払手数料		711,649			753,876	
広告宣伝費		53,735			51,264	
公告費		1,140			1,140	
調査費		712,486			654,933	
調査費	407,466			337,268		
委託調査費	304,641			317,181		
図書費	378			483		
委託計算費		485,872			387,357	
営業雑経費		29,696			44,076	
通信費	3,997			6,765		
印刷費	7,276			14,575		
協会費	12,853			17,758		
諸会費	55			7		
その他	5,512			4,968		
営業費用計		1,994,579	34.6		1,892,648	34.4
一般管理費						
給料		1,568,661			1,475,040	
役員報酬	425,268			251,291		
給料・手当	787,766			816,610		
賞与	285,950			330,579		
賞与引当金繰入額	69,676			76,559		
交際費		1,607			3,676	
旅費交通費		676			10,847	
租税公課		32,240			3,770	
不動産賃借料		60,478			64,855	
退職給付費用		74,675			61,481	
固定資産減価償却費		2,571			765	
福利厚生費		130,238			139,590	
諸経費		186,753			192,029	
一般管理費計		2,057,903	35.7		1,952,057	35.5
営業利益		1,719,345	29.8		1,654,925	30.1
営業外収益						
移転価格調整金	1、 2				131,841	
為替差益		18			1,707	
有価証券運用益		1,013			2,727	

雑収入		881			106	
営業外収益計		1,913	0.0		136,383	2.5
営業外費用						
移転価格調整金	1	363,220			-	
為替差損		214			1,046	
有価証券運用損		1			-	
雑損失		329			73	
営業外費用計		363,766	6.3		1,119	0.0
経常利益		1,357,491	23.5		1,790,188	32.6
特別利益						
事業再構築費用戻入		7,084			-	
特別利益計		7,084	0.1		-	0.0
特別損失						
事務処理損失		146			4,303	
固定資産除却損		2,326			-	
特別損失計		2,472	0.0		4,303	0.1
税引前当期純利益		1,362,102	23.6		1,785,884	32.5
法人税,住民税及び事業税		261,905	4.5		324,907	5.9
法人税等調整額		261,874	4.5		288,994	5.3
当期純利益		838,322	14.5		1,171,982	21.3

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本						純資産合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		株主資本 合計		
			その他利益			利益剰余金 合計	
			剰余金				
			別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,450,484	6,559,604	6,869,604	6,869,604
当期変動額							
剰余金の配当	-	-	-	(838,000)	(838,000)	(838,000)	(838,000)
当期純利益	-	-	-	1,171,982	1,171,982	1,171,982	1,171,982
当期変動額合計	-	-	-	333,982	333,982	333,982	333,982
当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	7,203,586

[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 発生の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、投資顧問契約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

（時価の算定に関する会計基準の適用指針の適用）

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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。ただし、これによる具体的な会計方針の変更は無く、したがって、時価算定会計基準適用指針の適用にともなう当事業年度における貸借対照表、損益計算書および株主資本等変動計算書への影響は有りません。

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 1,537,341千円

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 (2022年3月31日現在)	当事業年度 (2023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 30,399千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 30,661千円
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
1. 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。	1. 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事務手数料調整額12,389千円は、損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額131,841千円は、損益計算書の営業外収益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。	2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外収益 131,841千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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
2022年6月27日 定時株主総会	普通株式	838,000千円	135,161.29円	2022年3月31日	2022年6月28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
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,171,000千円	利益剰余金	188,870.96円	2023年3月31日	2023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、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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。

2023年3月31日現在

	貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
有価証券	24,319	24,319	-
資産計	24,319	24,319	-

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。

2023年3月31日現在

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	-	24,319	-	24,319
資産計	-	24,319	-	24,319

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

（有価証券関係）

前事業年度 （2022年3月31日現在）		当事業年度 （2023年3月31日現在）	
売買目的の有価証券		売買目的の有価証券	
貸借対照表計上額	23,294千円	貸借対照表計上額	24,319千円
当事業年度の損益		当事業年度の損益	
に含まれた評価差額	1,013千円	に含まれた評価差額	1,025千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日		当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
退職給付債務の期首残高	480,173
勤務費用	53,150
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	12,549
退職給付の支払額	37,376
退職給付債務の期末残高	483,396

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 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
年金資産の期首残高	402,431
期待運用収益	2,979
数理計算上の差異の発生額	3,493
事業主からの拠出額	51,651
退職給付の支払額	37,376
年金資産の期末残高	416,191

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 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	<u>7,098</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	84,840

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
積立型制度の退職給付債務	483,396
年金資産	416,191
	<u>67,205</u>
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	67,205
未認識数理計算上の差異	<u>9,055</u>
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	76,260

５．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 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	<u>55,694</u>
(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	-

(単位：千円)

	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	<u>43,071</u>
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,979
(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	7,098
(6)その他	-

6．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2023年3月31日現在）

年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	98.2%
その他	1.8%
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 (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

	当事業年度 (2023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 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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は18,410千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 2021年4月 1日	自 2022年4月 1日
至 2022年3月31日	至 2023年3月31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金繰入超過額 19,674	賞与引当金繰入超過額 22,144
退職給付引当金 27,681	退職給付引当金 25,052
(注) 繰越欠損金 1,727,082	(注) 繰越欠損金 1,453,659
その他 51,898	その他 36,485
繰延税金資産 合計 1,826,336	繰延税金資産 合計 1,537,341
繰延税金負債との相殺 -	繰延税金負債との相殺 -
繰延税金資産の純額 1,826,336	繰延税金資産の純額 1,537,341

(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（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	(*2) 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。

当事業年度（2023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)	-	-	319,359	158,439	-	975,860	1,453,659
繰延税金資産	-	-	319,359	158,439	-	975,860	(*2) 1,453,659

(*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1,453,659千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,453,659千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（2022年3月31日現在）	当事業年度（2023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>8.0%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td colspan="2"> </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 colspan="2">=====</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%	=====		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>3.1%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.6%</td></tr> <tr> <td colspan="2"> </td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の 法人税等の負担率</td><td>34.3%</td></tr> <tr> <td colspan="2">=====</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	3.1%	その他	0.6%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%	=====	
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	3.1%																								
その他	0.6%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.3%																								
=====																									

（資産除去債務関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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15,059千円であります。当事業年度において、原状回復費用の見直しが行われたことから、資産除去債務の総額は、397千円増加千円減少しました。

（収益認識関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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、投資顧問収入については、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、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 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

前事業年度 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・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支払	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。
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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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	295,434	前払金	3,388
								投資顧問料の支払	232,843		
								ソフトウェアの使用契約	175,762	未払金	24,509
								人件費等及び事務手数料の受取	12,389		
								移転価格調整金の受取	131,841		
	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	39,303	前払金	229,512
								兼職社員の人件費支払等	127,670		
	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	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	19,754	-	-
	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受入れ及びETF商品の紹介	紹介料の受取	250	-	-
								投資顧問料の支払	22,792		

(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。
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
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。	1株当たり純資産 1,161,868円75銭 1株当たり当期純利益 189,029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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日	当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
当期純利益（千円）	838,322	1,171,982
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）	838,322	1,171,982
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 2021年4月 1日 至 2022年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023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)

期 別 科 目	第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)		
	金 額		構成比
(資産の部)			%
流動資産			
預金		5,594,690	
前払金		98,445	
前払費用		27,130	
未収入金		687,092	
未収委託者報酬		735,800	
未収収益		301,004	
流動資産計		7,444,163	83.4
固定資産			
有形固定資産		7	
器具備品	1	7	
投資その他の資産		1,478,931	
投資有価証券		26,352	
長期差入保証金		50,200	
繰延税金資産		1,396,103	
その他投資		6,275	
固定資産計		1,478,939	16.6
資 産 合 計		8,923,103	100.0
(負債の部)			%
流動負債			
預り金		43,582	
未払金		390,886	
未払手数料		206,128	
その他未払金		184,758	
未払費用		13,156	
未払法人税等		233,970	
未払消費税等	2	16,949	
賞与引当金		299,712	
流動負債計		998,258	11.2
固定負債			
退職給付引当金		69,904	
固定負債計		69,904	0.8
負 債 合 計		1,068,163	12.0
(純資産の部)			%
株主資本		7,850,518	88.0
資本金		310,000	
利益剰余金		7,540,518	
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		7,431,398	
評価・換算差額等		4,421	

その他有価証券評価差額金	4,421		
純 資 産 合 計		7,854,940	88.0
負 債 ・ 純 資 産 合 計		8,923,103	100.0

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

期 別	第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日		
科 目	金 額	構成比	
		%	
営業収益			
委託者報酬		1,435,040	
投資顧問収入		1,434,219	
その他営業収益	1	63,660	
営業収益計		2,932,920	100.0
営業費用・一般管理費			
営業費用		1,028,805	
支払手数料	427,673		
その他営業費用	601,131		
一般管理費	2	967,219	
営業費用・一般管理費計		1,996,024	68.1
営業利益		936,895	31.9
営業外収益	1	69,185	2.4
営業外費用		4,146	0.1
経常利益		1,001,933	34.2
特別利益		0	0.0
特別損失		0	0.0
税引前中間純利益		1,001,933	34.2
法人税,住民税及び事業税		215,714	7.4
法人税等調整額		139,286	4.7
中間純利益		646,932	22.1

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2023年4月1日 至 2023年9月30日）

(単位：千円)

	株 主 資 本					評価・換算差額等		純資産 合計	
	資本金	利益剰余金			株主資本 合計	その他有 価証券評 価差額金	評価・ 換算差額等 合計		
		その他利益 剰余金		利益剰余金 合計					
		利益 準備金	別途積立金						繰越利益 剰余金
当期首残高	310,000	77,500	31,620	6,784,466	6,893,586	7,203,586	-	-	7,203,586
当中間期変動額									
中間純利益				646,932	646,932	646,932			646,932
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-	4,421	4,421	4,421
当中間期変動額合計	-	-	-	646,932	646,932	646,932	4,421	4,421	651,353
当中間期末残高	310,000	77,500	31,620	7,431,398	7,540,518	7,850,518	4,421	4,421	7,854,940

[重要な会計方針]

	第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 其他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法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 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とおりであります。 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、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	(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。 (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。 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中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。 数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括費用処理しております。
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、投資顧問契約毎に、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	消費税等の処理方法

中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。
------------------------	--------------------------------

注記事項

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額 器具備品	30,766千円
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27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
1. 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事務手数料調整額63,545千円は、中間損益計算書のその他営業収益に、移転価格調整額66,918千円は、中間損益計算書の営業外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	320千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日				
1. 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

（金融商品関係）

第27期中間会計期間末 (2023年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

	中間貸借対照表計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
投資有価証券	26,352	26,352	-
資産計	26,352	26,352	-

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。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
投資有価証券	-	26,352	-	26,352
其他有価証券	-	26,352	-	26,352
資産計	-	26,352	-	26,352

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券は投資信託であり基準価額を用いて評価しており、当該基準価額は活発な市場における相場価格とは認められないため、その時価をレベル2に分類しております。

（有価証券関係）

第27期中間会計期間末

（2023年9月30日現在）

其他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託	26,352千円	19,980千円	6,372千円
小計	26,352千円	19,980千円	6,372千円
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
合計	26,352千円	19,980千円	6,372千円

（資産除去債務関係）

第27期中間会計期間末

（2023年9月30日現在）

当社は建物所有者との間で建物賃貸借契約を締結しており、貸借期間終了時に原状回復する義務をゆうしているため、契約及び法令上の資産除去債務を認識しております。なお、当該賃貸借契約に関連する長期差入保証金（敷金）が計上されているため、資産除去債務の負債計上に代えて、当該敷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、そのうち当期の負担に属する金額を費用計上し、直接減額しております。

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間末
(2023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27期中間会計期間末
(2023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、記載を省略しております。

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、記載を省略しております。

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、投資顧問収入については、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、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。

（収益認識関係）

第27期中間会計期間
自 2023年4月 1日
至 2023年9月30日

(1) 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	1,435,040千円
投資顧問収入	1,434,219千円
その他営業収益	63,660千円
合計	2,932,920千円

(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。

(1 株当たり情報)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023年9月30日

1株当たり純資産額 1,266,925円84銭

1株当たり中間純利益 104,343円97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、記載していません。

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27期中間会計期間 自 2023年4月 1日 至 2023年9月30日	
中間純利益（千円）	646,932
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）	646,932
期中平均株式数（株）	6,200

(重要な後発事象)

第27期中間会計期間

自 2023年4月 1日

至 2023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】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

(1) 受託会社

名称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（2023年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

（参考）再信託受託会社

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2023年3月末現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2023年3月末)	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945百万円	

独立監査人の監査報告書

2024年4月26日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

PwC Japan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

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」に掲げられているステート・ストリート・グローバル債券インデックス・オープン（隔月分配型）の2024年1月11日から2024年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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・グローバル債券インデックス・オープン（隔月分配型）の2024年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、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、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、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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2023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

稲葉 宏 和

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2022年4月1日から2023年3月31日までの第26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2023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、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

（注）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2023年12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

業務執行社員

公認会計士

稲葉 宏和

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、「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2023年4月1日から2024年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、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2023年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2023年4月1日から2023年9月30日まで）の経営成績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、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、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。

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。

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な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、企業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、監査役に対して、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。

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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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) 1. 上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。