

【表紙】	
【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2024年11月20日
【計算期間】	第13期中 自 2024年2月21日 至 2024年8月20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 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
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号
【電話番号】	03-4530-7297
【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】

（2024年8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	4,852,605,299	84.75
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		873,147,993	15.25
純資産総額		5,725,753,292	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（日本株式インデックス・マザーファンド）

（2024年8月30日現在）

種類	国／地域名	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	47,428,175,980	97.24
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,344,626,288	2.76
純資産総額		48,772,802,268	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（日本債券インデックス・マザーファンド）

（2024年8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	58,114,284,200	82.58
特殊債券	日本	4,101,530,601	5.83
地方債証券	日本	4,055,163,041	5.76
社債券	日本	3,690,974,700	5.25
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		408,282,216	0.58
純資産総額		70,370,234,758	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（外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

（2024年8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	206,852,610,813	71.57
	イギリス	11,334,522,023	3.92
	カナダ	9,045,600,146	3.13
	フランス	8,468,288,324	2.93
	スイス	7,608,496,097	2.63
	ドイツ	6,597,438,504	2.28
	オーストラリア	5,290,480,994	1.83
	オランダ	3,768,454,902	1.31
	デンマーク	2,808,994,535	0.97
	スウェーデン	2,436,003,065	0.84
	イタリア	2,085,455,626	0.72
	スペイン	2,043,790,900	0.71
	香港	1,288,550,031	0.45
	シンガポール	949,205,709	0.33

	フィンランド	770,400,979	0.27
	ベルギー	732,586,058	0.25
	イスラエル	584,416,541	0.20
	ノルウェー	436,259,209	0.15
	アイルランド	224,545,659	0.08
	オーストリア	144,419,267	0.05
	ポルトガル	140,272,757	0.05
	ニュージーランド	134,729,541	0.05
	小 計	273,745,521,680	94.72
投資証券	アメリカ	4,785,365,306	1.66
	オーストラリア	349,529,390	0.12
	フランス	102,198,962	0.03
	イギリス	87,602,433	0.03
	シンガポール	72,241,677	0.02
	香港	52,226,327	0.02
	カナダ	22,020,801	0.01
	ベルギー	19,213,225	0.01
	小 計	5,490,398,121	1.90
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		9,780,054,680	3.38
純資産総額		289,015,974,481	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8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	40,844,520,687	46.63
	中国	8,975,396,635	10.25
	フランス	6,584,430,740	7.52
	イタリア	6,000,915,334	6.85
	ドイツ	5,300,259,364	6.05
	イギリス	4,636,824,667	5.29
	スペイン	3,907,008,477	4.46
	カナダ	1,733,915,273	1.98
	ベルギー	1,392,572,606	1.59
	オランダ	1,158,529,399	1.32
	オーストラリア	1,131,728,759	1.29
	オーストリア	1,004,067,655	1.15
	メキシコ	609,650,401	0.70
	マレーシア	479,647,612	0.55
	ポーランド	441,207,584	0.50
	フィンランド	434,330,573	0.50
	アイルランド	415,208,427	0.47
	シンガポール	348,100,808	0.40
	イスラエル	276,314,662	0.31
	デンマーク	235,230,233	0.27
	ニュージーランド	220,794,402	0.25
	スウェーデン	137,651,292	0.16
	ノルウェー	135,202,485	0.15

	小 計	86,403,508,075	98.64
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		1,188,617,303	1.36
純資産総額		87,592,125,378	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）【運用実績】

【純資産の推移】

2024年8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
第11期	（2023年 2月20日）	分配付：	4,805,659,775	分配付：	1.2509
		分配落：	4,774,926,222	分配落：	1.2429
第12期	（2024年 2月20日）	分配付：	5,134,866,475	分配付：	1.3535
		分配落：	5,096,929,136	分配落：	1.3435
2023年 8月末日		5,047,955,649		1.3147	
9月末日		4,990,104,768		1.3008	
10月末日		4,942,799,425		1.2890	
11月末日		5,076,587,595		1.3252	
12月末日		5,048,562,764		1.3277	
2024年 1月末日		5,103,852,095		1.3442	
2月末日		5,134,163,546		1.3489	
3月末日		5,175,002,626		1.3614	
4月末日		5,394,553,092		1.3674	
5月末日		5,391,166,021		1.3658	
6月末日		5,496,504,495		1.3932	
7月末日		5,582,237,064		1.3641	
8月末日		5,725,753,292		1.3493	

【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
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
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.0080円
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	0.0100円

【収益率の推移】

計算期間		収益率
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%
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	0.9%
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	8.9%
	自2024年 2月21日 至2024年 8月20日	0.8%

（注）各計算期間中の分配金を加味して算出しています。

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
第11期	自2022年 2月22日 至2023年 2月20日	50,649,746	39,140,907	3,841,694,195
第12期	自2023年 2月21日 至2024年 2月20日	68,655,295	116,615,517	3,793,733,973
	自2024年 2月21日 至2024年 8月20日	480,475,117	31,664,176	4,242,544,914

（注）日本国外における設定、解約はありません。

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（2024年2月21日から2024年8月20日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan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 （2024年2月20日現在）	当中間計算期間末 （2024年8月20日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	5,991,439	3,172,529
コール・ローン	774,194,644	892,339,043
親投資信託受益証券	4,376,092,630	4,873,015,249
未収利息	-	2,689
流動資産合計	5,156,278,713	5,768,529,510
資産合計	5,156,278,713	5,768,529,510
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	37,937,339	-
未払解約金	160,981	40
未払受託者報酬	1,397,943	1,464,545
未払委託者報酬	19,571,190	20,503,682
未払利息	2,080	-
その他未払費用	280,044	292,846
流動負債合計	59,349,577	22,261,113
負債合計	59,349,577	22,261,113
純資産の部		
元本等		
元本	3,793,733,973	4,242,544,914
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（　）	1,303,195,163	1,503,723,483
（分配準備積立金）	521,396,228	517,139,698
元本等合計	5,096,929,136	5,746,268,397
純資産合計	5,096,929,136	5,746,268,397
負債純資産合計	5,156,278,713	5,768,529,510

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自 2023年2月21日 至 2023年8月20日	当中間計算期間 自 2024年2月21日 至 2024年8月20日
営業収益		
受取利息	-	78,211
有価証券売買等損益	243,826,801	57,922,619
営業収益合計	243,826,801	58,000,830
営業費用		
支払利息	351,818	57,337
受託者報酬	1,342,365	1,464,545
委託者報酬	18,793,102	20,503,682
その他費用	274,414	293,554
営業費用合計	20,761,699	22,319,118
営業利益又は営業損失（ ）	223,065,102	35,681,712
経常利益又は経常損失（ ）	223,065,102	35,681,712
中間純利益又は中間純損失（ ）	223,065,102	35,681,712
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（ ）	1,614,729	466,001
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	933,232,027	1,303,195,163
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,656,242	176,179,098
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	12,656,242	176,179,098
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,195,639	10,866,489
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	12,195,639	10,866,489
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,155,143,003	1,503,723,483

（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 （2024年2月20日現在）	当中間計算期間末 （2024年8月20日現在）
1 期首元本額	3,841,694,195円	3,793,733,973円
期中追加設定元本額	68,655,295円	480,475,117円
期中一部解約元本額	116,615,517円	31,664,176円
2 受益権の総数	3,793,733,973口	4,242,544,914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 （2024年2月20日現在）	当中間計算期間末 （2024年8月20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 (2024年2月20日現在)	当中間計算期間末 (2024年8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3435円 (13,435円)	1.3544円 (13,544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	(2024年2月20日現在)	(2024年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		23,474,113	5,495,317
コール・ローン		3,033,250,058	1,545,671,057
株式		55,391,483,170	46,690,831,990
派生商品評価勘定		117,560,660	162,502,100
未収入金		—	4,417,680
未収配当金		86,036,255	58,668,732
未収利息		—	4,658
差入委託証拠金		158,028,707	195,557,588
流動資産合計		58,809,832,963	48,663,149,122
資産合計		58,809,832,963	48,663,149,122
負債の部			
流動負債			
前受金		125,305,000	134,797,500
未払金		—	863,820
未払解約金		95,023,780	22,322,400
未払利息		8,149	—

その他未払費用		1,872	—
流動負債合計		220,338,801	157,983,720
負債合計		220,338,801	157,983,720
純資産の部			
元本等			
元本	1	11,974,166,189	9,654,933,706
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		46,615,327,973	38,850,231,696
元本等合計		58,589,494,162	48,505,165,402
純資産合計		58,589,494,162	48,505,165,402
負債純資産合計		58,809,832,963	48,663,149,122

（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	（2024年2月20日現在）	（2024年8月20日現在）
1 期首元本額	14,752,340,035円	11,974,166,189円
期中追加設定元本額	2,145,538,404円	783,162,638円
期中一部解約元本額	4,923,712,250円	3,102,395,121円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	53,886,760円	53,886,760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＞	666,472,742円	545,784,713円

バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	866,334円	829,879円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	13,362,439円	11,695,004円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	80,268円	80,519円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	803,084円	760,261円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	2,571,702円	2,365,271円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	3,243,815,419円	3,036,520,913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＞	248,946,524円	245,140,797円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,844,809円	1,227,051円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	357,684,242円	310,116,283円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	340,075,903円	310,479,103円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	21,414,604円	19,804,929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＞	71,338,398円	70,034,552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＞	74,786,285円	73,433,457円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	63,969,931円	52,453,635円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,116,836,741円	1,014,230,647円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	132,345,274円	107,991,207円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	691,982,054円	620,155,616円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	23,885,879円	21,555,516円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	7,397,551円	6,894,171円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	11,376,333円	10,459,841円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	3,568,313円	3,000,403円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	247,746,630円	231,143,348円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	814,418円	725,714円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	1,095,031円	350,304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＞	46,907,714円	41,664,275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 >	151,789,389円	137,184,575円
世界分散ファンド V A 2 5 A < 適格 機関投資家限定 >	645,739,582円	587,797,479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 >	55,548,166円	53,008,111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 >	375,226,082円	198,593,503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 >	52,570,779円	49,607,266円
ステート・ストリート日本株式イン デックス・オープン	3,023,298,897円	1,638,110,124円
ステート・ストリートTOPIXインデッ クス・オープン	216,607円	5,846,377円
世界バランス 4 0 V A < 適格機関投 資家限定 >	1,850,770円	575,285円
世界バランス 6 0 V A < 適格機関投 資家限定 >	1,572,894円	1,500,881円
グローバルバランス 4 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	106,829円	100,790円
グローバルバランス 4 0 V A 2 < 適 格機関投資家限定 >	211,967,447円	182,260,131円
グローバルバランス 4 0 V A 3 < 適 格機関投資家限定 >	5,290,952円	4,663,364円
グローバルバランス 5 0 V A < 適格 機関投資家限定 >	3,112,413円	2,901,651円
計	11,974,166,189円	9,654,933,706円
2 受益権の総数	11,974,166,189口	9,654,933,706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	（2024年2月20日現在）	（2024年8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。	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。	(2)有価証券 売買目的有価証券 同左
	(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る場合、当該価額が異なることもあります。	同左
	「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）

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	（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	株価指数先物取引 買建 TOPIX（先物）	3,155,957,500	—	3,273,600,000	117,642,500
合 計		3,155,957,500	—	3,273,600,000	117,642,500

（単位：円）

区 分	種 類	（2024年8月20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）	1,574,255,000	—	1,736,800,000	162,545,000
合 計		1,574,255,000	—	1,736,800,000	162,545,000

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 4．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 5．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（１口当たり情報に関する注記）

	（ 2024年2月20日現在 ）	（ 2024年8月20日現在 ）
1口当たり純資産額	4.8930円	5.0239円
（ 1万口当たり純資産額 ）	（ 48,930円 ）	（ 50,239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	（ 2024年2月20日現在 ）	（ 2024年8月20日現在 ）
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		4,363,507	1,987,718
コール・ローン		460,255,773	279,646,328
国債証券		88,095,172,800	58,355,655,900
地方債証券		5,628,682,707	4,100,121,974
特殊債券		6,341,628,960	4,103,492,433
社債券		5,208,525,700	3,690,238,500
未収利息		272,199,137	214,982,579
前払費用		6,298,399	3,247,648
流動資産合計		106,017,126,983	70,749,373,080
資産合計		106,017,126,983	70,749,373,080
負債の部			
流動負債			
未払解約金		5,672,928	46,663,664
未払利息		1,236	—
その他未払費用		1,073	—
流動負債合計		5,675,237	46,663,664
負債合計		5,675,237	46,663,664
純資産の部			
元本等			
元本	1	86,862,860,040	58,829,312,550
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		19,148,591,706	11,873,396,866
元本等合計		106,011,451,746	70,702,709,416
純資産合計		106,011,451,746	70,702,709,416
負債純資産合計		106,017,126,983	70,749,373,080

（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	(2024年2月20日現在)	(2024年8月20日現在)
1 期首元本額	139,970,293,356円	86,862,860,040円
期中追加設定元本額	11,204,124,907円	3,352,142,213円
期中一部解約元本額	64,311,558,223円	31,385,689,703円
元本の内訳		
ファンド名		
AMC / ステート・ストリート・リスクバジェット型バランス・オープン（ステイブル）	1,256,992,275円	1,460,079,288円
日本債券インデックス・ファンド（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,923,162,539円	4,500,706,891円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	8,076,021円	8,409,125円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	115,223,071円	117,800,320円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	558,080円	585,042円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	4,456,764円	4,862,983円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	13,727,068円	12,667,257円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	12,147,684,211円	12,371,335,347円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	6,911,762円	4,870,076円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	3,752,423,134円	3,529,257,389円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	1,931,644,835円	1,950,361,713円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	11,592,305円	11,828,790円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	997,275,984円	921,029,476円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	6,359,165,654円	6,368,820,691円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	1,194,013,604円	1,068,933,542円

バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	4,662,335,855円	4,508,427,280円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	139,952,553円	134,931,572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＞	75,079,747円	74,120,166円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	56,600,225円	59,490,277円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	42,417,053円	45,411,832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＞	27,640,735,898円	—円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	42,663,703円	39,615,712円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	3,139,145,159円	3,091,366,885円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	13,146,832円	12,935,212円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	8,229,421円	2,807,022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＞	369,819,479円	337,436,402円
日本債券インデックス・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,538,595,538円	1,371,443,793円
4資産インデックスバランスVA20＜適格機関投資家限定＞	2,316,325,068円	2,348,608,845円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	8,211,332,584円	7,933,272,823円
4資産インデックスバランスVA50＜適格機関投資家限定＞	17,009,042円	28,945,341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＞	359,211,553円	376,650,517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＞	1,104,776,885円	1,471,800,531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＞	346,789,222円	359,527,027円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,666,450,167円	993,141,134円
ステート・ストリート国内債券インデックス・オープン（隔月分配型）	811,147円	2,145,312円
世界バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	17,510,761円	5,753,256円
世界バランス60VA＜適格機関投資家限定＞	9,020,589円	9,788,662円
グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	1,022,412円	1,091,529円
グローバルバランス40VA2＜適格機関投資家限定＞	3,274,354,492円	3,200,098,225円

グローバルバランス４０ＶＡ３＜適格 機関投資家限定＞	51,465,436円	50,843,339円
グローバルバランス５０ＶＡ＜適格機 関投資家限定＞	35,151,912円	38,111,926円
計	86,862,860,040円	58,829,312,550円
2 受益権の総数	86,862,860,040口	58,829,312,550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	（2024年2月20日現在）	（2024年8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。	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）

	（2024年2月20日現在）	（2024年8月20日現在）
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2204円 （12,204円）	1.2018円 （12,018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	(2024年2月20日現在)	(2024年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		4,074,092,376	3,884,637,682
金銭信託		26,232,609	13,935,793
コール・ローン		3,389,694,041	3,919,728,721
株式		256,434,914,393	276,307,528,761
投資証券		5,042,834,702	5,439,620,989
派生商品評価勘定		354,474,253	244,384,848
未収入金		47,900,186	77,939,081
未収配当金		227,801,729	307,615,126
未収利息		—	11,812
差入委託証拠金		785,510,593	1,132,555,345
流動資産合計		270,383,454,882	291,327,958,158
資産合計		270,383,454,882	291,327,958,158
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		488,957	10,167,628
未払解約金		96,116,060	73,923,000
未払利息		9,107	—
その他未払費用		1,977	—
流動負債合計		96,616,101	84,090,628
負債合計		96,616,101	84,090,628
純資産の部			
元本等			
元本	1	43,017,386,757	42,616,425,096
剰余金			
剰余金又は欠損金()		227,269,452,024	248,627,442,434
元本等合計		270,286,838,781	291,243,867,530
純資産合計		270,286,838,781	291,243,867,530
負債純資産合計		270,383,454,882	291,327,958,158

(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	（2024年2月20日現在）	（2024年8月20日現在）
1 期首元本額	45,434,848,844円	43,017,386,757円
期中追加設定元本額	3,084,782,535円	1,608,447,066円
期中一部解約元本額	5,502,244,622円	2,009,408,727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	4,902,195,317円	4,738,008,433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	6,134,045,367円	5,973,567,440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	91,383,905円	85,392,047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）	41,989,511円	41,989,511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）	55,523,463円	54,805,316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）	18,104,991円	14,596,791円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	341,926円	289,999円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	10,336,078円	8,400,440円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	37,742円	33,476円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	621,187円	546,722円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	1,328,585円	1,094,300円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	2,511,960,322円	2,171,347,164円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	620,494円	362,614円
バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	185,717,110円	149,881,078円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	231,542,261円	196,491,849円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	19,047,532円	16,268,509円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	49,514,428円	39,974,003円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	864,100,268円	742,630,458円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	101,927,155円	77,952,069円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	403,907,553円	334,483,733円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	18,507,195円	15,622,919円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	11,498,815円	10,264,851円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	17,608,078円	15,705,533円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	5,554,045円	4,488,395円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	83,717,311円	69,303,978円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	215,623円	165,881円

バランスファンドV A 3 5 B < 適格機関投資家限定 >	345,441円	96,752円
外国株式インデックス・ファンドV A 3 < 適格機関投資家限定 >	196,460,408円	153,040,318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 >	79,457,078円	66,730,751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 >	15,616,424円	23,657,737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 >	14,610,590円	13,409,659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 >	13,520,577円	11,905,612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	255,901,784円	206,342,938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）	1,384,925,665円	1,336,009,470円
全世界株式インデックス・ファンド	2,565,952,981円	2,839,673,647円
ステート・ストリート・グローバル株式インデックス・オープン	170,851円	1,935,457円
ステート・ストリート全世界株式インデックス・オープン	143,854円	1,328,463円
世界バランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	4,285,653円	1,253,209円
世界バランス6 0 V A < 適格機関投資家限定 >	6,102,896円	5,627,036円
グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	248,375円	225,355円
グローバルバランス4 0 V A 2 < 適格機関投資家限定 >	499,346,335円	418,983,498円
グローバルバランス4 0 V A 3 < 適格機関投資家限定 >	12,380,747円	10,358,630円
グローバルバランス5 0 V A < 適格機関投資家限定 >	9,558,261円	8,647,774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 >	22,197,012,575円	22,753,531,281円
計	43,017,386,757円	42,616,425,096円
2 受益権の総数	43,017,386,757口	42,616,425,096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	（2024年2月20日現在）	（2024年8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。	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 「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。	(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。 「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	（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	株価指数先物取引 買建				
	MINI S&P 500	6,349,933,038	—	6,605,112,536	255,179,498
	S&P 60	337,107,604	—	343,255,333	6,147,729
	SPI 200	294,308,361	—	298,872,672	4,564,311
	FTSE100INDEX	346,046,077	—	349,962,696	3,916,619
	FSMI INDEX	228,275,005	—	231,410,412	3,135,407
	EURO STOXX 50	888,871,182	—	920,568,980	31,697,798
合 計		8,444,541,267	—	8,749,182,629	304,641,362

（単位：円）

区 分	種 類	（2024年8月20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	7,190,495,070	—	7,338,170,150	147,675,080
	S&P 60	367,681,233	—	387,529,272	19,848,039
	SPI 200	268,771,823	—	273,255,578	4,483,755
	FTSE100INDEX	453,655,787	—	462,702,627	9,046,840
	FSMI INDEX	266,903,263	—	271,473,647	4,570,384
	EURO STOXX 50	881,575,779	—	881,002,449	573,330
	合 計	9,429,082,955	—	9,614,133,723	185,050,768

(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	（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	2,750,611,725	—	2,791,189,213	40,577,488
	カナダ・ドル	111,925,995	—	113,335,974	1,409,979
	オーストラリア・ドル	67,359,632	—	68,600,210	1,240,578
	イギリス・ポンド	151,059,015	—	152,942,823	1,883,808
	ユーロ	332,447,279	—	336,971,445	4,524,166
	売建				
	アメリカ・ドル	11,996,800	—	12,028,536	31,736
	カナダ・ドル	7,749,000	—	7,777,959	28,959
	ユーロ	43,405,200	—	43,636,590	231,390
	合 計	3,476,554,646	—	3,526,482,750	49,343,934

（単位：円）

区 分	種 類	（2024年8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	3,680,009,618	—	3,710,176,047	30,166,429
	カナダ・ドル	132,509,628	—	136,004,681	3,495,053
	オーストラリア・ドル	81,772,918	—	85,430,346	3,657,428
	イギリス・ポンド	181,355,958	—	185,744,496	4,388,538
	ユーロ	417,404,269	—	426,643,319	9,239,050
	売建				
	アメリカ・ドル	225,947,184	—	224,722,344	1,224,840
	カナダ・ドル	19,221,192	—	19,276,254	55,062
	オーストラリア・ドル	33,928,560	—	35,350,488	1,421,928
	イギリス・ポンド	50,211,055	—	51,174,504	963,449
	ユーロ	65,814,430	—	66,378,877	564,447
	合 計	4,888,174,812	—	4,940,901,356	49,166,452

(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)

	(2024年2月20日現在)	(2024年8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.2832円 (62,832円)	6.8341円 (68,341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	(2024年2月20日現在)	(2024年8月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		456,460,285	1,249,490,134
金銭信託		625,559	284,022
コール・ローン		80,832,760	79,886,905
国債証券		92,206,308,892	87,030,210,711

派生商品評価勘定		47,940	416,550
未収利息		677,680,675	566,525,308
前払費用		35,779,517	33,440,496
流動資産合計		93,457,735,628	88,960,254,126
資産合計		93,457,735,628	88,960,254,126
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		—	728,060
未払金		211,471,183	679,362,927
未払解約金		17,668,896	78,999,302
未払利息		217	—
その他未払費用		219	—
流動負債合計		229,140,515	759,090,289
負債合計		229,140,515	759,090,289
純資産の部			
元本等			
元本	1	32,087,499,983	29,689,583,285
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		61,141,095,130	58,511,580,552
元本等合計		93,228,595,113	88,201,163,837
純資産合計		93,228,595,113	88,201,163,837
負債純資産合計		93,457,735,628	88,960,254,126

（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	（2024年2月20日現在）	（2024年8月20日現在）
1 期首元本額	39,505,032,684円	32,087,499,983円
期中追加設定元本額	3,568,386,896円	2,022,121,249円
期中一部解約元本額	10,985,919,597円	4,420,037,947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	6,389,947,798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	30,588,884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	861,925,997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	1,702,333,633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	453,959,921円
バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	1,365,542円	1,337,975円
バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	49,349,187円	45,858,214円
バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	79,545円	77,986円
バランスファンドVA40B＜適格機関投資家限定＞	1,907,466円	1,904,178円
バランスファンドVA50A＜適格機関投資家限定＞	1,436,172円	1,276,611円
バランスファンドVA50B＜適格機関投資家限定＞	5,226,113,526円	5,020,054,165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	56,043,824円
バランスファンドVA50C＜適格機関投資家限定＞	1,259,139円	840,104円

バランスファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,389,443,841円	1,224,072,434円
バランスファンドVA37.5A＜適格機関投資家限定＞	901,135,728円	846,918,013円
バランスファンドVA75A＜適格機関投資家限定＞	19,758,715円	18,315,977円
4資産バランス20VA＜適格機関投資家限定＞	422,909,834円	365,102,926円
4資産バランス40VA＜適格機関投資家限定＞	2,726,042,591円	2,549,066,217円
4資産バランス30VA＜適格機関投資家限定＞	508,872,030円	419,330,509円
バランスファンドVA35A＜適格機関投資家限定＞	1,718,423,064円	1,558,007,959円
バランスファンドVA40C＜適格機関投資家限定＞	59,284,371円	54,513,339円
グローバル4資産30VA＜適格機関投資家限定＞	60,485,928円	58,715,453円
グローバル4資産45VA＜適格機関投資家限定＞	48,955,179円	47,838,494円
4資産バランス30VA2＜適格機関投資家限定＞	23,931,189円	20,640,276円
バランスファンドVA25B＜適格機関投資家限定＞	409,339,503円	375,878,728円
バランスファンドVA20A＜適格機関投資家限定＞	1,291,345円	1,164,308円
バランスファンドVA35B＜適格機関投資家限定＞	1,051,916円	333,639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	547,317,319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	611,172,487円
世界分散ファンドVA25A＜適格機関投資家限定＞	1,073,298,832円	956,173,847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	167,525,819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	45,483,820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	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	354,695,532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	164,883,050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	156,533,643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（為替ヘッジあり）	2,341,135,762円	2,207,270,480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	1,499,001,652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	6,349,896円
世界バランス４０％＜適格機関投資家限定＞	10,472,898円	3,259,954円
世界バランス６０％＜適格機関投資家限定＞	6,432,090円	6,414,901円
グローバルバランス４０％＜適格機関投資家限定＞	608,168円	600,564円
グローバルバランス４０％Ａ２＜適格機関投資家限定＞	691,277,057円	636,904,108円
グローバルバランス４０％Ａ３＜適格機関投資家限定＞	30,445,613円	27,622,220円
グローバルバランス５０％＜適格機関投資家限定＞	9,971,451円	9,907,974円
計	32,087,499,983円	29,689,583,285円
2 受益権の総数	32,087,499,983口	29,689,583,285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	（2024年2月20日現在）	（2024年8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。	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	（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

（単位：円）

区 分	種 類	（2024年8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	73,940,000	—	73,214,050	725,950
	売建 アメリカ・ドル	14,638,500	—	14,640,610	2,110
	ユーロ	81,563,000	—	81,146,450	416,550
	合 計	170,141,500	—	169,001,110	311,510

（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）

	（ 2024年2月20日現在 ）	（ 2024年8月20日現在 ）
1口当たり純資産額	2.9054円	2.9708円
（ 1万口当たり純資産額 ）	（ 29,054円 ）	（ 29,708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。

2024年8月末現在、委託会社の運用する証券投資信託は、125本であり、その純資産総額は3,566,574百万円です（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必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（2023年4月1日から2024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 (2023年3月31日現在)			当事業年度 (2024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		4,944,755			4,234,566	
有価証券		24,319			-	
前払金		232,900			102,444	
前払費用		34,419			41,233	
未収入金		615,211			1,032,848	
未収委託者報酬		665,966			749,873	
未収収益		36,568			27,066	
流動資産計		6,554,141	80.5		6,188,032	81.2
固定資産						
有形固定資産		112			0	
建物附属設備	1	0			0	
器具備品	1	112			0	
無形固定資産		0			0	
ソフトウェア		0			0	
投資その他の資産		1,586,165			1,432,737	
投資有価証券		-			39,012	
長期差入保証金		42,548			48,833	
繰延税金資産		1,537,341			1,338,616	
その他投資		6,275			6,275	
固定資産計		1,586,278	19.5		1,432,737	18.8
資産合計		8,140,419	100.0		7,620,770	100.0

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 (2023年3月31日現在)			当事業年度 (2024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		211,213			188,612	
未払金		341,855			339,082	
未払手数料	180,016			221,226		
その他未払金	161,839			117,856		
未払費用		12,884			13,751	
未払法人税等		176,932			45,960	
未払消費税等		25,106			59,410	
賞与引当金		92,579			125,008	
流動負債計		860,572	10.6		771,826	10.1
固定負債						
退職給付引当金		76,260			62,307	
固定負債計		76,260	0.9		62,307	0.8
負債合計		936,833	11.5		834,133	10.9
(純資産の部)			%			%

株主資本		7,203,586	88.5		6,778,287	88.9
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	6,784,466			6,359,167		
評価・換算差額等					8,348	0.1
その他有価証券評価差額金				8,348		
純資産合計		7,203,586	88.5		6,786,636	89.1
負債・純資産合計		8,140,419	100.0		7,620,770	100.0

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

期 別 科 目	前事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日		当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,681,106		2,891,198	
投資顧問収入	2,805,885		2,862,987	
その他営業収益	12,640		102,972	
営業収益計	5,499,631	100.0	5,857,158	100.0
営業費用				
支払手数料	753,876		906,480	
広告宣伝費	51,264		21,264	
公告費	1,140		-	
調査費	654,933		720,300	
調査費	337,268		396,650	
委託調査費	317,181		323,202	
図書費	483		446	
委託計算費	387,357		207,395	
営業雑経費	44,076		55,720	
通信費	6,765		8,017	
印刷費	14,575		26,511	
協会費	17,758		15,992	
諸会費	7		83	
その他	4,968		5,114	
営業費用計	1,892,648	34.4	1,911,160	32.6
一般管理費				
給料	1,475,040		1,332,279	
役員報酬	251,291		154,418	
給料・手当	816,610		805,664	
賞与	330,579		289,236	
賞与引当金繰入額	76,559		82,960	
交際費	3,676		2,358	
旅費交通費	10,847		11,678	
租税公課	3,770		29,533	
不動産賃借料	64,855		72,193	
退職給付費用	61,481		61,309	

固定資産減価償却費		765			428	
福利厚生費		139,590			144,113	
諸経費		192,029			161,722	
一般管理費計		1,952,057	35.5		1,815,616	31.0
営業利益		1,654,925	30.1		2,130,381	36.4
営業外収益						
移転価格調整金	1、2	131,841			-	
為替差益		1,707			1,186	
有価証券運用益		2,727			1,258	
雑収入		106			61	
営業外収益計		136,383	2.5		2,505	0.0
営業外費用						
移転価格調整金	1	-			996,646	
為替差損		1,046			2,193	
雑損失		73			3,349	
営業外費用計		1,119	0.0		1,002,189	17.1
経常利益		1,790,188	32.6		1,130,697	19.3
特別損失						
事務処理損失		4,303			814	
特別損失計		4,303	0.1		814	0.0
税引前当期純利益		1,785,884	32.5		1,129,883	19.3
法人税,住民税及び事業税		324,907	5.9		189,140	3.2
法人税等調整額		288,994	5.3		195,041	3.3
当期純利益		1,171,982	21.3		745,701	12.7

（３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：千円）

前事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）										（単位：千円）
	株 主 資 本					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		
		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	6,450,484	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	

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：千円）

当期末残高	310,000	77,500	31,620	6,359,167	6,468,287	6,778,287	8,348	8,348	6,786,636
-------	---------	--------	--------	-----------	-----------	-----------	-------	-------	-----------

[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 その他有価証券 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 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。

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 1,338,616千円

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 (2023年3月31日現在)	当事業年度 (2024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 30,661千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 器 具 備 品 29,386千円
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 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024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。	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102,739千円は、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996,646千円は、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。
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	2. 関係会社に係る注記 関係会社との取引高 営業外費用 996,646千円

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（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

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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
2023年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,171,000千円	188,870.96円	2023年3月31日	2023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
2024年6月27日 定時株主総会	普通株式	745,000千円	利益剰余金	120,161.29円	2024年3月31日	2024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

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。

2024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）
投資有価証券	39,012	39,012	-
資産計	39,012	39,012	-

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

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。

2024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
投資有価証券	-	39,012	-	39,012
その他有価証券		39,012		39,012
資産計	-	39,012	-	39,012

（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）

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

2024年3月31日現在

その他有価証券

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託	39,012千円	26,980千円	12,032千円
小計	39,012千円	26,980千円	12,032千円
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	39,012千円	26,980千円	12,032千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024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 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
2011年4月1日に複数事業主制度の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。 なお、複数事業主制度の確定給付企業年金制度は自社の拠出に対応する年金資産の額を合理的に算定できることから、確定給付制度の注記に含めて記載しております。	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 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

(単位：千円)

	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
退職給付債務の期首残高	483,396

勤務費用	51,371
利息費用	-
数理計算上の差異の発生額	20,319
退職給付の支払額	<u>66,566</u>
退職給付債務の期末残高	488,520

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 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	<u>37,376</u>
年金資産の期末残高	416,191

(単位：千円)

	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
年金資産の期首残高	416,191
期待運用収益	3,083
数理計算上の差異の発生額	3,224
事業主からの拠出額	53,186
退職給付の支払額	<u>66,566</u>
年金資産の期末残高	402,670

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 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	<u>416,191</u>
	67,205
非積立型制度の退職給付債務	<u>-</u>
未積立退職給付債務	67,205
未認識数理計算上の差異	9,055
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	<u>76,260</u>

(単位：千円)

	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
積立型制度の退職給付債務	488,520
年金資産	402,670
	85,850
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	85,850
未認識数理計算上の差異	23,543
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	62,307

５．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 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	43,071
(1)勤務費用	53,150
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	2,979
(4)数理計算上の差異の費用処理額	7,098

(単位：千円)

	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
確定給付制度に係る退職給付費用	39,232
(1)勤務費用	51,371
(2)利息費用	-
(3)期待運用収益	3,083
(4)数理計算上の差異の費用処理額	9,055

６．年金資産に関する事項

前事業年度（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。

当事業年度（2024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 (2023年3月31日現在)
(1)割引率	0.00%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)予想昇給率	5.80%
(4)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(5)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(6)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (2024年3月31日現在)
(1)割引率	0.00%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)予想昇給率	5.80%
(4)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(5)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(6)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 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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は22,077千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 2022年4月 1日	自 2023年4月 1日
至 2023年3月31日	至 2024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 22,144	賞与引当金繰入超過額 27,942
退職給付引当金 25,052	退職給付引当金 20,778
(注) 繰越欠損金 1,453,659	(注) 繰越欠損金 1,267,265
その他 36,485	その他 26,314
繰延税金資産 合計 1,537,341	繰延税金資産 合計 1,342,300
繰延税金負債との相殺 -	
繰延税金資産の純額 1,537,341	繰延税金負債
	その他有価証券評価差額金 3,684
	繰延税金資産の純額 1,338,616

(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（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。

当事業年度（2024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)	-	137,227	157,331	-	366,561	606,144	1,267,265
繰延税金資産	-	137,227	157,331	-	366,561	606,144	(*2)1,267,265

(*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1,267,265千円（法定実効税率を乗じた金額）について、繰延税金資産1,267,265千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（2023年3月31日現在）	当事業年度（2024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>3.1%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.6%</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>34.3%</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	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%		=====	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>2.8%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.6%</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>34.0%</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	2.8%	その他	0.6%			税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.0%		=====
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	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	2.8%																								
その他	0.6%																								
税効果会計適用後の 法人税等の負担率	34.0%																								
	=====																								

（資産除去債務関係）

前事業年度（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、397千円増加しました。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス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15,059千円であります。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。

（収益認識関係）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2023年4月1日 至 2024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

当会計期間の収益の構成は次のとおりです。

委託者報酬	2,891,198千円
投資顧問収入	2,862,987千円
その他営業収益	102,972千円
合計	5,857,158千円

(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。

（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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

前事業年度											
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		取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・オブ・ニューヨーク・シティ	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払	295,434	前払金	3,388
								投資顧問料の支払	232,843		
								人件費等の支払	175,762	未払金	24,509
								事務手数料の受取	12,389		
								移転価格調整金の支払	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 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託	39,303	前払金	229,512
								人件費等の支払	127,670		
	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	19,754	-	-
	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 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024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		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・アメリカ・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ ソフトウェアの使用契約 人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払	349,158	前払金	3,388
								投資顧問料の支払	233,443		
								人件費等の支払	112,526	未払金	33,312
								事務手数料の受取 移転価格調整金の支払	102,739 996,646		
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託	39,191	前払金	99,056
								人件費等の支払	45,719		
	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	23,532	-	-
	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	233	-	-
								投資顧問料の支払	22,463		

(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 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
1株当たり純資産 1,161,868円75銭	1株当たり純資産 1,094,618円75銭
1株当たり当期純利益 189,029円36銭	1株当たり当期純利益 120,274円44銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日	当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024年3月31日
当期純利益（千円）	1,171,982	745,701
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）	1,171,982	745,701
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 2022年4月 1日 至 2023年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 2023年4月 1日 至 2024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

2024年6月18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2024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。
- ・ 財務諸表に対する意見を表明するために、財務諸表に含まれる構成単位の財務情報に関する十分かつ適切な監査証拠を入手する。監査人は、構成単位の財務情報に関する監査の指示、監督及び実施に関して責任がある。監査人は、単独で監査意見に対して責任を負う。

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）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

2024年11月1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

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2024年2月21日から2024年8月20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2024年8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中間計算期間（2024年2月21日から2024年8月20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。