

【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24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24年2月29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】

（9）【払込期日】

<訂正前>

申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問い合わせください。）までに、お申込金をお申込みの販売会社に支払うものとします。ファンドの受益権は、振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に当ファンドの受託会社である中央三井アセット信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

<訂正後>

申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問い合わせください。）までに、お申込金をお申込みの販売会社に支払うものとします。ファンドの受益権は、振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に当ファンドの受託会社である三井住友信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

（1）【ファンドの目的および基本的性格】

<訂正前>

属性区分表

（略）

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式 一般））	目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。なお、当ファンドにおける組入資産は、投資信託証券です。
決算頻度	年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を除く）	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

対象インデックス	その他	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。
----------	-----	---

商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

<訂正後>

属性区分表

(略)

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産(投資信託証券(株式 一般))	目論見書又は投資信託約款において、株式、債券、不動産投資以外の資産に投資する旨の記載があるものをいい、括弧内の記載は、組入資産を表します。なお、当ファンドにおける組入資産は、投資信託証券です。
決算頻度	年1回	目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル(日本を除く)	目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産(日本を除く)を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	その他	「その他」とは日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

商品分類、属性区分は、社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの関係法人

<訂正前>

(略)

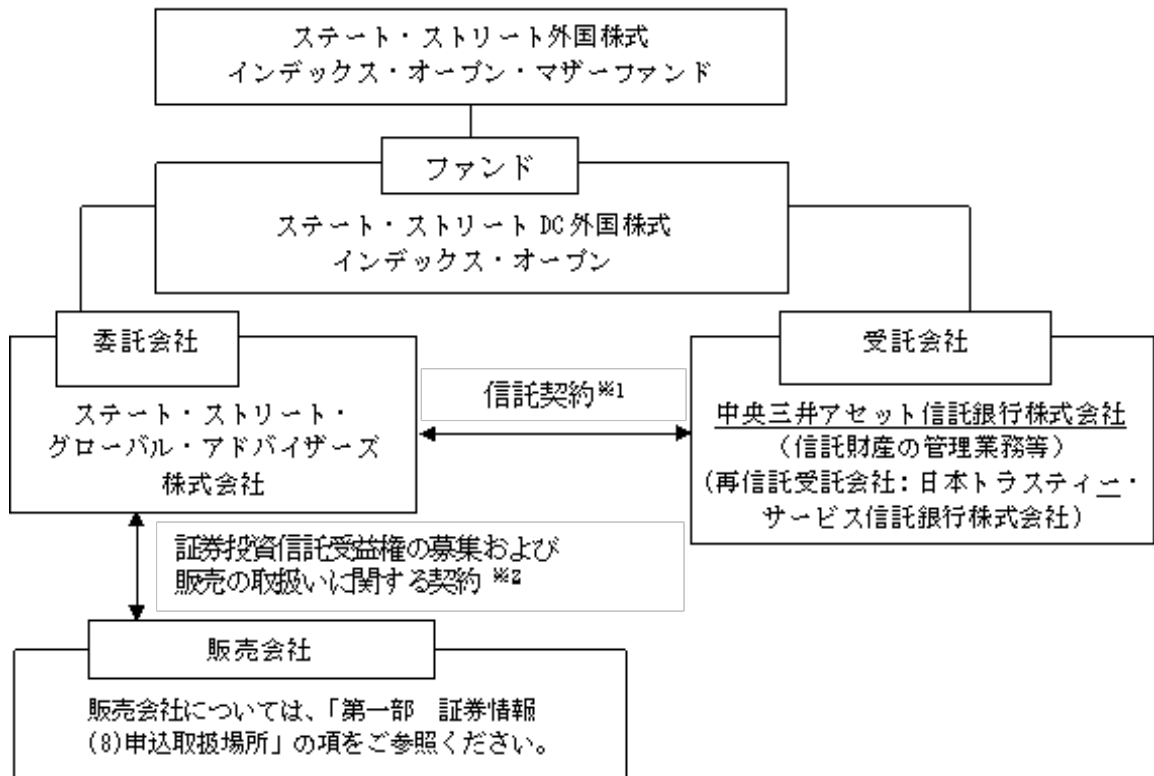
2) 中央三井アセット信託銀行株式会社(以下「受託会社」といいます。)

(注) 平成24年4月1日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号は三井住友信託銀行株式会社となる予定です。

(再信託受託会社：日本トラスティニ・サービス信託銀行株式会社)

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき日本トラスティニ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

(略)
ファンド関係法人



(略)

委託会社の概況（平成23年12月30日現在）

(略)

3) 大株主の状況

(平成23年12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%

<訂正後>

(略)

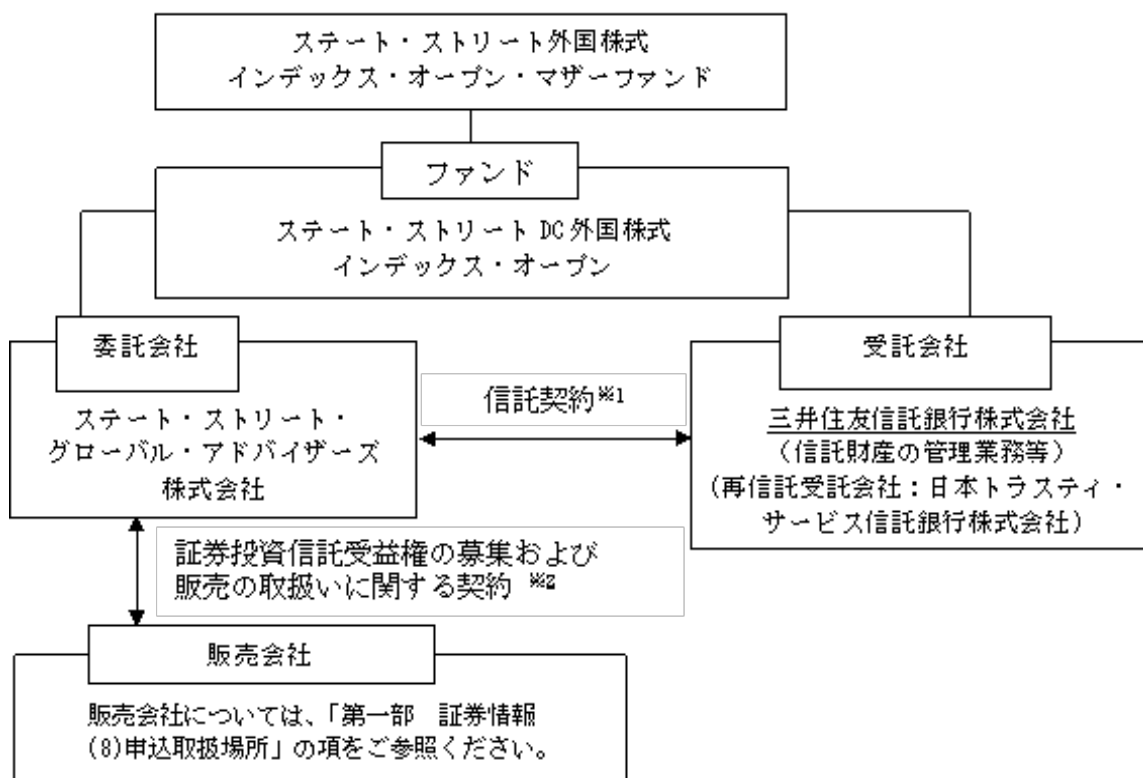
2) 三井住友信託銀行株式会社(以下「受託会社」といいます。)

(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

受託会社は、信託財産の管理業務、信託財産の計算等を行います。また、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。

(略)

ファンド関係法人



(略)

委託会社の概況（平成24年6月29日現在）

(略)

3) 大株主の状況

(平成24年6月29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】

(2)【投資対象】

<訂正前>

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託会社とし、中央三井アセット信託銀行株式会社を受託会社として締結されたステート・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(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券(以下「マザーファンドの受益証券」といいます。)および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します（信託約款第16条第1項）。

(略)

<訂正後>

委託会社は、信託金を、主としてステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社を委託会社とし、三井住友信託銀行株式会社を受託会社として締結されたステート・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(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券(以下「マザーファンドの受益証券」といいます。)および次の有価証券（金融商品取引法第2

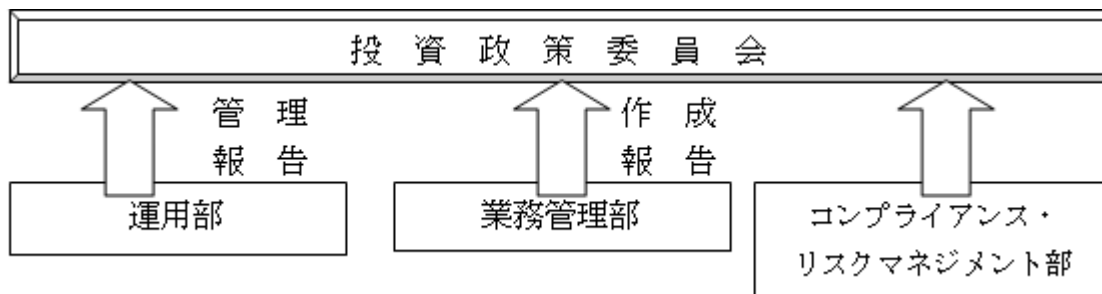
条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します（信託約款第16条第1項）。

(略)

3【投資リスク】

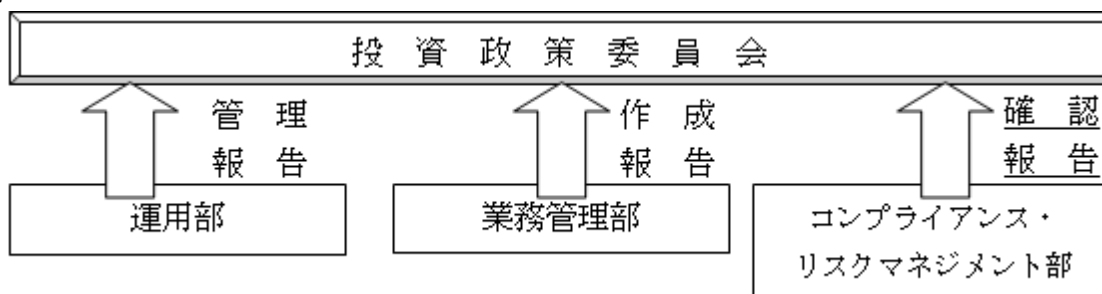
(2) リスク管理体制

<訂正前>



(略)

<訂正後>



(略)

(4)【その他の手数料等】（下記の内容に更新されます。）

信託財産に関する租税、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）等の信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息（以下「諸経費」といいます。）は、受益者の負担として、信託財産中から支弁します。ただし、当該諸経費の金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、実際の金額にかかわらず固定率又は固定金額にて信託財産中から支弁することもできるものとします（信託約款第41条）。

信託財産に係る監査費用(ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.0525% (税抜0.05%、上限：200万円)の率を乗じて得た額とします。)は、毎計算期間の6カ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

上記に定める信託事務の処理等に要する諸費用は、マザーファンドに関連して生じた諸費用のうちマザーファンドにおいて負担せずかつ委託会社の合理的判断によりこの信託に関連して生じたと認めるものを含みます。

ファンドの組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等は、信託財産が負担します。この他に、売買委託手数料に対する消費税等相当額および先物取引、オプション取引等に要する費用についても信託財産が負担します。

信託財産において資金の借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から支弁します。

(5)【課税上の取扱い】（下記の内容に更新されます。）

課税上は株式投資信託として取り扱われ、日本の居住者（法人を含みます。）である受益者については、以下のような取扱いとなります。なお、税制が改正された場合には、その内容が変更されることがあります。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10%（所得税7%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率による源泉徴収が行われます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税（配当控除は適用されません。）のいずれかを選択することもできます。上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

[平成24年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10%（所得税7%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10%の税率により源泉徴収が行われます。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により10.147%（所得税7.147%および地方税3%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は10.147%の税率により源泉徴収が行われます。なお、上記10.147%の税率は平成26年1月1日以後、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）となる予定です。

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

換金（解約）時および償還時の差損（譲渡損失）については、確定申告等により上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との通算が可能です。

法人の投資家に対する課税

[平成24年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7%（所得税7%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税7.147%）の税率で源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。上記7.147%の税率は平成26年1月1日以後、15.315%（所得税15.315%）となる予定です。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、益金不算入制度は適用されません。

受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、内容が変更されることがあります。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】（下記の内容に更新されます。）

(1)【投資状況】

(平成24年6月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,673,466,035	99.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		693,589	0.01
純資産総額		5,674,159,624	100.00

(注)投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

<参考情報>

親投資信託受益証券(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24年6月29日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	73,191,823,094	56.36
	イギリス	13,005,080,526	10.01
	カナダ	6,644,437,323	5.12
	フランス	4,827,867,407	3.72
	スイス	4,756,742,185	3.66
	オーストラリア	4,513,721,951	3.47
	ドイツ	4,339,592,650	3.34
	スウェーデン	1,697,362,730	1.31
	香港	1,641,730,665	1.26
	スペイン	1,449,927,589	1.12
	オランダ	1,319,330,411	1.02
	イタリア	1,151,285,598	0.89
	シンガポール	1,012,542,702	0.78
	デンマーク	628,825,501	0.48
	ベルギー	609,320,271	0.47
	ノルウェー	503,244,050	0.39
	フィンランド	397,858,331	0.31
	イスラエル	327,550,599	0.25
	アイルランド	156,746,593	0.12
	オーストリア	150,179,469	0.11
	ポルトガル	88,879,041	0.07
	ニュージーランド	68,415,949	0.05
	ギリシャ	27,434,691	0.02
小計	122,509,899,326	94.33	
投資証券	アメリカ	2,012,821,928	1.55
	オーストラリア	379,717,368	0.29
	イギリス	149,330,843	0.12
	フランス	147,220,972	0.11
	香港	52,552,006	0.04
	シンガポール	38,834,839	0.03
	カナダ	31,751,073	0.03
	オランダ	16,607,213	0.01
	小計	2,828,836,242	2.18
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		4,533,154,658	3.49
純資産総額		129,871,890,226	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24年6月29日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (口)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資 信託受 益証券	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		6,256,579,219	0.8349	5,223,676,034	0.9068	5,673,466,035	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24年6月29日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアお よび機器	70,808	29,852	2,113,779,050	45,131	3,195,661,020	2.46
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	359,500	6,101	2,193,423,928	6,591	2,369,342,629	1.82
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	573,883	1,974	1,132,761,232	2,372	1,361,343,502	1.05
4	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	804,139	1,188	955,593,649	1,602	1,288,280,534	0.99
5	アメリカ	株式	IBM CORP	ソフトウェア・ サービス	83,661	14,350	1,200,564,748	15,180	1,269,968,458	0.98
6	アメリカ	株式	AT & T INC	電気通信サービ ス	450,616	2,232	1,005,660,393	2,807	1,264,780,382	0.97
7	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	150,300	7,724	1,160,934,466	8,205	1,233,273,513	0.95
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タ バコ	250,812	4,173	1,046,686,268	4,600	1,153,647,290	0.89
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	208,221	4,963	1,033,446,589	5,309	1,105,447,662	0.85
10	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	576,495	1,539	887,003,277	1,787	1,030,112,569	0.79
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パー ソナル用品	209,379	4,959	1,038,313,740	4,782	1,001,166,605	0.77
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO COMPANY	銀行	380,751	1,918	730,174,183	2,576	980,810,311	0.76
13	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,368,654	599	819,663,388	687	940,615,453	0.72
14	アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タ バコ	154,835	5,256	813,866,026	6,073	940,276,831	0.72
15	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-W/I	食品・飲料・タ バコ	130,933	5,910	773,793,184	6,791	889,103,443	0.68

16	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	19,650	46,243	908,672,475	44,755	879,444,122	0.68
17	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,788,263	208	788,317,197	223	843,270,980	0.65
18	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	288,874	2,270	655,687,608	2,846	822,032,218	0.63
19	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	381,887	1,870	714,178,258	2,049	782,325,039	0.60
20	アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	143,184	4,617	661,150,626	5,417	775,609,543	0.60
21	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	175,022	4,014	702,593,317	4,337	758,996,467	0.58
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	215,599	2,911	627,595,762	3,487	751,849,919	0.58
23	アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	231,474	2,738	633,662,434	3,226	746,811,695	0.58
24	イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,442,906	539	778,170,078	508	732,631,019	0.56
25	イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	278,920	2,637	735,461,200	2,614	729,051,583	0.56
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	53,418	11,653	622,467,302	13,392	715,374,336	0.55
27	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	383,869	1,684	646,393,075	1,780	683,407,815	0.53
28	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	305,723	2,356	720,224,818	2,234	683,034,923	0.53
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	119,414	5,056	603,701,949	5,520	659,162,414	0.51
30	オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	245,186	2,781	681,967,941	2,448	600,128,164	0.46
									投資比率：合計	24.00

(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24年6月29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	11.01
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.01
	食品・飲料・タバコ	7.12
	資本財	7.01
	銀行	7.00
	素材	6.45
	ソフトウェア・サービス	6.00
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.69
	各種金融	4.25
	電気通信サービス	4.07
	保険	3.81
	公益事業	3.73
	小売	2.94
	ヘルスケア機器・サービス	2.73
	メディア	2.66
	食品・生活必需品小売り	2.33
	運輸	1.76
	家庭用品・パーソナル用品	1.75
	消費者サービス	1.70

	半導体・半導体製造装置	1.55
	耐久消費財・アパレル	1.19
	自動車・自動車部品	1.13
	商業・専門サービス	0.79
	不動産	0.65
	小計	94.33
投資証券		2.18
	合計	96.51

（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24年6月29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	99	32,491,025.00	32,729,400.00	2,595,768,714	2.00
	EURO STOXX 50	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	244	5,230,616.53	5,246,000.00	517,990,040	0.40
	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	77	4,173,673.15	4,193,035.00	516,246,469	0.40
	S&P 60	モントリオール取引所	買建	カナダ・ドル	26	3,419,725.45	3,391,960.00	260,400,769	0.20
	SPI 200	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア・ドル	29	2,973,950.00	2,914,500.00	232,139,925	0.18
	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	35	2,064,669.55	2,091,250.00	171,921,662	0.13

（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24年6月29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24年6月29日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

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	分配付：	1.1486
		分配落：	1,403,203,335	分配落：	1.1486
第5期	（平成18年11月30日）	分配付：	2,290,759,537	分配付：	1.3350
		分配落：	2,290,759,537	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
第10期	(平成23年11月30日)	分配付：5,000,529,907 分配落：5,000,529,907	分配付：0.7757 分配落：0.7757
平成23年 6月末日		5,629,259,116	0.9221
7月末日		5,457,360,054	0.8831
8月末日		4,951,989,503	0.7953
9月末日		4,711,023,578	0.7462
10月末日		5,410,070,953	0.8473
11月末日		5,000,529,907	0.7757
12月末日		5,221,844,972	0.8024
平成24年 1月末日		5,420,162,147	0.8287
2月末日		6,054,168,323	0.9217
3月末日		6,247,217,561	0.9427
4月末日		6,135,271,005	0.9252
5月末日		5,496,317,706	0.8243
6月末日		5,674,159,624	0.8422

【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
第10期	(平成23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%
第10期	自平成22年12月 1日 至平成23年11月30日	10.0%
	自平成23年12月 1日 至平成24年 6月29日	8.6%

(注) 収益率は、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
第10期	自平成22年12月 1日 至平成23年11月30日	1,838,179,052	870,708,190	6,446,873,309
	自平成23年12月 1日 至平成24年 6月29日	847,930,552	557,634,671	6,737,169,190

(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24年6月29日現在）

基準価額・純資産の推移



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

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
第10期（平成23年11月30日）	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

<基準価額・純資産総額>

基準価額	8,422円
純資産総額	56.7億円

主要な資産の状況

<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	APPLE INC	2.46%
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	1.82%
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	1.05%
4	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	0.99%
5	アメリカ	株式	IBM CORP	0.96%
6	アメリカ	株式	AT & T INC	0.97%
7	アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	0.95%
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	0.89%
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	0.85%
10	アメリカ	株式	PFIZER	0.79%

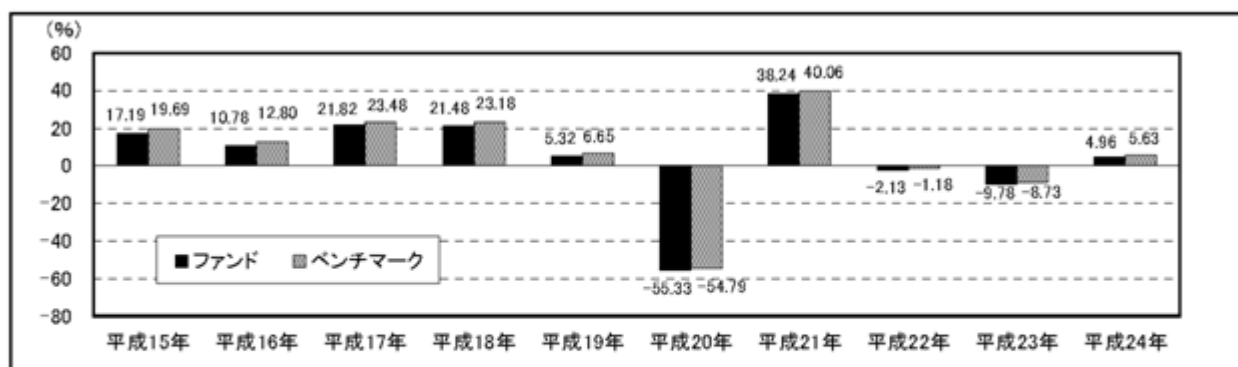
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

<業種別投資比率>

	業種	投資 比率
1	エネルギー	11.01%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.01%
3	食品・飲料・タバコ	7.12%
4	資本財	7.01%
5	銀行	7.00%
6	素材	6.45%
7	ソフトウェア・サービス	6.00%
8	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.69%
9	各種金融	4.25%
10	電気通信サービス	4.07%

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



※平成24年は6月末日までの収益率です。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

第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、「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(平成23年12月1日から平成24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)

		当中間計算期間末 (平成24年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		37,072,548
親投資信託受益証券		5,495,464,833
未収利息		71
流動資産合計		5,532,537,452
資産合計		5,532,537,452
負債の部		
流動負債		
未払解約金		6,181,868
未払受託者報酬		3,003,800
未払委託者報酬		25,532,240
その他未払費用		1,501,838
流動負債合計		36,219,746
負債合計		36,219,746
純資産の部		
元本等		
元本	1	6,667,778,730
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3	1,171,461,024
(分配準備積立金)		437,240,209
元本等合計		5,496,317,706
純資産合計		5,496,317,706
負債純資産合計		5,532,537,452

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	当中間計算期間 自平成23年12月1日 至平成24年5月31日
営業収益	
受取利息	6,940
有価証券売買等損益	335,247,090
営業収益合計	335,254,030
営業費用	
受託者報酬	3,003,800
委託者報酬	25,532,240
その他費用	1,501,838
営業費用合計	30,037,878
営業利益	305,216,152
経常利益	305,216,152
中間純利益	305,216,152
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	48,759,992
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,446,343,402
剰余金増加額又は欠損金減少額	106,958,002
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	106,958,002
剰余金減少額又は欠損金増加額	88,531,784
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	88,531,784
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,171,461,024

(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。
-------------------	--

(追加情報)

当中間計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 (平成24年 5月31日現在)
1 期首元本額	6,446,873,309円
期中追加設定元本額	705,219,039円
期中一部解約元本額	484,313,618円
2 受益権の総数	6,667,778,730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1,171,461,024円であります。

(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	当中間計算期間末 (平成24年 5月31日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	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 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
---------------------------	---

(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)

	当中間計算期間末 (平成24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)		0.8243円 (8,243円)

[次へ](#)

<参考>

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23年11月30日現在)	(平成24年 5月31日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		3,222,719,199	3,415,280,578
コール・ローン		72,472,229	163,573,832
株式		115,132,301,454	120,171,521,674
投資証券		2,139,808,577	2,700,427,706
新株予約権証券			6,481,262
派生商品評価勘定		102,583,345	13,161,030
未収入金		257,633,930	297,883,579
未収配当金		293,305,529	325,747,545
未収利息		138	313
差入委託証拠金		514,422,781	939,078,714
流動資産合計		121,735,247,182	128,033,156,233
資産合計		121,735,247,182	128,033,156,233
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		72,472,023	58,581,772
未払金		778,447,570	2,561,975,589
未払解約金		12,680,000	
流動負債合計		863,599,593	2,620,557,361
負債合計		863,599,593	2,620,557,361
純資産の部			
元本等			
元本	1	145,599,209,042	141,421,120,186
剰余金			
剰余金又は欠損金()	3	24,727,561,453	16,008,521,314
元本等合計		120,871,647,589	125,412,598,872
純資産合計		120,871,647,589	125,412,598,872
負債純資産合計		121,735,247,182	128,033,156,233

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

--	--

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券、新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p>
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（追加情報）

当期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	（平成23年11月30日現在）	（平成24年 5月31日現在）
1 期首元本額	149,320,974,556円	145,599,209,042円
期中追加設定元本額	47,205,780,885円	12,815,257,294円
期中一部解約元本額	50,927,546,399円	16,993,346,150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	13,846,279,918円	13,648,622,708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	6,022,534,020円	6,196,960,795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	10,797,541円	20,074,166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)	円	10,145,134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)	6,558,706,981円	6,419,240,311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)	982,607,092円	959,887,551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>	117,946,535円	102,385,189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>	8,488,279,084円	7,615,621,141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>	16,447,632円	14,637,356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>	108,118,871円	94,957,378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>	57,958,628円	52,006,790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>	31,162,255,758円	28,244,017,798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>	150,750,267円	136,739,703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>	5,838,663,967円	5,105,350,383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>	2,853,777,333円	2,559,026,340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>	336,277,611円	318,385,376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>	1,337,731,325円	1,214,472,729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>	10,036,239,315円	9,220,619,119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>	2,315,388,448円	2,102,815,034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>	7,911,283,279円	6,914,906,248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>	1,775,121,919円	1,604,665,626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>	4,870,104,145円	4,388,201,861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>	177,743,712円	151,633,030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>	138,312,864円	122,731,718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>	193,518,148円	177,339,373円
ステート・ストリート4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	147,726,154円	136,615,079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>	1,200,205,401円	1,048,689,041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>	10,096,262円	8,763,493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>	14,278,874円	12,752,427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>	171,530円	163,538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>	145,239,357円	122,729,921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>	22,232,551,424円	25,478,469,487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>	1,102,628,964円	965,490,994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>	142,676円	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>	186,186円	円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	円	265,467円
ワールドエクイティ・ファンドVL<適格機関投資家限定>	15,439,137,821円	16,251,737,882円
計	145,599,209,042円	141,421,120,186円
2 受益権の総数	145,599,209,042口	141,421,120,186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24,727,561,453円であります。	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16,008,521,314円であります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	(平成23年11月30日現在)	(平成24年5月31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	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載しております。</p>	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 同左</p> <p>(3)デリバティブ取引 同左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>	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	（平成23年11月30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	2,220,647,972		2,243,581,080	22,933,108
	S&P 60	275,437,497		272,268,637	3,168,860
	SPI 200	210,527,607		211,152,318	624,711
	FTSE100INDEX	469,645,035		474,156,024	4,510,989
	FSMI INDEX	174,364,657		173,996,607	368,050
	EURO STOXX 50	543,582,917		548,910,700	5,327,783

合 計	3,894,205,685		3,924,065,366	29,859,681
-----	---------------	--	---------------	------------

(単位：円)

区分	種 類	(平成24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	1,728,290,783		1,704,032,748	24,258,035
	S&P 60	179,986,510		178,794,302	1,192,208
	SPI 200	137,380,135		132,915,537	4,464,598
	FTSE100INDEX	335,564,892		329,284,878	6,280,014
	FSMI INDEX	114,878,597		115,170,509	291,912
	EURO STOXX 50	346,135,139		338,124,442	8,010,697
合 計	2,842,236,056		2,798,322,416	43,913,640	

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

通貨関連

(単位：円)

区分	種 類	(平成23年11月30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	151,030,000		151,016,466	13,534
	カナダ・ドル	91,840,000		91,813,324	26,676
	オーストラリア・ドル	14,530,000		14,532,035	2,035
	イギリス・ポンド	89,820,000		89,990,182	170,182
	香港・ドル	3,690,000		3,688,159	1,841
	スウェーデン・クローナ	33,680,000		33,789,210	109,210
	ユーロ	38,120,000		38,132,265	12,265
合 計	422,710,000		422,961,641	251,641	

(単位：円)

区分	種 類	(平成24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	370,414,300		369,703,321	710,979
	カナダ・ドル	27,554,000		27,443,252	110,748
	オーストラリア・ドル	16,960,000		16,871,800	88,200
	イギリス・ポンド	23,866,500		23,637,655	228,845
	スイス・フラン	14,211,200		14,135,660	75,540
	香港・ドル	31,820,000		31,816,868	3,132
	ユーロ	45,371,900		45,123,700	248,200
	売建				
	シンガポール・ドル	8,330,000		8,327,277	2,723
	スウェーデン・クローナ	8,390,000		8,397,725	7,725
	デンマーク・クローネ	22,830,000		22,873,518	43,518
	イスラエル・シェケル	14,320,000		14,312,938	7,062
	合 計	584,067,900		582,643,714	1,507,102

(注) 1 . 時価の算定方法

- (1) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2) 対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 2 . 換算において円未満の端数は切り捨てております。
 - 3 . 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
 - 4 . ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	(平成23年11月30日現在)	(平成24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)	0.8302円 (8,302円)	0.8868円 (8,868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24年6月29日現在)

資産総額	5,680,741,766円
負債総額	6,582,142円
純資産総額(-)	5,674,159,624円
発行済口数	6,737,169,190口
1口当たり純資産額(/)	0.8422円

<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)

(平成24年6月29日現在)

資産総額	129,932,020,573円
負債総額	60,130,347円
純資産総額(-)	129,871,890,226円
発行済口数	143,219,893,199口
1口当たり純資産額(/)	0.9068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】（下記の内容に更新されます。）

(1) 資本金の額

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24年6月29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24年6月29日現在)。

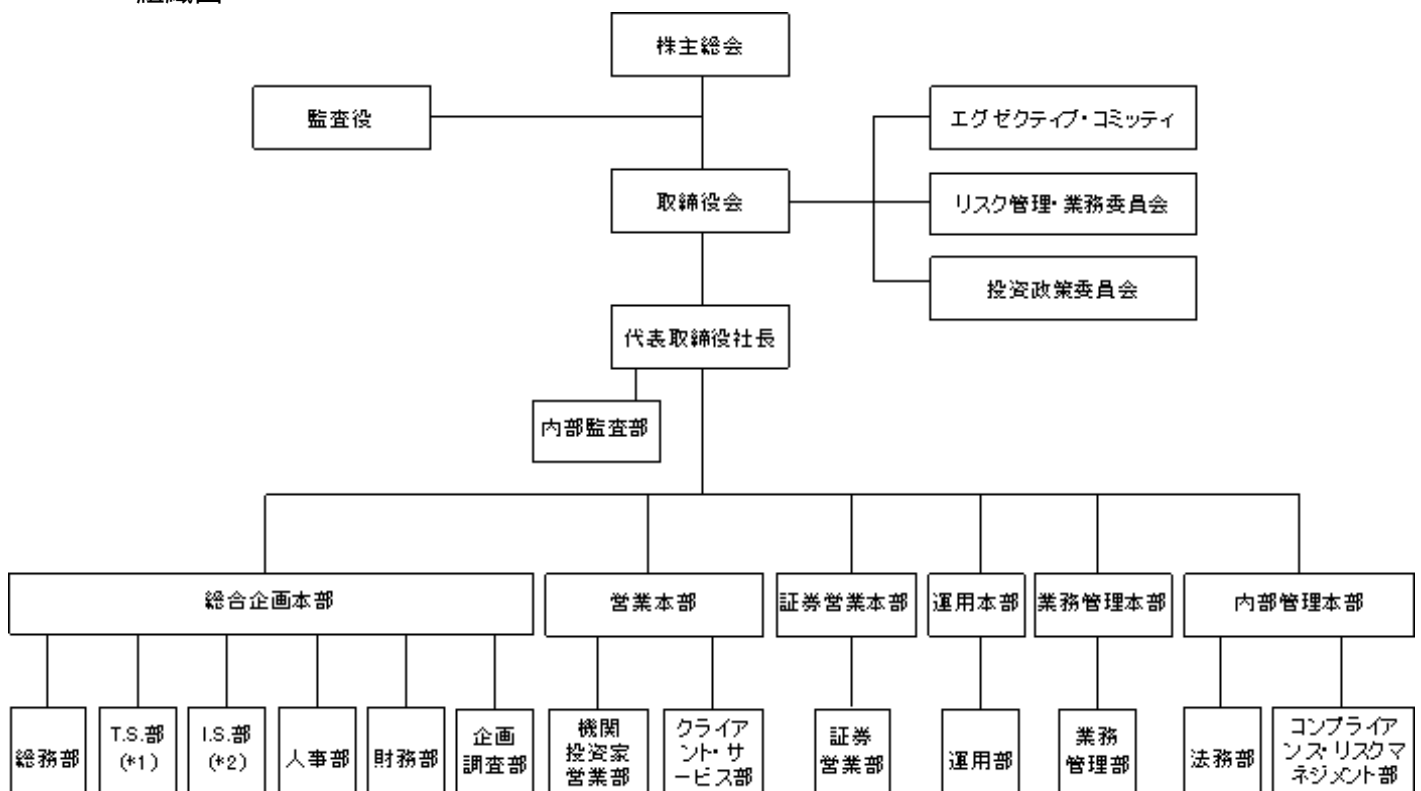
発行済株式の総数

委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成24年6月29日現在)。

(略)

(2) 委託会社の機構

組織図



内部管理本部の代表者は内部管理統括責任者の職を担う。

(*1)T.S.部はテクノロジー・サービス部、(*2)I.S.部はインフラストラクチャー・サービス部の略称。

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

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	機関投資家営業部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓、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
	クライアント・サービス部	投資運用業務、投資助言業務のサポート、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、法定書面、契約締結手続き、広告、営業イベント企画、市場動向調査等の各種ビジネス・サポート
	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[コンピューター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及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】（下記の内容に更新されます。）

「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24年6月29日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、118本であり、その純資産総額は899,779百万円です（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、当事業年度（平成23年4月1日から平成24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)

科 目	期 別	前事業年度 (平成23年3月31日現在)		当事業年度 (平成24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		51		108	
預金		6,661,535		6,846,204	
有価証券		55,860		96,020	
前払金		4,358		24,411	
前払費用		17,658		17,419	
未収入金		361,818		354,309	
未収委託者報酬		349,939		361,180	
未収収益		30,627		37,563	
未収消費税等		22,424		25,103	
未収還付法人税等		131,504		-	
繰延税金資産		24,293		37,059	
流動資産計		7,660,073	96.0	7,799,380	96.4
固定資産					
有形固定資産		172,747		160,569	
建物附属設備	1	143,387		129,885	
器具備品	1	29,360		21,984	
リース資産	1	-		8,699	
無形固定資産		1,667		3,096	
ソフトウェア	2	1,667		3,096	
投資その他の資産		143,436		125,422	
長期差入保証金		93,357		80,749	
繰延税金資産		45,229		39,823	
その他投資		4,850		4,850	
固定資産計		317,851	4.0	289,087	3.6
資産合計		7,977,925	100.0	8,088,468	100.0
(負 債 の 部)			%		%
流動負債					
預り金		84,273		37,390	
未払金		424,170		216,365	
未払手数料		109,589		106,399	
その他未払金		314,580		109,966	
未払費用		72,454		68,177	
未払法人税等		265		205,843	
未払消費税等		-		-	
賞与引当金		54,792		35,727	
リース債務		-		2,223	
流動負債計		635,955	8.0	565,728	7.0
固定負債					
役員退職慰労引当金		-		-	

退職給付引当金		84,094			69,969	
長期リース債務		-			6,448	
固定負債計		84,094	1.1		76,417	0.9
負債合計		720,050	9.0		642,146	7.9
(純資産の部)			%			%
株主資本		7,257,874	91.0		7,446,321	92.1
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,838,754			7,027,201		
純資産合計		7,257,874	91.0		7,446,321	92.1
負債・純資産合計		7,977,925	100.0		8,088,468	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22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日		自 平成23年 4月 1日 至 平成24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	3,343,307		1,938,693	
投資顧問収入	1,785,199		1,324,526	
その他営業収益	18,337		248,693	
営業収益計	5,146,844	100.0	3,511,914	100.0
営業費用				
支払手数料	1,355,270		491,137	
広告宣伝費	17,530		14,465	
公告費	2,400		1,755	
調査費	493,033		379,325	
調査費	248,560		206,637	
委託調査費	242,832		171,141	
図書費	1,640		1,546	
委託計算費	171,824		155,279	
営業雑経費	40,718		37,603	
通信費	7,033		6,683	
印刷費	8,341		10,572	
協会費	13,797		11,049	
諸会費	2,901		3,633	
その他	8,644		5,663	
営業費用計	2,080,777	40.4	1,079,565	30.7
一般管理費				
給料	1,254,505		1,338,902	
役員報酬	305,535		413,892	
給料・手当	761,648		766,394	
賞与	132,528		116,894	
賞与引当金繰入額	54,792		41,721	
退職金	2,846		-	
交際費	2,992		5,974	
旅費交通費	26,905		30,537	
租税公課	14,439		16,034	
不動産賃借料	135,683		125,330	
役員退職慰労引当金繰入額	9,188		-	
退職給付費用	60,658		62,909	
固定資産減価償却費	31,299		22,921	
福利厚生費	87,865		101,047	
事務手数料	749,844		55,825	
諸経費	118,910		117,938	

一般管理費計		2,495,141	48.5		1,877,421	53.5
営業利益		570,925	11.1		554,927	15.8
営業外収益						
受取利息		-			-	
有価証券売却益		-			-	
雑収入		572			7,304	
営業外収益計		572	0.0		7,304	0.2
営業外費用						
支払利息		-			70	
為替差損		1,144			1,769	
有価証券売却損		1,620			942	
雑損失		425			932	
営業外費用計		3,190	0.0		3,715	0.1
経常利益		568,306	16.2		558,516	15.9
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			-	
事業再構築費用		-			36,057	
事務処理損失		7,866			3,089	
特別損失計		35,159	0.7		39,147	1.1
税引前当期純利益		533,147	10.4		519,369	14.8
法人税、住民税及び事業税		275,975	5.4		338,282	9.6
法人税等調整額		25,770	0.5		7,359	0.2
当期純利益		231,401	4.5		188,446	5.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	6,607,353	6,838,754
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	6,838,754	7,027,201
利益剰余金合計		
当期首残高	6,716,473	6,947,874
当期変動額		

当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	6,947,874	7,136,321
株主資本合計		
当期首残高	7,026,473	7,257,874
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	7,257,874	7,446,321
純資産合計		
当期首残高	7,026,473	7,257,874
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	7,257,874	7,446,321

[重要な会計方針]

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。
2.固定資産の減価償却方法	(1)有形固定資産 (イ)リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 6~18年 器具備品 8年 (ロ)リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額をゼロとして算定する方法によっております。 (2)無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア(自社利用)については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。
3.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

4.引当金の計上基準	<p>(1)賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2)退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。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。</p> <p>過去勤務債務 その発生年度の従業員等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</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理</p>
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	(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。

[追加情報]

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成23年3月 31日 現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日 現在)
<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 48,437千円</p> <p>器具備品 28,565千円</p>	<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物附属設備 61,939千円</p> <p>器具備品 35,941千円</p> <p>リース資産 457千円</p>
<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 6,842千円</p>	<p>2. 無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 8,428千円</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日

<p>1. 移転価格の取扱いに係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>1. 移転価格の取扱いに係る注記 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に致しました。当会計期間には、ステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーから当社に支払われた調整額228,767千円が、損益計算書のその他営業収益に含まれております。</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日）

	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
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

当事業年度（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日）

	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
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

(リース取引関係)

前事業年度		当事業年度	
自	平成22年4月 1日	自	平成23年4月 1日
至	平成23年3月 31日	至	平成24年3月 31日

<p>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)</p> <p>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>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>リース資産の内容 社用車両であります。</p> <p>リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。</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						

(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

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成23年3月31日 現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	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	

平成24年3月31日 現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)預金	6,846,204	6,846,204	
(2)未収委託者報酬	361,180	361,180	
(3)未収入金	294,937	294,937	
(4)その他未払金	60,028	60,028	

(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年を超えるものはありません。

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

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 55,860千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 900千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額 96,020千円 当事業年度の損益 に含まれた評価差額 100千円

(デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24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。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、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23年3月 31日現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日現在)
退職給付債務	322,666	372,119
(1)年金資産	172,261	228,989
(2)退職給付引当金	84,094	69,969
(3)未認識数理計算上の差異	20,905	5,334
(4)未認識過去勤務債務	87,216	78,494

3．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日
退職給付費用	60,658	44,552
(1)勤務費用	36,339	54,763
(2)利息費用	1,988	3,226
(3)期待運用収益（減算）	966	1,253
(4)過去勤務債務の費用処理額	3,265	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	20,032	20,905

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23年3月 31日現在)	当事業年度 (平成24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	発生時より 11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22年4月 1日	自 平成23年4月 1日
至 平成23年3月 31日	至 平成24年3月 31日

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	(単位：千円)
繰延税金資産(流動)		繰延税金資産(流動)	
賞与引当金繰入超過額	17,154	賞与引当金繰入超過額	11,012
その他	19,822	未払事業税	14,990
		その他	14,803
繰延税金資産(流動)合計	36,977	繰延税金資産(流動)合計	40,805
繰延税金負債(流動)との相殺	12,683	繰延税金負債(流動)との相殺	3,746
繰延税金資産(流動)の純額	24,293	繰延税金資産(流動)の純額	37,059
繰延税金資産(固定)		繰延税金資産(固定)	
退職給付引当金	35,207	退職給付引当金	25,807
その他	13,831	その他	14,015
繰延税金資産(固定)合計	49,038	繰延税金資産(固定)合計	39,823
繰延税金負債(固定)との相殺	3,809	繰延税金負債(固定)との相殺	-
繰延税金資産(固定)の純額	45,229	繰延税金資産(固定)の純額	39,823
繰延税金資産合計	69,522	繰延税金資産合計	80,628
繰延税金負債(流動)		繰延税金負債(流動)	
事業譲受に係る調整項目	3,809	事業譲受に係る調整項目	3,559
未収還付事業税	8,873	その他	187
繰延税金負債(流動)合計	12,683	繰延税金負債(流動)合計	3,746
繰延税金負債(流動)との相殺	12,683	繰延税金負債(流動)との相殺	3,746
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)		繰延税金負債(固定)	
事業譲受に係る調整項目	3,809	事業譲受に係る調整項目	-
繰延税金負債(固定)合計	3,809	繰延税金負債(固定)合計	-
繰延税金負債(固定)との相殺	3,809	繰延税金負債(固定)との相殺	-
繰延税金負債(固定)の純額	-	繰延税金負債(固定)の純額	-
繰延税金資産の純額	69,522 =====	繰延税金資産の純額	76,882 =====

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% 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% 税効果会計適用後の 法人税等の負担率 56.5% =====	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 21.4% 税率変更による 期末繰延税金資産の減額修正 1.6% その他 0.0% 税効果会計適用後の 法人税等の負担率 63.7% =====

(企業結合関係等)

前事業年度 自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日	当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日
該当事項はありません。	同 左

(資産除去債務関係)

前事業年度(自 平成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。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24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63,661千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、データセンターの賃貸借契約期間が満了したこと、また、資産除却費用の見積額を更新したことから、3,824千円増加しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

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

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

前事業年度											
自 平成22年4月 1日											
至 平成23年3月 31日											
種 類	会社等の名 称	所在地	資本金又 は 出資金	事業の内 容 又は 職業	議決権の 所有（被 所有）割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引 金額 （千円）	科目	期末 残高 （千円）
						役員の兼 任等	事業上の関 係				
同一の親 会社を持 つ会社	ステート ・スト リート・ バンク アンド トラスト カンパ ニー	米国 マサ チュー セッツ州 ホ`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	207,364	未収入金	31,050
								ソフトウェア使用料の 支払	171,911	未払金	213,964
								投資顧問料 の支払	199,549	未払費用	15,975
								人件費等の 支払	145,191		
							事務手数料	699,910			

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ク市	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役に就任	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・マーケットツ, 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	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) 上表の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当事業年度												
自 平成23年4月 1日												
至 平成24年3月 31日												
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)	
						役員の兼任等	事業上の関係					
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アント・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	なし	助言などの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	173,013	未収入金	59,214
								ソフトウェアの使用契約	ソフトウェア使用料の支払	135,004	未払費用	14,977
								ソフトウェアの使用契約	投資顧問料の支払	147,278	未収収益	9,050
								人件費等及び事務手数料の支払	人件費等の支払	252,817		
									事務手数料の受取	228,767		
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	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	投資信託計理業務委託	36,711	前払金	24,411	
							兼職社員の人件費支払等	事務所賃借料の支払	4,890	未払金	12,010	
								人件費等の支払	111,504			

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	770 6,849	未収入金	63
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 ルクセンブルク市	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役に就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	39,445		
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	183	未収収益	94
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	1		
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ,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	15,885	未収収益	8,956

(注) 上表の金額のうち、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22年4月 1日	自	平成23年4月 1日
至	平成23年3月 31日	至	平成24年3月 31日
1株当たり純資産	1,170,624円94銭	1株当たり純資産	1,201,019円51銭
1株当たり当期純利益	37,322円82銭	1株当たり当期純利益	30,394円51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。		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	当事業年度
	自 平成22年4月 1日	自 平成23年4月 1日
	至 平成23年3月 31日	至 平成24年3月 31日
当期純利益（千円）	231,401	188,446
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）	231,401	188,446
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

（重要な後発事象）

	当事業年度
	自 平成23年4月 1日
	至 平成24年3月 31日
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

三井住友信託銀行株式会社

(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24年4月1日現在）

342,037百万円

(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24年3月現在)	(略)
三井住友信託銀行株式会社 1	342,037百万円 (平成24年4月1日現在)	(略)
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円 (平成24年3月現在)	(略)
日本生命保険相互会社	300,000百万円 2 (平成24年3月現在)	(略)
株式会社横浜銀行	215,628百万円 (平成24年3月現在)	(略)
富国生命保険相互会社	35,000百万円 2 (平成24年3月現在)	(略)
三井生命保険株式会社	167,280百万円 (平成24年3月現在)	(略)

1 平成24年4月1日付で、中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社は、中央三井アセット信託銀行株式会社と合併し、三井住友信託銀行株式会社に商号変更されました。

2 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24年7月4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23年12月1日から平成24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。

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。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、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。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表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示の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、当監査法人は、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。また、中間監査には、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中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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。

中間監査意見

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24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23年12月1日から平成24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。

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

() 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△](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月28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 丘本 正彦 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 湯原 尚 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23年4月1日から平成24年3月31日までの第15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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、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が含まれる。

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。

監査意見

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24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。

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

() 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。