

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成23年8月30日
【発行者名】	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ 株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 山本 幸次
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	太田 裕之
【電話番号】	03-4530-7093
【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DC外国株式 インデックス・オープン
【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】	継続募集額 1兆円を上限とします。
【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理由】

平成23年2月28日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」という。）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】

原届出書の下記事項については、それぞれ下記の内容に原届出書が訂正されます。

### 第一部【証券情報】

#### （2）【内国投資信託受益証券の形態等】

##### <訂正前>

追加型株式投資信託振替受益権（契約型）（以下「受益権」といいます。）

当ファンドは格付けを取得しておりません。

##### <訂正後>

追加型株式投資信託振替受益権（契約型）（以下「受益権」といいます。）

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供もしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

本ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### 第二部【ファンド情報】

#### 第1【ファンドの状況】

##### （1）【ファンドの目的および基本的性格】

##### <訂正前>

ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式を投資対象とした「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的に日本を除く世界の主要国の株式市場(MSCIコクサイ指数)の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

MSCIコクサイ指数とは、世界主要先進国の日本を除く23ヶ国（2011年1月現在）を投資対象国として、MSCI Inc.が開発した株価指数です。なお、この投資対象国に関しては定期的な見直しにより変更されることがあります。

（略）

##### <訂正後>

ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式を投資対象とした「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的に日本を除く世界の主要国の株式市場(MSCIコクサイ指数)の動きに連動した投資成果の獲得をめざして運用を行う事を基本とします。

MSCIコクサイ指数とは、世界主要先進国の日本を除く23ヶ国（2011年6月末現在）を投資対象国として、MSCI Inc.が開発した株価指数です。なお、この投資対象国に関しては定期的な見直しにより変更されることがあります。

（略）

##### （3）【ファンドの仕組み】

##### <訂正前>

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行い、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の主要国の株式市場に投資します。「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの収益はすべてベビーファンドに還元されます。

（略）

委託会社の概況（平成23年1月31日現在）

（略）

### 3）大株主の状況

（平成23年1月31日現在）

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
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・インク	アメリカ合衆国デラウェア州 ウィルミントン センターヴィル・ロード 2711	6,200株	100%

<訂正後>

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行い、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界の主要国の株式市場に投資します。「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。

（略）

委託会社の概況（平成23年6月30日現在）

（略）

### 3）大株主の状況

（平成23年6月30日現在）

氏名又は名称	住所	所有株式数	所有比率
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・インク	アメリカ合衆国デラウェア州 ウィルミントン センターヴィル・ロード 2711	6,200株	100%

## 2【投資方針】

### (3)【運用体制】

<訂正前>

委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル/プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関する運用担当者と意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、委託会社の投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、運用部長、各運用戦略責任者、業務管理部の運用評価グループ責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、全ファンドの毎月末のポートフォリオ構成、パフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略の受託資産間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。運用担当者は、投資戦略別に毎月の投資行動を報告した上で、ガイドラインからの乖離やパフォーマンスの格差、発注取引先の集中等が生じている場合には、その理由及び顧客への説明状況について報告します。

<訂正後>

委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル/プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関わ

運用担当者と意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、委託会社の投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

### 3【投資リスク】

#### (1)ファンドのリスク特性

##### <訂正前>

当ファンドは、マザーファンド等への投資を通じて日本を除く世界の主要国の株式に分散投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合がありますので、受益権のお申込者はこの点を充分にご理解頂いたうえ、当ファンドの受益権へのお申込みを行ってください。なお、当ファンドは、金融機関の預金とは異なり、元本が保証されている商品ではなく、信託財産に生じた利益および損失は、すべて当ファンドの受益者に帰属します。

##### 価格変動リスク

当ファンドは、マザーファンド等への投資を通じて株式に投資を行います。株価は、個々の企業の活動や一般的な市場・経済の状況に反応して変動します。したがって、当ファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落していく可能性があります。当ファンドは、原則として株式の組入率について高位を維持しますので、基準価額は組み入れた株式の価格変動によって大きく変動することがあります。また、組み入れた株式等有価証券の価格変動によっては、損失を被ることがあります。

##### 投資対象国への投資リスク

当ファンドは主にマザーファンド等への投資を通じて有価証券への投資を行います。投資対象国における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送付金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

##### 為替リスク

当ファンドは、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替相場の変動により基準価額が影響を受けます。

##### 信用リスク

当ファンドは、マザーファンドへの投資を通じて組み入れた株式等の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、損失を被ることがあります。また、当ファンドの資産をコール・ローン、譲渡性預金等の短期金融商品で運用する場合（マザーファンドへの投資を通じて実質的に運用する場合を含む）、債務不履行などにより損失が発生することがあります。運用資産の規模等によっては、当ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。

##### 解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動のリスク

解約資金を手当てするために保有有価証券を大量に売却しなければならないことがあります。その際には、市況動向や取引量等の状況によって基準価額が大きく変動する可能性があります。

##### <訂正後>

当ファンドは、主にマザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界主要国の株式に分散投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合がありますので、受益権のお申込者はこの点を充分にご理解頂いたうえ、当ファンドの受益権へのお申込みを行って下さい。なお、当ファンドは、金融機関の預金とは異なり、元本が保証されている商品ではなく、信託財産に生じた利益および損失は、すべて当ファンドの受益者に帰属します。

##### 株価変動リスク

当ファンドは、日本を除く世界主要国の株式を実質的な主要投資対象としていることから、株式の投資に係る価格変動リスクを伴います。一般に、株式の価格は、個々の企業の活動および業績、

経営方針、ならびに法令順守の状況等に反応して変動するほか、投資対象国の経済情勢および景気見通し、ならびに金利変動、為替相場およびそれらの見通し等にも反応して変動します。従って、マザーファンドに組み入れられる株式の価格は短期的または長期的に下落する可能性があります。

#### 信用リスク

当ファンドは、日本を除く世界主要国の株式を実質的な主要投資対象としていることから、世界主要国の株式の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により損失を被ることがあります。また、金融商品取引の相手方や受託者の決済不履行または債務不履行等により損失を被ることがあります。

#### 為替変動リスク

当ファンドの実質的な主要投資対象である日本を除く世界主要国の株式は外貨建資産であるため、当ファンドの基準価額は為替変動の影響を受けまず一般に、主な為替相場の変動要因としては、金利変動、中央銀行等による政策金利の変更または為替介入、政治的要因等があります。

#### 流動性リスク

投資対象となる有価証券の市場規模や取引量が少ない状況や解約資金を手当てするために実質的に保有する有価証券を大量に売却しなければならない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

また、解約資金の手当てが間に合わず、売却した有価証券等の売却代金回収までの期間、一時的に当ファンドで資金借入を行うことにより解約金の支払いに対応する場合があります。その場合の借入金利は当ファンドが負担することになります。

#### 投資対象国への投資リスク

当ファンドが実質的に保有する有価証券の発行国（投資対象国）における政治不安や社会不安、あるいは他国との外交関係の悪化などの要因により、投資成果に大きく影響することがあります。また、投資対象国の政府当局による、海外からの投資規制や課徴的な税制、海外からの送金規制などの様々な規制の導入や政策変更等により、投資対象国の有価証券への投資に悪影響が及ぶ可能性があります。

#### デリバティブ取引のリスク

先物・スワップ取引等のデリバティブ取引を用いた投資手法は運用の効率を高めるため、または証券価格、市場金利、為替等の変動による当ファンドおよびマザーファンドへの影響を低減するために用いられますが、デリバティブ取引は必ず用いられるわけではなく、また用いられたとしても本来の目的を達成できる保証はありません。

#### パッシブ運用のリスク

当ファンドはパッシブ運用を採用しています。パッシブ運用とは、ベンチマーク（参考指数）とするインデックスと連動する投資成果を目指す運用手法であり、ファンド・マネジャーが経済情勢、市場分析等に基づき個別銘柄の売買を行うことによりインデックスを上回る投資成果を目指すアクティブ運用とは異なります。

当ファンドは、投資成果をインデックスにできるだけ連動させるため、原則としてポートフォリオにおける時価構成をインデックスにおける銘柄別時価構成比に近づけるように投資対象銘柄の売買を行います。ただし、インデックス採用銘柄の変更や資本異動等によりポートフォリオの調整が行われる場合等、個別銘柄の売買等にあたりマーケット・インパクトを受ける可能性があるため、基準価額の変動率がインデックスの変動率に一致せず、ファンドの投資成果がインデックスの投資成果に連動しない場合があります。また、インデックス採用銘柄の売買停止等の理由により当該銘柄に投資できない場合、インデックスの投資成果に連動させるため、インデックス採用銘柄以外の銘柄に投資する場合があります。

#### ファミリーファンド方式のリスク

当ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のファンド（ベビーファンド）に追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて有価証券の売買等が行われた場合等には、その売買による組入有価証券等の価格の変化や売買手数料等の負担がマザーファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあり、これにより、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。



## 5【運用状況】（下記の内容に更新されます。）

## (1)【投資状況】

(平成23年6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	5,628,576,980	99.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		682,136	0.01
純資産総額		5,629,259,116	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## &lt;参考情報&gt;

親投資信託受益証券(ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド)

(平成23年6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	76,450,389,912	51.41
	イギリス	14,913,520,077	10.03
	カナダ	8,343,667,344	5.61
	フランス	7,191,009,770	4.84
	ドイツ	6,425,928,852	4.32
	スイス	5,997,595,054	4.03
	オーストラリア	5,724,684,706	3.85
	スペイン	2,526,263,428	1.70
	スウェーデン	2,222,071,535	1.50
	イタリア	1,942,005,894	1.31
	香港	1,886,722,872	1.27
	オランダ	1,760,651,906	1.18
	シンガポール	1,173,997,360	0.79
	デンマーク	745,730,878	0.50
	ベルギー	688,174,022	0.46
	フィンランド	686,511,029	0.46
	ノルウェー	648,432,341	0.44
	イスラエル	507,237,846	0.34
	オーストリア	241,031,430	0.16
	ポルトガル	184,153,560	0.12
	アイルランド	169,618,085	0.11
ギリシャ	159,519,536	0.11	
ニュージーランド	86,051,107	0.06	
小計		140,674,968,544	94.60
投資証券	アメリカ	1,521,827,541	1.02
	オーストラリア	379,413,475	0.26
	フランス	210,074,963	0.14
	イギリス	198,463,513	0.13
	香港	48,181,612	0.03
	シンガポール	34,030,970	0.02
	オランダ	24,276,162	0.02

	カナダ	21,470,266	0.02
	小計	2,437,738,502	1.64
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		5,593,175,412	3.76
純資産総額		148,705,882,458	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

## （２）【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

（平成23年6月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	日本	親投資信託受益証券	ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド		5,727,665,595	0.9203	5,271,432,711	0.9827	5,628,576,980	99.99
投資比率：合計										
99.99										

（注1）投資有価証券は1銘柄です。

（注2）投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

### 種類別及び業種別投資比率

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

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

### 【投資不動産物件】

該当する事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当する事項はありません。

## < 参考情報 >

親投資信託受益証券（ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成23年6月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	384,800	5,651	2,174,543,280	6,479	2,492,958,546	1.68
2	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	71,508	25,704	1,838,014,795	26,967	1,928,359,754	1.30
3	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	268,880	5,388	1,448,819,548	5,020	1,349,710,380	0.91
4	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・サービス	94,661	11,593	1,097,388,691	13,768	1,303,263,700	0.88
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	155,800	6,667	1,038,669,273	8,176	1,273,872,899	0.86
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	823,939	1,304	1,074,243,016	1,498	1,234,548,011	0.83
7	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	586,783	2,047	1,200,854,636	2,068	1,213,644,804	0.82
8	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービス	458,716	2,237	1,026,160,673	2,524	1,157,624,780	0.78
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	212,220	4,991	1,059,132,423	5,353	1,136,057,440	0.76
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	217,279	5,016	1,089,818,208	5,050	1,097,185,401	0.74
11	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,373,921	846	1,162,564,687	795	1,091,954,929	0.73



12	アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	620,395	1,347	835,409,265	1,669	1,035,246,374	0.70
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	309,074	3,090	955,043,337	3,266	1,009,289,955	0.68
14	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	249,162	3,748	933,977,403	3,731	929,668,395	0.63
15	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	181,064	5,231	947,077,854	4,903	887,820,164	0.60
16	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	388,751	2,215	861,173,344	2,266	880,945,181	0.59
17	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	160,235	5,118	820,127,916	5,385	862,945,320	0.58
18	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	4,017,190	206	828,947,959	215	862,314,418	0.58
19	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,458,465	558	813,902,227	583	850,527,826	0.57
20	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	313,523	2,217	695,032,145	2,618	820,826,383	0.55
21	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	276,369	2,540	701,920,493	2,820	779,393,578	0.52
22	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	19,350	47,066	910,719,166	40,169	777,266,785	0.52
23	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	225,436	3,399	766,196,772	3,350	755,277,103	0.51
24	フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	164,046	4,365	716,084,150	4,570	749,722,471	0.50
25	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タバコ	139,433	4,675	651,859,634	5,342	744,837,714	0.50
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING AG GENUSS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	54,501	13,430	731,929,354	13,580	740,123,580	0.50
27	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	425,787	1,721	732,849,085	1,727	735,255,250	0.49
28	アメリカ	株式	SCHLUMBERGER LTD	エネルギー	105,587	6,260	660,953,946	6,879	726,333,321	0.49
29	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	786,148	924	726,682,586	899	707,008,210	0.48
30	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	123,514	5,168	638,261,966	5,648	697,591,113	0.47
									投資比率：合計	20.75

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成23年6月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	エネルギー	11.82
	素材	7.90
	資本財	7.64
	銀行	7.64
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.27
	食品・飲料・タバコ	6.20
	ソフトウェア・サービス	5.09
	各種金融	5.03
	保険	4.05
	電気通信サービス	3.98
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.90
	公益事業	3.67
	ヘルスケア機器・サービス	2.61
	メディア	2.56
	小売	2.46
	食品・生活必需品小売り	2.21

	運輸	1.75
	家庭用品・パーソナル用品	1.60
	消費者サービス	1.54
	半導体・半導体製造装置	1.53
	自動車・自動車部品	1.50
	耐久消費財・アパレル	1.19
	商業・専門サービス	0.78
	不動産	0.68
	小計	94.60
投資証券		1.64
	合計	96.24

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

(注2) 平成23年6月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

#### 投資不動産物件

該当する事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所等	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500	シカゴ商業取引所	買建	アメリカ・ドル	108	34,323,975.00	35,216,100.00	2,842,995,753	1.91
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	259	7,175,120.00	7,262,360.00	848,534,142	0.57
	FTSE100INDEX	ロンドン国際金融先物 オプション取引所	買建	イギリス・ポ ンド	85	4,895,904.56	4,953,800.00	642,904,164	0.43
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	29	4,312,044.99	4,388,280.00	365,894,786	0.25
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリ ア・ドル	29	3,306,249.99	3,276,275.00	283,299,499	0.19
	FSMI INDEX	ユーレックス・チュー リッヒ取引所	買建	スイス・フラン	45	2,801,409.99	2,745,900.00	266,352,300	0.18

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該取引の評価金額（平成23年6月30日のわが国の対顧客電信  
売買相場の仲値により邦貨換算しています）の比率です。

(注2) 先物取引の残高は、契約額ベースで表示しています。

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

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

平成23年6月30日現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの 純資産額（円）	
第1期	（平成14年12月 2日）	分配付：	80,455,957	分配付：	0.7942
		分配落：	80,455,957	分配落：	0.7942
第2期	（平成15年12月 1日）	分配付：	287,821,863	分配付：	0.8313
		分配落：	287,821,863	分配落：	0.8313
第3期	（平成16年11月30日）	分配付：	649,202,421	分配付：	0.9062
		分配落：	649,202,421	分配落：	0.9062

第4期	(平成17年11月30日)	分配付：1,403,203,335 分配落：1,403,203,335	分配付：1.1486 分配落：1.1486
第5期	(平成18年11月30日)	分配付：2,290,759,537 分配落：2,290,759,537	分配付：1.3350 分配落：1.3350
第6期	(平成19年11月30日)	分配付：3,608,807,418 分配落：3,608,807,418	分配付：1.4219 分配落：1.4219
第7期	(平成20年12月 1日)	分配付：2,228,712,465 分配落：2,228,712,465	分配付：0.6899 分配落：0.6899
第8期	(平成21年11月30日)	分配付：3,638,455,414 分配落：3,638,455,414	分配付：0.8381 分配落：0.8381
第9期	(平成22年11月30日)	分配付：4,721,261,763 分配落：4,721,261,763	分配付：0.8616 分配落：0.8616
平成22年 6月末日		4,022,613,881	0.7785
7月末日		4,356,634,971	0.8266
8月末日		4,101,934,931	0.7728
9月末日		4,541,367,019	0.8441
10月末日		4,587,470,602	0.8431
11月末日		4,721,261,763	0.8616
12月末日		4,942,156,808	0.8894
平成23年 1月末日		5,184,993,214	0.9103
2月末日		5,358,314,630	0.9347
3月末日		5,561,070,412	0.9600
4月末日		5,762,099,617	0.9829
5月末日		5,631,063,489	0.9439
6月末日		5,629,259,116	0.9221

## 【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第1期	(平成14年12月 2日)	0.0000円
第2期	(平成15年12月 1日)	0.0000円
第3期	(平成16年11月30日)	0.0000円
第4期	(平成17年11月30日)	0.0000円
第5期	(平成18年11月30日)	0.0000円
第6期	(平成19年11月30日)	0.0000円
第7期	(平成20年12月 1日)	0.0000円
第8期	(平成21年11月30日)	0.0000円
第9期	(平成22年11月30日)	0.0000円

## 【収益率の推移】

計算期間		収益率
第1期	自平成14年 1月31日 至平成14年12月 2日	20.6%
第2期	自平成14年12月 3日 至平成15年12月 1日	4.7%

第3期	自平成15年12月 2日 至平成16年11月30日	9.0%
第4期	自平成16年12月 1日 至平成17年11月30日	26.7%
第5期	自平成17年12月 1日 至平成18年11月30日	16.2%
第6期	自平成18年12月 1日 至平成19年11月30日	6.5%
第7期	自平成19年12月 1日 至平成20年12月 1日	51.5%
第8期	自平成20年12月 2日 至平成21年11月30日	21.5%
第9期	自平成21年12月 1日 至平成22年11月30日	2.8%
	自平成22年12月 1日 至平成23年 6月30日	7.0%

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

計算期間		設定口数（口）	解約口数（口）	発行済口数（口）
第1期	自平成14年 1月31日 至平成14年12月 2日	101,641,140	337,866	101,303,274
第2期	自平成14年12月 3日 至平成15年12月 1日	265,465,933	20,547,313	346,221,894
第3期	自平成15年12月 2日 至平成16年11月30日	416,780,688	46,621,949	716,380,633
第4期	自平成16年12月 1日 至平成17年11月30日	678,864,655	173,600,695	1,221,644,593
第5期	自平成17年12月 1日 至平成18年11月30日	773,218,555	278,884,535	1,715,978,613
第6期	自平成18年12月 1日 至平成19年11月30日	1,377,675,739	555,550,397	2,538,103,955
第7期	自平成19年12月 1日 至平成20年12月 1日	1,272,439,112	580,211,470	3,230,331,597
第8期	自平成20年12月 2日 至平成21年11月30日	1,562,236,394	451,257,057	4,341,310,934
第9期	自平成21年12月 1日 至平成22年11月30日	1,846,986,111	708,894,598	5,479,402,447
	自平成22年12月 1日 至平成23年 6月30日	1,149,513,963	523,815,979	6,105,100,431

（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 >

（平成23年6月30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	9,221円
純資産総額	56.2億円

## 分配の推移

計算期間	分配金
第1期（平成14年12月2日）	0円
第2期（平成15年12月1日）	0円
第3期（平成16年11月30日）	0円
第4期（平成17年11月30日）	0円
第5期（平成18年11月30日）	0円
第6期（平成19年11月30日）	0円
第7期（平成20年12月1日）	0円
第8期（平成21年11月30日）	0円
第9期（平成22年11月30日）	0円
設定累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況(組入比率は、マザーファンドの純資産総額に対するものです。)

## ＜銘柄別投資比率＞

	国/ 地域名	種類	銘柄名	投資 比率
1	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	1.68%
2	アメリカ	株式	APPLE INC	1.30%
3	スイス	株式	NESTLE SA-REG	0.91%
4	アメリカ	株式	IBM CORP	0.88%
5	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	0.86%
6	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	0.83%
7	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	0.82%
8	アメリカ	株式	AT & T INC	0.78%
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	0.76%
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	0.74%

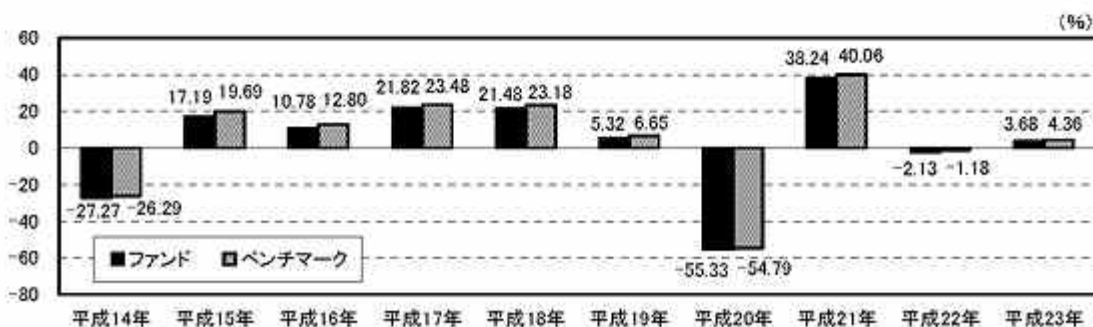
(注) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

## ＜業種別投資比率＞

	業種	投資 比率
1	エネルギー	11.82%
2	素材	7.90%
3	資本財	7.64%
4	銀行	7.64%
5	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.27%
6	食品・飲料・タバコ	6.20%
7	ソフトウェア・サービス	5.09%
8	各種金融	5.03%
9	保険	4.05%
10	電気通信サービス	3.98%

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※平成14年は設定時から年末まで、平成23年は6月末までの収益率です。

※年間収益率の推移は、課税前分配金を再投資したものと算出しています。

- 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3【ファンドの経理状況】(下記の内容が追加されます。)

(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および第57条の2の規定により、前中間計算期間(平成21年12月1日から平成22年5月31日まで)については、改正前の「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、当中間計算期間(平成22年12月1日から平成23年5月31日まで)については、改正後の「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、前中間計算期間(平成21年12月1日から平成22年5月31日まで)及び当中間計算期間(平成22年12月1日から平成23年5月31日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン  
 (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前中間計算期間末 (平成22年5月31日現在)	当中間計算期間末 (平成23年5月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	36,162,000	33,730,228
親投資信託受益証券	4,118,388,312	5,630,434,114
未収利息	69	64
流動資産合計	4,154,550,381	5,664,164,406
資産合計	4,154,550,381	5,664,164,406
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	14,175,356	5,116,706
未払受託者報酬	2,192,110	2,798,438
未払委託者報酬	18,632,861	23,786,625
その他未払費用	1,095,995	1,399,148
流動負債合計	36,096,322	33,100,917
負債合計	36,096,322	33,100,917
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	<sub>1</sub> 4,968,650,313	<sub>1</sub> 5,965,976,187
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	<sub>3</sub> 850,196,254	<sub>3</sub> 334,912,698
(分配準備積立金)	403,363,836	419,386,421
元本等合計	4,118,454,059	5,631,063,489
純資産合計	4,118,454,059	5,631,063,489
負債純資産合計	4,154,550,381	5,664,164,406

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自平成21年12月1日 至平成22年5月31日	当中間計算期間 自平成22年12月1日 至平成23年5月31日
<b>営業収益</b>		
受取利息	5,533	6,743
有価証券売買等損益	50,419,148	483,790,274
営業収益合計	50,413,615	483,797,017
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	2,192,110	2,798,438
委託者報酬	18,632,861	23,786,625
その他費用	1,095,995	1,399,148
営業費用合計	21,920,966	27,984,211
営業利益又は営業損失（ ）	72,334,581	455,812,806
経常利益又は経常損失（ ）	72,334,581	455,812,806
中間純利益又は中間純損失（ ）	72,334,581	455,812,806
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	19,387,488	29,734,526
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	702,855,520	758,140,684
剰余金増加額又は欠損金減少額	66,004,501	60,850,941
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	66,004,501	60,850,941
剰余金減少額又は欠損金増加額	121,623,166	63,701,235
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	121,623,166	63,701,235
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	850,196,254	334,912,698



## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前中間計算期間 自 平成21年12月 1日 至 平成22年 5月31日	当中間計算期間 自 平成22年12月 1日 至 平成23年 5月31日
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。	親投資信託受益証券 同左

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前中間計算期間末 (平成22年 5月31日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 5月31日現在)
1 期首元本額	4,341,310,934円	5,479,402,447円
期中追加設定元本額	1,044,417,674円	936,898,495円
期中一部解約元本額	417,078,295円	450,324,755円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	4,968,650,313口	5,965,976,187口
3 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は850,196,254円です。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は334,912,698円です。

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間（自 平成21年12月1日 至 平成22年5月31日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成22年12月1日 至 平成23年5月31日）

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

## 1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額

当中間計算期間末（平成23年5月31日現在）

中間貸借対照表計上額は期末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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券関係に関する注記)

前中間計算期間末（平成22年5月31日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年5月31日現在）

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)

前中間計算期間末（平成22年5月31日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年5月31日現在）

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)

	前中間計算期間末 (平成22年 5月31日現在)	当中間計算期間末 (平成23年 5月31日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8289円 (8,289円)	0.9439円 (9,439円)

[次へ](#)

## &lt; 参考 &gt;

当ファンドは「ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・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。

「ステート・ストリート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	(平成22年 5月31日現在)	(平成23年 5月31日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		3,389,305,224	2,487,257,527
コール・ローン		160,956,046	119,867,438
株式		297,537,328,591	144,173,108,899
投資証券		5,019,987,538	2,483,196,866
派生商品評価勘定		15,096,039	11,959,231
未収入金		35,109,714	1,135,875,155
未収配当金		855,229,396	358,066,625
未収利息		308	229
差入委託証拠金		1,342,065,789	336,748,716
流動資産合計		308,355,078,645	151,106,080,686
資産合計		308,355,078,645	151,106,080,686
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		247,452,765	23,086,576
未払金		16,017,099,434	1,150,855,994
未払解約金		127,380,000	6,884,000
流動負債合計		16,391,932,199	1,180,826,570
負債合計		16,391,932,199	1,180,826,570
純資産の部			
元本等			
元本	1	334,165,198,258	149,165,492,571
剰余金			
剰余金又は欠損金 ( )	3	42,202,051,812	759,761,545
元本等合計		291,963,146,446	149,925,254,116
純資産合計		291,963,146,446	149,925,254,116
負債純資産合計		308,355,078,645	151,106,080,686

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成21年12月 1日 至 平成22年 5月31日	自 平成22年12月 1日 至 平成23年 5月31日

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成22年 5月31日現在)	(平成23年 5月31日現在)
1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	355,719,056,631円	149,320,974,556円
同期中における追加設定元本額	30,605,132,692円	19,636,823,781円
同期中における一部解約元本額	52,158,991,065円	19,792,305,766円
同中間期末における元本の内訳		
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	13,486,429,887円	13,727,078,028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	4,713,732,760円	5,601,864,605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		2,053,984円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA1（適格機関投資家専用）	7,737,177,137円	6,902,200,577円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA2（適格機関投資家専用）	7,469,177,309円	8,610,624,874円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	114,181,998円	102,566,118円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	8,346,454,598円	7,623,264,254円

ステート・ストリート・バランスファン ドVA40A<適格機関投資家限定>	15,928,172円	14,385,750円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA40B<適格機関投資家限定>	109,970,587円	101,479,915円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50A<適格機関投資家限定>	64,381,479円	51,155,574円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50B<適格機関投資家限定>	34,208,666,073円	29,659,178,720円
ステート・ストリート・グローバルバラ ンスファンド(債券重視型)VA<適格機 関投資家限定>	64,038,123,966円	円
ステート・ストリート・グローバルバラ ンスファンド(標準型)VA<適格機関投 資家限定>	13,426,468,858円	円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50C<適格機関投資家限定>	152,679,534円	136,403,907円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA25A<適格機関投資家限定>	5,822,312,317円	5,172,627,079円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA37.5A<適格機関投資家限定>	3,086,339,458円	2,677,405,496円
ステート・ストリート・世界バランス ファンドVA<適格機関投資家限定>	77,856,693,590円	円
ステート・ストリート・世界バランス ファンドVA2<適格機関投資家限定>	41,504,969,818円	円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA75A<適格機関投資家限定>	374,179,372円	336,057,532円
ステート・ストリート4資産バランス20VA <適格機関投資家限定>	1,408,548,069円	1,272,874,054円
ステート・ストリート4資産バランス40VA <適格機関投資家限定>	10,282,638,232円	9,384,659,404円
ステート・ストリート4資産バランス30VA <適格機関投資家限定>	2,384,276,848円	2,142,177,764円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA35A<適格機関投資家限定>	8,703,813,420円	7,389,158,084円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA40C<適格機関投資家限定>	1,785,309,455円	1,622,481,006円
ステート・ストリート世界4資産バラ ンスVA45<適格機関投資家限定>	5,059,858,043円	4,526,297,893円
ステート・ストリート世界4資産バラ ンスVA20<適格機関投資家限定>	174,235,666円	155,023,638円
ステート・ストリート・グローバル4資 産30VA<適格機関投資家限定>	157,832,285円	139,237,758円
ステート・ストリート・グローバル4資 産45VA<適格機関投資家限定>	219,061,185円	180,373,873円
ステート・ストリート4資産バランス3 0VA2<適格機関投資家限定>	148,384,860円	137,187,561円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA25B<適格機関投資家限定>	1,278,279,976円	1,110,262,643円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA20A<適格機関投資家限定>	9,095,019円	8,542,389円

ステート・ストリート・バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	13,644,899円	12,685,021円
ステート・ストリート・バランスファンドVA50D<適格機関投資家限定>	1,635,924円	153,346円
ステート・ストリート・バランスファンドVA10A<適格機関投資家限定>	139,548,951円	130,144,556円
ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	6,502,065,700円	24,573,129,748円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	616,935,504円	875,682,629円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA30<適格機関投資家限定>	127,315円	121,053円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA40<適格機関投資家限定>	171,175円	161,507円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	12,751,868,819円	14,786,792,231円
計	334,165,198,258円	149,165,492,571円
2 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	334,165,198,258口	149,165,492,571口
3 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は42,202,051,812円です。	

### （金融商品に関する注記）

#### 金融商品の時価等に関する事項

##### 1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額

（平成23年5月31日現在）

貸借対照表計上額は期末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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

「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）

（平成22年5月31日現在）

'>（平成22年 5月31日現在）

該当する事項はありません。

（平成23年5月31日現在）

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	（平成22年 5月31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				
	S&P 500	3,529,804,911		3,379,291,790	150,513,121
	S&P 60	351,800,515		344,819,257	6,981,258
	SPI 200	245,846,672		233,085,006	12,761,666
	FTSE100INDEX	745,646,377		724,830,343	20,816,034
	FSMI INDEX	271,019,740		264,233,048	6,786,692
	EURO STOXX 50	942,185,698		921,392,010	20,793,688
合計	6,086,303,913		5,867,651,454	218,652,459	

（単位：円）

区分	種類	（平成23年 5月31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				
	S&P 500	1,743,877,942		1,747,887,570	4,009,628
	S&P 60	237,974,397		235,857,132	2,117,265
	SPI 200	168,316,951		162,218,952	6,097,999
	FTSE100INDEX	403,829,851		403,997,061	167,210
	FSMI INDEX	164,336,262		167,043,522	2,707,260
	EURO STOXX 50	503,542,116		493,345,237	10,196,879
合計	3,221,877,519		3,210,349,474	11,528,045	

（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。

原則として計算期間末日に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、計算期間末日に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計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っており、換算において円未満の端数は切り捨てております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	(平成22年 5月31日現在)			
		契約額等		時価	評価損益
		うち1年超			
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカ・ドル	10,336,910,000		10,331,421,785	5,488,215
	カナダ・ドル	1,060,590,000		1,059,624,816	965,184
	オーストラリア・ドル	747,440,000		747,410,985	29,015
	イギリス・ポンド	1,854,760,000		1,853,101,177	1,658,823
	スイス・フラン	698,650,000		697,654,740	995,260
	香港・ドル	196,640,000		196,417,103	222,897
	シンガポール・ドル	122,460,000		122,425,193	34,807
	スウェーデン・クローナ	249,000,000		248,362,571	637,429
	ノルウェー・クローネ	42,850,000		42,701,289	148,711
	デンマーク・クローネ	89,620,000		89,513,154	106,846
	イスラエル・シェケル	87,900,000		87,885,223	14,777
	ユーロ	2,525,350,000		2,522,892,097	2,457,903
	売建				
	アメリカ・ドル	8,103,600		8,217,000	113,400
イギリス・ポンド	6,483,000		6,591,000	108,000	
ユーロ	32,934,000		33,657,000	723,000	
合計		18,059,690,600		18,047,875,133	13,704,267

(単位：円)

区分	種類	(平成23年 5月31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				
	カナダ・ドル	18,207,200		18,235,800	28,600
	オーストラリア・ドル	8,656,000		8,697,000	41,000
	スイス・フラン	46,550,000		46,790,100	240,100
	ユーロ	15,022,800		15,113,800	91,000
合計		88,436,000		88,836,700	400,700

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 計算期間末日に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。

計算期間末日において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。

計算期間末日において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。

- ・ 計算期間末日に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。
- ・ 計算期間末日に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) 計算期間末日に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、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
4. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	(平成22年 5月31日現在)	(平成23年 5月31日現在)
本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8737円 (8,737円)	1.0051円 (10,051円)

## 2【ファンドの現況】（下記の内容に更新されます。）

## 【純資産額計算書】

（平成23年6月30日現在）

資産総額	5,639,081,962円
負債総額	9,822,846円
純資産総額（ - ）	5,629,259,116円
発行済口数	6,105,100,431口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	0.9221円 (9,221円)

## &lt; 参考情報 &gt;

親投資信託受益証券（ステート・ストリート外国株式インデックス・オープン・マザーファンド）

（平成23年6月30日現在）

資産総額	148,718,416,275円
負債総額	12,533,817円
純資産総額（ - ）	148,705,882,458円
発行済口数	151,316,726,805口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	0.9827円 (9,827円)

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

< 訂正前 >

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(平成23年1月31日現在)。

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(平成23年1月31日現在)。

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(平成23年1月31日現在)。

(略)

< 訂正後 >

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(平成23年6月30日現在)。

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(平成23年6月30日現在)。

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(平成23年6月30日現在)。

(略)

##### (2) 委託会社の機構

< 訂正前 >

各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

部署名		業務内容
営業本部	年金営業部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、コンサルタントとの折衝
	金融法人第一部 金融法人第二部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、投資信託販売会社との交渉・連絡、コンサルタントとの折衝等
証券営業本部	証券営業部	グループ会社の運用するETF、海外ファンド等の国内投資家向け需要喚起・勧誘、自社設定投信の企画・勧誘等
運用本部	運用部	投資一任・助言に係る資産及び投資信託の運用の指図、売買発注、運用報告の作成、運用手法・運用モデルの研究開発等
業務管理本部	業務管理部	資産運用管理業務、投資信託管理業務、運用報告書等の作成、投資パフォーマンスの計測・要因分析、ソフトウェアの開発・PC管理・サポート、システム管理等

総合企画本部	企画調査部	商品設計、企画提案書の作成、契約締結手続き、勧誘資料作成、広告、営業イベント企画等
	財務部	会社経理・決算、税務申告、予算管理等の経理業務、ディスクロージャー資料作成等
	テクノロジー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[ソフトウェアの開発・保守管理、セキュリティ管理]
	インフラストラクチャー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[コンピュータ機器及び付属機器の設置・保守管理]
	総務部	備品の購入・管理、オフィスの安全・防犯管理等の総務関連業務（総務業務）、メンテナンスを含む施設管理に関する業務（管財業務）および対外広報管理等の広報に関する業務（広報業務）
	人事部	福利厚生、給与支払等の人事に関する事務的業務
内部管理本部	コンプライアンス・リスクマネジメント部	法令遵守状況の確認・指導、投資判断その他に関するリスク管理、内部管理責任者、情報管理責任者、広告審査、内部監査対応等
	法務部	法務調査・契約書類等の作成等の法務的業務
	内部監査部	経営諸活動の内部統制システムの妥当性や有効性について検証・評価し、その結果及び改善案を経営陣に対して報告

< 訂正後 >

各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

	部署名	業務内容
営業本部	年金営業部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、コンサルタントとの折衝
	金融法人第一部 金融法人第二部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、投資信託販売会社との交渉・連絡、コンサルタントとの折衝等
証券営業本部	証券営業部	グループ会社の運用するETF、海外ファンド等の国内投資家向け需要喚起・勧誘、自社設定投信の企画・勧誘等
運用本部	運用部	投資一任・助言に係る資産及び投資信託の運用の指図、売買発注、運用報告の作成、運用手法・運用モデルの研究開発等
業務管理本部	業務管理部	資産運用管理業務、投資信託管理業務、運用報告書等の作成、投資パフォーマンスの計測・要因分析等

総合企画本部	企画調査部	商品設計、企画提案書の作成、契約締結手続き、勧誘資料作成、広告、営業イベント企画等
	財務部	会社経理・決算、税務申告、予算管理等の経理業務、ディスクロージャー資料作成等
	人事部	福利厚生、給与支払等の人事に関する事務的業務
	インフラストラクチャー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[コンピュータ機器及び付属機器の設置・保守管理]、SSgAのソフトウェアの開発・PC管理・サポート、システム管理
	テクノロジー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[ソフトウェアの開発・保守管理、セキュリティ管理]
	総務部	備品の購入・管理、オフィスの安全・防犯管理等の総務関連業務(総務業務)、メンテナンスを含む施設管理に関する業務(管財業務)および対外広報管理等の広報に関する業務(広報業務)
内部管理本部	コンプライアンス・リスクマネジメント部	法令遵守状況の確認・指導、投資判断その他に関するリスク管理、内部管理責任者、情報管理責任者、広告審査、内部監査対応等
	法務部	法務調査・契約書類等の作成等の法務的業務
内部監査部		経営諸活動の内部統制システムの妥当性や有効性について検証・評価し、その結果及び改善案を経営陣に対して報告

## 2【事業の内容及び営業の概況】

### < 訂正前 >

「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者は、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1種金融商品取引業及び第2種金融商品取引業を行っています。

平成23年1月31日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、109本であり、その純資産総額は97,865,355万円です(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。)

### < 訂正後 >

「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者は、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1種金融商品取引業及び第2種金融商品取引業を行っています。

平成23年6月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、110本であり、その純資産総額は949,089百万円です(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】（下記の内容に更新されます。）

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、以下「財務諸表等規則」といいます）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、前事業年度（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）及び当事業年度（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表について、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 (平成22年3月31日現在)		当事業年度 (平成23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				
現金	69		51	
預金	6,652,255		6,661,535	
有価証券	49,072		55,860	
前払金	-		4,358	
前払費用	23,912		17,658	
未収入金	666,368		361,818	
未収委託者報酬	596,483		349,939	
未収収益	25,258		30,627	
未収消費税等	-		22,424	
未収還付法人税等	-		131,504	
繰延税金資産	79,106		24,293	
流動資産計	8,092,526	95.9	7,660,073	96.0
固定資産				
有形固定資産	190,517		172,747	
建物附属設備	156,889	1	143,387	
器具備品	33,628	1	29,360	
無形固定資産	2,851		1,667	
ソフトウェア	2,851	2	1,667	
投資その他の資産	154,500		143,436	
長期差入保証金	133,462		93,357	
繰延税金資産	16,187		45,229	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	347,869	4.1	317,851	4.0
資産合計	8,440,395	100.0	7,977,925	100.0
(負債の部)				
流動負債				
預り金	54,823		84,273	
未払金	724,822		424,170	
未払手数料	302,298		109,589	
その他未払金	422,523		314,580	
未払費用	94,329		72,454	
未払法人税等	406,808		265	
未払消費税等	18,985		-	
賞与引当金	62,492		54,792	
その他の流動負債	3,562		-	
流動負債計	1,365,824	16.2	635,955	8.0
固定負債				
役員退職慰労引当金	37,339		0	
退職給付引当金	10,758		84,094	
固定負債計	48,098	0.6	84,094	1.1
負債合計	1,413,922	16.8	720,050	9.0
(純資産の部)				
株主資本	7,026,473	83.2	7,257,874	91.0
資本金	310,000		310,000	
利益剰余金	77,500		77,500	
利益準備金	77,500		77,500	
その他利益剰余金	31,620		31,620	
別途積立金	6,607,353		6,838,754	
繰越利益剰余金				
純資産合計	7,026,473	83.2	7,257,874	91.0
負債・純資産合計	8,440,395	100.0	7,977,925	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別	前事業年度		当事業年度	
	自 平成21年 4月 1日	至 平成22年 3月 31日	自 平成22年 4月 1日	至 平成23年 3月 31日



科 目	金 額		構成比 %	金 額		構成比 %
営業収益						
委託者報酬		6,090,712		3,343,307		
投資顧問収入	1	2,069,761		1,785,199		
その他営業収益		16,491		18,337		
営業収益計		8,176,964	100.0	5,146,844	100.0	
営業費用						
支払手数料		3,146,528		1,355,270		
広告宣伝費		11,395		17,530		
公告費		1,140		2,400		
調査費		556,209		493,033		
調査費	1	240,382		248,560		
委託調査費	1	314,332		242,832		
函書費		1,494		1,640		
委託計算費		187,144		171,824		
営業雑経費		47,159		40,718		
通信費		7,740		7,033		
印刷費		9,869		8,341		
協会費		15,464		13,797		
諸会費		5,333		2,901		
その他		8,752		8,644		
営業費用計		3,949,576	48.3	2,080,777	40.4	
一般管理費						
給料		1,201,883		1,254,505		
役員報酬	1	267,365		305,535		
給料・手当	1	761,261		761,648		
賞与	1	110,764		132,528		
賞与引当金繰入額		62,492		54,792		
退職金		-		2,846		
交際費		5,925		2,992		
旅費交通費		27,228		26,905		
租税公課		21,458		14,439		
不動産賃借料		160,720		135,683		
役員退職慰労引当金繰入額		5,204		9,188		
退職給付費用		39,747		60,658		
固定資産減価償却費		21,584		31,299		
福利厚生費		87,474		87,865		
事務手数料	1	744,715		749,844		
諸経費		100,465		118,910		
一般管理費計		2,416,409	29.6	2,495,141	48.5	
営業利益		1,810,977	22.1	570,925	11.1	
営業外収益						
受取利息		-		0		
有価証券売却益		3,857		0		
雑収入		402		572		
営業外収益計		4,259	0.0	572	0.0	
営業外費用						
為替差損		231		1,144		
有価証券売却損		-		1,620		
雑損失		-		425		
営業外費用計		231	0.0	3,190	0.1	
経常利益		1,815,005	22.2	568,306	11.0	
特別損失						
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		-		20,630		
役員退職慰労金制度終了損		-		6,662		
事務処理損失		93		7,866		
特別損失計		93	0.0	35,159	0.7	
税引前当期純利益		1,814,912	22.2	533,147	10.4	
法人税、住民税及び事業税		816,931	10.0	275,975	5.4	
法人税等調整額		13,860	0.2	25,770	0.5	
当期純利益		1,011,841	12.4	231,401	4.5	

## (3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	310,000	310,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	310,000	310,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	77,500	77,500
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	77,500	77,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	31,620	31,620
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	31,620	31,620
繰越利益剰余金		
前期末残高	5,595,511	6,607,353
当期変動額		
当期純利益	1,011,841	231,401
当期変動額合計	1,011,841	231,401
当期末残高	6,607,353	6,838,754
利益剰余金合計		
前期末残高	5,704,631	6,716,473
当期変動額		
当期純利益	1,011,841	231,401
当期変動額合計	1,011,841	231,401
当期末残高	6,716,473	6,947,874
株主資本合計		
前期末残高	6,014,631	7,026,473
当期変動額		
当期純利益	1,011,841	231,401
当期変動額合計	1,011,841	231,401
当期末残高	7,026,473	7,257,874
純資産合計		
前期末残高	6,014,631	7,026,473
当期変動額		
当期純利益	1,011,841	231,401
当期変動額合計	1,011,841	231,401
当期末残高	7,026,473	7,257,874

[次へ](#)

## 【重要な会計方針】

	前事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
1.有価証券 の評価基 準及び評 価方法	(1) 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。	(1) 有価証券 同 左
2.固定資産 の減価償 却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備6～18年 器具備品 8年  (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア(自社利用)については、社内における見込利用可能期間(5年)に 基づく定額法を採用しております。	(1) 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。 同 左  (2) 無形固定資産 同 左
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。	同 左

4.引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 当事業年度から「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号 平成20年7月31日）を適用しております。 数理計算上の差異を翌期から償却するため、これによる営業損益、経常損益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額の未処理残高は20,032千円であります。</p> <p>(3) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に備えて、役員退職慰労金規定に基づく期末要支給額を計上しております。</p>	<p>(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員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。また、過去勤務債務及び数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。 過去勤務債務 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 数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理 （追記情報） 当社は、適格退職年金制度を設けておりましたが、退職給付制度の改定を実施し、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。この移行に伴い、「退職給付制度間の移行等に関する会計処理」（企業会計基準適用指針第1号）及び「退職給付制度間の移行等の会計処理に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第2号）を適用しております。なお、この移行に伴い過去勤務債務87,216千円が発生しております。</p> <p>(3) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労引当金は、役員の退職慰労金の支払いに備えるため、内規に基づく要支給額を計上しておりましたが、平成23年3月29日開催の取締役会において役員退職慰労金規程の廃止を決議しました。これに伴い、役員退職慰労引当金を全額取り崩し、新退職給付制度への移行により退職給付引当金へ振り替え、また、積立不足分6,662千円を特別損失として計上しております。</p>
5.その他財務諸表作成のための重要な事項	<p>(1) 消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>	<p>(1) 消費税等の処理方法 同 左</p>

	前事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
1. 資産除去債務に関する会計基準	-	当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。これにより、営業利益及び経常利益はそれぞれ9,467千円減少し、税引前当期純利益は30,098千円減少しております。また、当会計基準等の適用開始による長期差入保証金の変動額は30,098千円であります。

## 注 記 事 項

## （貸借対照表関係）

前事業年度 (平成22年3月 31日 現在)	当事業年度 (平成23年3月 31日 現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 34,935千円 器具備品 21,419千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 48,437千円 器具備品 28,565千円
2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 5,658千円	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 6,842千円
授權株式数及び発行済株式総数 授權株式数 8,800株 発行済株式数 6,200株	授權株式数及び発行済株式総数 授權株式数 8,800株 発行済株式数 6,200株
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 該当事項はありません。

## （損益計算書関係）

前事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日

<p>1. 関係会社に係る注記</p> <p>各科目に含まれている関係会社との取引は次のとおりであります。</p> <p>(但し、親会社であったステート・ストリート・バンクアンドトラストカンパニーは平成21年10月に関係会社ではなくなっております。当該金額は10月以降の関係会社でなくなった期間の金額も含めた当期中における取引金額全てについて記載しております。)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">投資顧問収入</td> <td style="text-align: right;">258,438千円</td> </tr> <tr> <td>調査費</td> <td style="text-align: right;">168,552千円</td> </tr> <tr> <td>委託調査費</td> <td style="text-align: right;">269,665千円</td> </tr> <tr> <td>役員報酬</td> <td style="text-align: right;">133,413千円</td> </tr> <tr> <td>給料・手当</td> <td style="text-align: right;">17,308千円</td> </tr> <tr> <td>賞与</td> <td style="text-align: right;">40,494千円</td> </tr> <tr> <td>事務手数料</td> <td style="text-align: right;">694,820千円</td> </tr> </table>	投資顧問収入	258,438千円	調査費	168,552千円	委託調査費	269,665千円	役員報酬	133,413千円	給料・手当	17,308千円	賞与	40,494千円	事務手数料	694,820千円	<p>1. 関係会社に係る注記</p> <p>該当事項はありません。</p>
投資顧問収入	258,438千円														
調査費	168,552千円														
委託調査費	269,665千円														
役員報酬	133,413千円														
給料・手当	17,308千円														
賞与	40,494千円														
事務手数料	694,820千円														

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
1. 当事業年度の末日における発行済株式数 6,200株	1. 当事業年度の末日における発行済株式数 6,200株
2. 配当金支払額 該当事項はありません。	2. 配当金支払額 該当事項はありません。

## (リース取引関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日

<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table border="0"> <tr> <td>支払リース料</td> <td>2,473千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>2,250千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>60千円</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p>	支払リース料	2,473千円	減価償却費相当額	2,250千円	支払利息相当額	60千円	<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの) 該当事項はありません。</p>
支払リース料	2,473千円						
減価償却費相当額	2,250千円						
支払利息相当額	60千円						

## (金融商品関係)

前事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 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には、平成19年8月17日金融庁告示五九「金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算定の基準等を定める件」により定義される取引先リスクが存在しますが、取引先の多くは、「指定国の政府機関および中央銀行（これらに準ずる者を含む。）」、「我が国の地方公共団体」および「指定格付を付与された金融機関」であるため、取引先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

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	6,652,325	6,652,325	
(2)未収委託者報酬	596,483	596,483	
(3)未収入金	666,368	666,368	
(4)その他未払金	422,523	422,523	

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

## （1）現金及び預金

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

## （2）未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)その他未払金

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

## （注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 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、計上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には、平成19年8月17日金融庁告示五九「金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算定の基準等を定める件」により定義される取引先リスクが存在しますが、取引先の多くは、「指定国の政府機関および中央銀行（これらに準ずる者を含む。）」、「我が国の地方公共団体」および「指定格付を付与された金融機関」であるため、取引先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

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	6,661,535	6,661,535	
(2)未収委託者報酬	349,939	349,939	
(3)未収入金	361,818	361,818	
(4)その他未払金	314,580	314,580	

## （注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

## （1）預金

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



価としております。

(2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)その他未払金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものではありません。

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

該当事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)		当事業年度 (平成23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	49,072千円	貸借対照表計上額	55,860千円
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	1,112千円	に含まれた評価差額	900千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日	当事業年度 自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日
該当事項はありません。	同 左

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社は、確定給付型の制度として、設立時より全面的に適格退職年金制度を採用しております。当社の適格退職年金契約は、当社と同一の親会社を持つ会社（3社）との共同結合契約であり、年金資産の計算は退職給付債務の比率によっております。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社は、設立時より適格退職年金制度を設けておりましたが、退職給付制度の改定を実施し、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

2. 退職給付債務及びその内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
退職給付債務	161,243	322,666

(1)年金資産	130,452	172,261
(2)退職給付引当金	10,758	84,094
(3)未認識数理計算上の差異	20,032	20,905
(4)未認識過去勤務債務	-	87,216

退職給付債務には、役員分53,190千円が含まれております。

### 3. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
退職給付費用	39,747	60,658
(1)勤務費用	29,006	36,339
(2)利息費用	3,276	1,988
(3)期待運用収益（減算）	796	966
(4)過去勤務債務の費用処理額	-	3,265
(5)数理計算上の差異の費用処理額	8,260	20,032

### 4. 退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成22年3月 31日現在)	当事業年度 (平成23年3月 31日現在)
(1)割引率	1.0%	1.0%
(2)期待運用収益率	0.75%	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
(4)過去勤務債務の処理年数	1年	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年	1年

### (税効果会計関係)

前事業年度	当事業年度
自 平成21年4月 1日	自 平成22年4月 1日
至 平成22年3月 31日	至 平成23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	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)	(単位：千円)
繰延税金資産(流動)	繰延税金資産(流動)
賞与引当金繰入超過額	賞与引当金繰入超過額
25,428	17,154
未払事業税	その他
3	19,822
0,949	繰延税金資産(流動)合計
その他	繰延税金負債(流動)との相殺
26,538	12,683
繰延税金資産(流動)合計	繰延税金資産(流動)の純額
82,915	24,293
繰延税金負債(流動)との相殺	
3,809	
繰延税金資産(流動)の純額	繰延税金資産(固定)
79,106	退職給付引当金
繰延税金資産(固定)	35,207
役員退職給与引当金	その他
15,193	13,831
退職給付引当金	繰延税金資産(固定)合計
5,365	繰延税金負債(固定)との相殺
その他	3,809
3,247	繰延税金資産(固定)の純額
繰延税金資産(固定)合計	45,229
23,807	
繰延税金負債(固定)との相殺	繰延税金資産合計
7,619	69,522
繰延税金資産(固定)の純額	繰延税金負債(流動)
16,187	事業譲受に係る調整項目
繰延税金資産合計	3,809
95,293	未収還付事業税
繰延税金負債(流動)	8,873
事業譲受に係る調整項目	
3,809	

繰延税金負債（流動）合計 3,809 繰延税金負債（流動）との相殺		繰延税金負債（流動）合計 12,683 繰延税金負債（流動）との相殺 12,683	
3,809		繰延税金負債（流動）の純額 -	
繰延税金負債（流動）の純額 -		繰延税金負債（固定） 事業譲受に係る調整項目 3,809	
繰延税金負債（固定） 事業譲受に係る調整項目 7,619		繰延税金負債（固定）合計 3,809 繰延税金負債（固定）との相殺	
繰延税金負債（固定）合計 7,619 繰延税金負債（固定）との相殺		繰延税金負債（固定）の純額 -	
7,619			
繰延税金負債（固定）の純額 -			
繰延税金資産の純額 95,293		繰延税金資産の純額 69,522 =====	
=====			
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率 40.7%		法定実効税率 40.7%	
交際費等永久に損金に 算入されない項目 3.6%		交際費等永久に損金に 算入されない項目 15.8%	
その他 0.0%		その他 0.0%	
税効果会計適用後の 法人税等の負担率 44.2%		税効果会計適用後の 法人税等の負担率 56.5% =====	
=====			

## (企業結合関係等)

前事業年度		当事業年度	
自	平成21年4月 1日	自	平成22年4月 1日
至	平成22年3月 31日	至	平成23年3月 31日

該当事項はありません。	同 左
-------------	-----

（資産除去債務関係）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びデータ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59,837千円であります。また資産除去債務の総額は、データセンターの賃貸借契約期間満了が近づいたことに伴う見積りの見直しの実施等を主な理由とし、当期中において12,509千円減少しております。

（セグメント情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

本邦に所在している顧客への収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、集計対象より除外しております。

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

委託者報酬については、制度上、顧客情報を知り得ないため、記載を省略しております。また、投資顧問料については、顧客との守秘義務契約により、開示が出来ないため、記載を省略しております。

（報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(2) 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	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	前事業年度		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日					
						関係内容 役員の兼 任等	事業上の 関係				
親会社 の子会 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 受入れ及び ソフトウェア の使用契約 及び人件 費等及び事 務手数料の 支払	投資顧問料 の受取	258,438	未収入金	33,424
								ソフトウェア 使用料の 支払	168,552	未払金	365,368
								投資顧問料 の支払	269,665	未払費用	14,565
								人件費等の 支払	191,216		
								事務手数料	694,820		
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、兼職社 員の人件費 支払等	投資信託計 理業務委託	41,455			
							事務所賃借 料の支払	8,722			
							人件費等の 支払	59,715	未払金	3,619	

ステート・ストリート株式会社	東京都港区	1千万円	サービス業	なし	なし	備品の賃借及び事務管理サービスなどの役務の受入れ	備品賃借料の支払 役務料の支払	263 47,703	未払金	-
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提供	投資顧問料の受取	14,590	未収入金	1,052
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国 ルクセンブルグ市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	43,978		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	投資顧問料の受取 紹介料の受取	10,790 82	未収入金 未収収益	- 82
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・GmbH	ドイツ ミュンヘン	250万ユーロ	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	46,435	未収入金	-
タッカーマン・グループ	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	1百万ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	4,461	未払金	2,512
ステート・ストリート・グローバル・マーケッツ, LLC	米国 マサチューセッツ州 ボストン市	237百万米ドル	証券業	なし	なし	ETF商品の紹介	紹介料の受取	11,647	未収収益	6,394
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・オーストラリア	オーストラリア シドニー	8百万オーストラリアドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の受取	9,894	未収入金	650

(注) 上記(2)の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社とステート・ストリート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. 事務所賃借料、備品賃借料については、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。

## 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）

## (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。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

## 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

## (2) 同一の親会社を持つ会社

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	当事業年度		取引の 内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
						自	至				
						平成22年4月 1日	平成23年3月 31日				
						関連当事者 との関係					
						役員の兼 任等	事業上の 関係				



同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・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	投資顧問料の受取 ソフトウェア使用料の支払 投資顧問料の支払 人件費等の支払 事務手数料	207,364 171,911 199,549 145,191 699,910	未収入金 未払金 未払費用	31,050 213,964 15,975
	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 事務所賃借料の支払 人件費等の支払	37,966 8,694 103,543	前払金 未払金	4,358 3,658
	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提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	20,022 11,711	未収入金	477
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国ルクセンブルグ市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	44,053		
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポールシンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	121	未収収益	63

タッカー マン・グ ループ	米国 ニュー ヨーク州 ニュー ヨーク市	1百万 ドル	不動産 投資顧 問業務	なし	なし	投資顧問 サービスの 受入	投資顧問料 の支払	5,934	未払金	3,121
ステート ・スト リート・ グローバ ル・マー ケッツ, LLC	米国 マサ チュー セッツ州 ボストン 市	237百万 米ドル	証券業	なし	なし	E T F 商品 の紹介	紹介料の受 取	13,973	未収収益	6,701
ステート ・スト リート・ グローバ ル・アド バイザー ズ・オー ストラリ ア	オースト ラリア シドニー	8百万 オース トラリ アドル	投資顧 問業	なし	なし	投資顧問 サービスの 受入	投資顧問料 の受取	3,018		

(注) 上記(2)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)

##### (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		当事業年度	
自	平成21年4月 1日	自	平成22年4月 1日
至	平成22年3月 31日	至	平成23年3月 31日

1株当たり純資産 1,133,302円12銭 1株当たり当期純利益 163,200円20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 1,170,624円94銭 1株当たり当期純利益 37,322円82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 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
当期純利益 (千円)	1,011,841	231,401
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)	1,011,841	231,401
期中平均株式数 (株)	6,200	6,200

(重要な後発事象)

前事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日	当事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日
当社が設定した私募投資信託4ファンドの繰上償還を翌事業年度で予定しており、翌事業年度の営業収益および営業費用が、大幅に減少する可能性があります。なお、当事業年度における上記4ファンドからの営業収益および営業費用は以下のとおりです。  委託者報酬 4,008,136千円 支払手数料 2,614,000千円	該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】（下記の内容に更新されます。）

### 1. 受託会社

#### (1) 【名称、資本金の額及び事業の内容】

名 称

中央三井アセット信託銀行株式会社

（再信託受託銀行：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

資本金の額(平成23年3月末日現在)

11,000百万円

(51,000百万円)

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) 【関係業務の概要】

当ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理・計算、受益権の設定に係る振替機関への通知、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

#### (3) 【資本関係】

該当事項はありません。

### 2. 販売会社

#### (1) 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 名 称	(2) 資本金の額	(3) 事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円 (平成23年3月現在)	銀行法に基づく銀行業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
中央三井信託銀行株式会社	399,697百万円 (平成23年3月現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円 (平成23年3月現在)	保険業法に基づく損害保険業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
日本生命保険相互会社	250,000百万円 (平成23年3月現在)	保険業法に基づく生命保険業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (平成23年3月現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
株式会社横浜銀行	215,628百万円 (平成23年3月現在)	銀行法に基づく銀行業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。

富国生命保険相互会社	40,000百万円 (平成23年3月現在)	保険業法に基づく生命保険業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。
三井生命保険株式会社	167,280百万円 (平成23年3月現在)	保険業法に基づく生命保険業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。

相互会社において株式会社の資本金にあたる「基金(基金償却積立金は含みません。)」の額を示しています。

(2) 関係業務の概要

当ファンドの販売会社として受益権の募集・売出しの取扱い等を行います。

(3) 資本関係

該当事項はありません。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22年7月7日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会 御中

### あらた監査法人

指定社員

業務執行社員

公認会計士 大畑 茂 印

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DC外国株式インデックス・オープンの平成21年12月1日から平成22年5月31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。この中間財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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DC外国株式インデックス・オープンの平成22年5月31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(平成21年12月1日から平成22年5月31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。

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

( ) 上記は、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月21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

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 松村 直孝 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 高木 竜二 印

業務執行社員

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平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第13期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成22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すべ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。

### 追加情報

重要な後発事項に記載のとおり、私募投資信託4ファンドの繰上償還を翌年事業年度で予定しており、翌年事業年度の損益に影響を与える可能性が生じている。

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

( ) 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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年7月13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

あらた監査法人  
指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

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DC外国株式インデックス・オープンの平成22年12月1日から平成23年5月31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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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DC外国株式インデックス・オープンの平成23年5月31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(平成22年12月1日から平成23年5月31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。

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

( ) 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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月20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

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 高木 竜二 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 丘本 正彦 印

業務執行社員

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平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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。

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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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平成23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すべ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。

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

( ) 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(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。