

【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9月10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8月30日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書の財務諸表<参考>記載に誤りがありましたので、これを訂正するものです。

【訂正箇所および訂正事項】

平成24年2月29日付をもって提出した有価証券届出書（平成24年8月30日付の有価証券届出書の訂正届にて訂正済み、以下「原届出書」といいます。）の該当事項を次の内容に訂正します。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況 1 財務諸表」の<参考>について、以下の内容に更新・訂正いたします。

<更新・訂正後>

<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24年 5月31日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		3,415,280,578
コール・ローン		163,573,832
株式		120,171,521,674
投資証券		2,700,427,706
新株予約権証券		6,481,262
派生商品評価勘定		13,161,030
未収入金		297,883,579
未収配当金		325,747,545
未収利息		313
差入委託証拠金		939,078,714
流動資産合計		128,033,156,233
資産合計		128,033,156,233
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		58,581,772
未払金		2,561,975,589
未払解約金		
流動負債合計		2,620,557,361
負債合計		2,620,557,361
純資産の部		
元本等		
元本	1	141,421,120,186
剰余金		
剰余金又は欠損金()	3	16,008,521,314
元本等合計		125,412,598,872
純資産合計		125,412,598,872
負債純資産合計		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	株式、投資証券、新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 外国先物の評価においては、個別法に基づき、原則として知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量等を勘案して評価を行う取引所を決定しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成24年 5月31日現在)
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	145,599,209,042円 12,815,257,294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 ステート・ストリートDC外国株式インデックス・オープン 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	13,648,622,708円 6,196,960,795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)	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)	6,419,240,311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)	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>	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>	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>	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>	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>	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>	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>	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>	5,105,350,383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>	2,559,026,340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>	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>	1,214,472,729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>	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>	2,102,815,034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>	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>	1,604,665,626円
ステート・ストリート世界4資産 balan スVA45<適格機関投資家限定>	4,388,201,861円
ステート・ストリート世界4資産 balan スVA20<適格機関投資家限定>	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>	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>	177,339,373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>	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>	1,048,689,041円

ステート・ストリート・バランスファン ドV A 2 0 A <適格機関投資家限定>	8,763,493円
ステート・ストリート・バランスファン ドV A 3 5 B <適格機関投資家限定>	12,752,427円
ステート・ストリート・バランスファン ドV A 5 0 D <適格機関投資家限定>	163,538円
ステート・ストリート・バランスファン ドV A 1 0 A <適格機関投資家限定>	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V A 3 <適格機関投資家 限定>	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V A 2 0 <適格機関投資家限 定>	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V A 3 0 <適格機関投資家限 定>	円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスV A 4 0 <適格機関投資家限 定>	円
ステート・ストリート4資産インデック スバランスV A 5 0 <適格機関投資家限 定>	265,467円
ワールドエクイティ・ファンドV L <適 格機関投資家限定>	16,251,737,882円
計	141,421,120,186円
2 受益権の総数	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。
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。

3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載してあります。
	(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）」に記載してあります。
	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）

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24年 5月31日現在)	
1口当たり純資産額	0.8868円
(1万口当たり純資産額)	(8,868円)