

【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28年11月18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】 東京都港区虎ノ門一丁目23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外国債券インデックス・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 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

## 【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出したことに伴い、平成28年5月20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】

原届出書の該当事項を以下の内容に訂正します。

下線部\_\_\_\_\_は、訂正部分を示します。なお、図もしくは表が含まれる部分については、下線を省略する場合があります。

## 第一部【証券情報】

### （４）【発行（売出）価格】

<訂正前>

<略>

基準価額は、販売会社（下記「(8)申込取扱場所」を参照）にてご確認いただけます。  
また、下記においてもご照会いただけます。

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  
電話番号 03 - 4530 - 7333  
（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）  
ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

<訂正後>

<略>

基準価額は、販売会社（下記「(8)申込取扱場所」を参照）にてご確認いただけます。  
また、下記においてもご照会いただけます。

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  
電話番号 03 - 4530 - 7333  
（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）  
ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

### （８）【申込取扱場所】

<訂正前>

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の照会先までお問い合わせください。

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  
電話番号 03 - 4530 - 7333  
（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）  
ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

<訂正後>

ファンドの申込取扱場所（以下「販売会社」といいます。）については、下記の照会先までお問い合わせください。

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  
電話番号 03 - 4530 - 7333  
（受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時）

ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

当ファンドは、確定拠出年金法に基づいて加入者が拠出した資金を運用するためのファンドであり、「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド<sup>1</sup>」受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）<sup>2</sup>の動きに連動した投資成果をめざして運用を行うことを基本とします。

1 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国債券インデックス・マザー・ファンド」に変更する予定です。

2 <略>

～ <略>

当ファンドが該当する属性区分

<略>

#### ファンドの目的

当ファンドは、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド<sup>※</sup>」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

※米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月末に「外国債券インデックス・マザー・ファンド」に変更する予定です。

#### ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界主要先進国の国債および政府機関債等に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。  
※ファミリーファンド方式については、「ファンドの運用の仕組み」をご覧ください。
- 3 シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果の獲得をめざして運用を行うことを基本とします。  
※シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）とは、シティ世界国債指数（除く日本）の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。
- 4 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
したがって投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

<訂正後>

当ファンドは、確定拠出年金法に基づいて加入者が拠出した資金を運用するためのファンドであり、「外国債券インデックス・マザー・ファンド<sup>1</sup>」受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）<sup>2</sup>の動きに連動した投資成果をめざして運用を行うことを基本とします。

1 米国ボルカー・ルールの適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月31日付にて、ファンド名称から「ステート・ストリート」を削除しました。

2 <略>

～ <略>

当ファンドが該当する属性区分

< 略 >

## ファンドの目的

当ファンドは、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「外国債券インデックス・マザー・ファンド<sup>®</sup>」(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動した投資成果をめざして運用を行います。

※米国ボルカー・ルール<sup>®</sup>の適用により、マザーファンド名称に社名等の使用が禁止されたため、2016年5月31日付にて、ファンド名称から「ステート・ストリート」を削除しました。

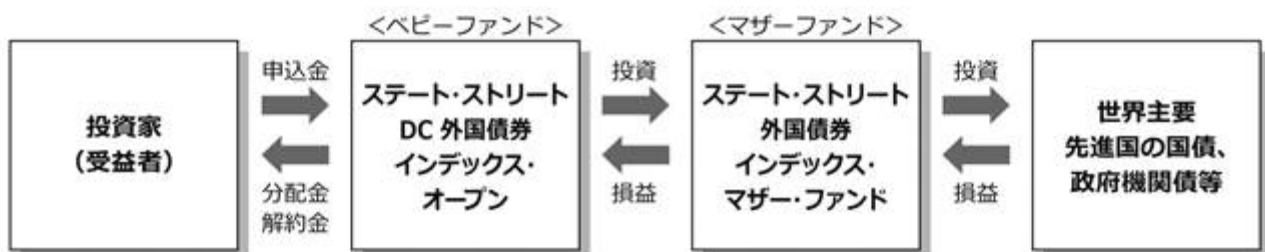
## ファンドの特色

- 1 マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界主要先進国の国債および政府機関債等に投資します。
- 2 当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行います。  
※ファミリーファンド方式については、「ファンドの運用の仕組み」をご覧ください。
- 3 シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)に連動した投資成果の獲得をめざして運用を行うことを基本とします。  
※シティ世界国債指数(除く日本、円ベース)とは、シティ世界国債指数(除く日本)の構成通貨の通貨別指数をもとに、投資信託の会計基準に合わせて委託会社が円換算のうえ合成して指数化したものです。
- 4 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。  
したがって投資対象国の通貨と円との間の為替変動により基準価額は変動します。

### (3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >



※分配金は、無手数料で再投資されます。

※マザーファンドには、「ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン」以外にも、当該マザーファンドに投資する他のファンド(ベビーファンド)があります。

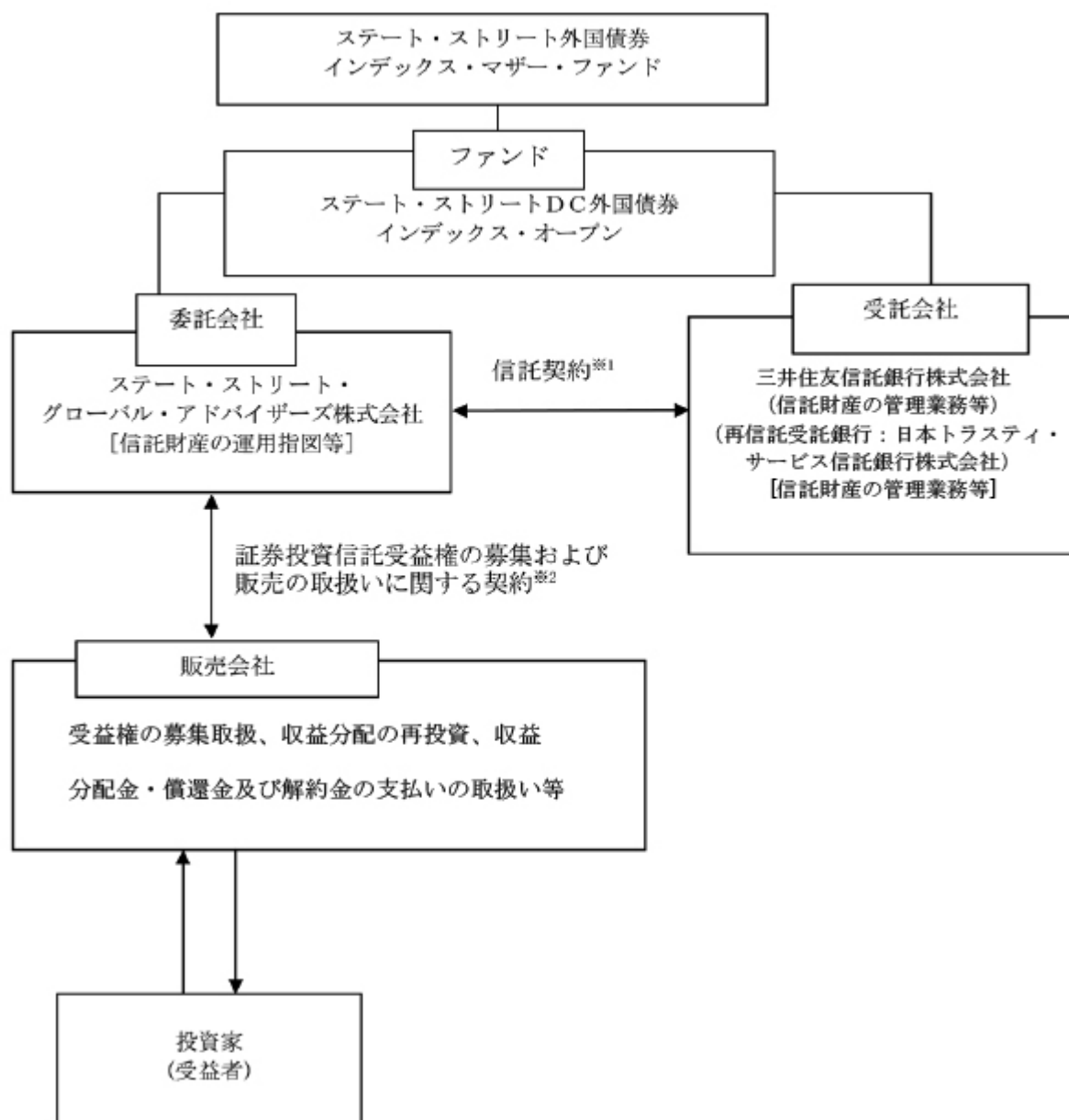
ファンドの関係法人

ファンドの関係法人は以下のとおりです。

- 1) ~ 2) < 略 >
- 3) 販売会社

< 略 >

## ファンド関係法人



&lt; 略 &gt;

## 委託会社の概況（平成28年3月31日現在）

- 1) 資本金  
3億1千万円
- 2) 沿革
 

<p>平成10年 2 月25日</p> <p>平成10年 3 月31日</p> <p>平成10年 8 月28日</p> <p>平成10年 9 月30日</p> <p>平成10年 9 月30日</p> <p>平成19年 9 月30日</p> <p>平成20年 7 月 1日</p>	<p>ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立</p> <p>投資顧問業の登録</p> <p>ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更</p> <p>投資一任契約に係る業務の認可</p> <p>証券投資信託の委託会社としての認可取得</p> <p>金融商品取引業者の登録</p> <p>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に商号変更</p>
---	--

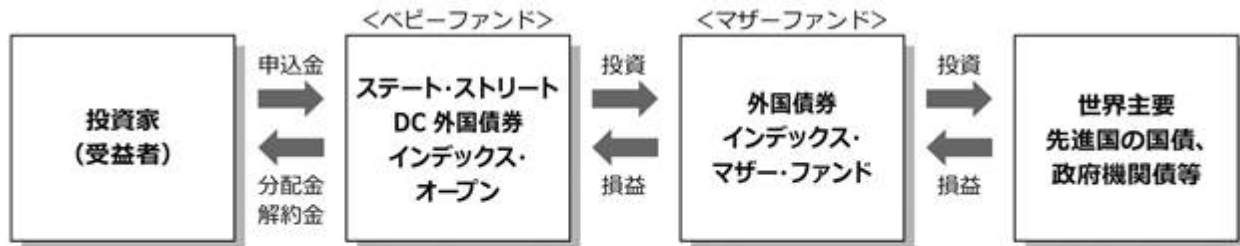
## 3) 大株主の状況

(平成28年3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・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

&lt;訂正後&gt;

&lt;略&gt;



※分配金は、無手数料で再投資されます。

※マザーファンドには、「ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン」以外にも、当該マザーファンドに投資する他のファンド(ベビーファンド)があります。

&lt;略&gt;

ファンドの関係法人

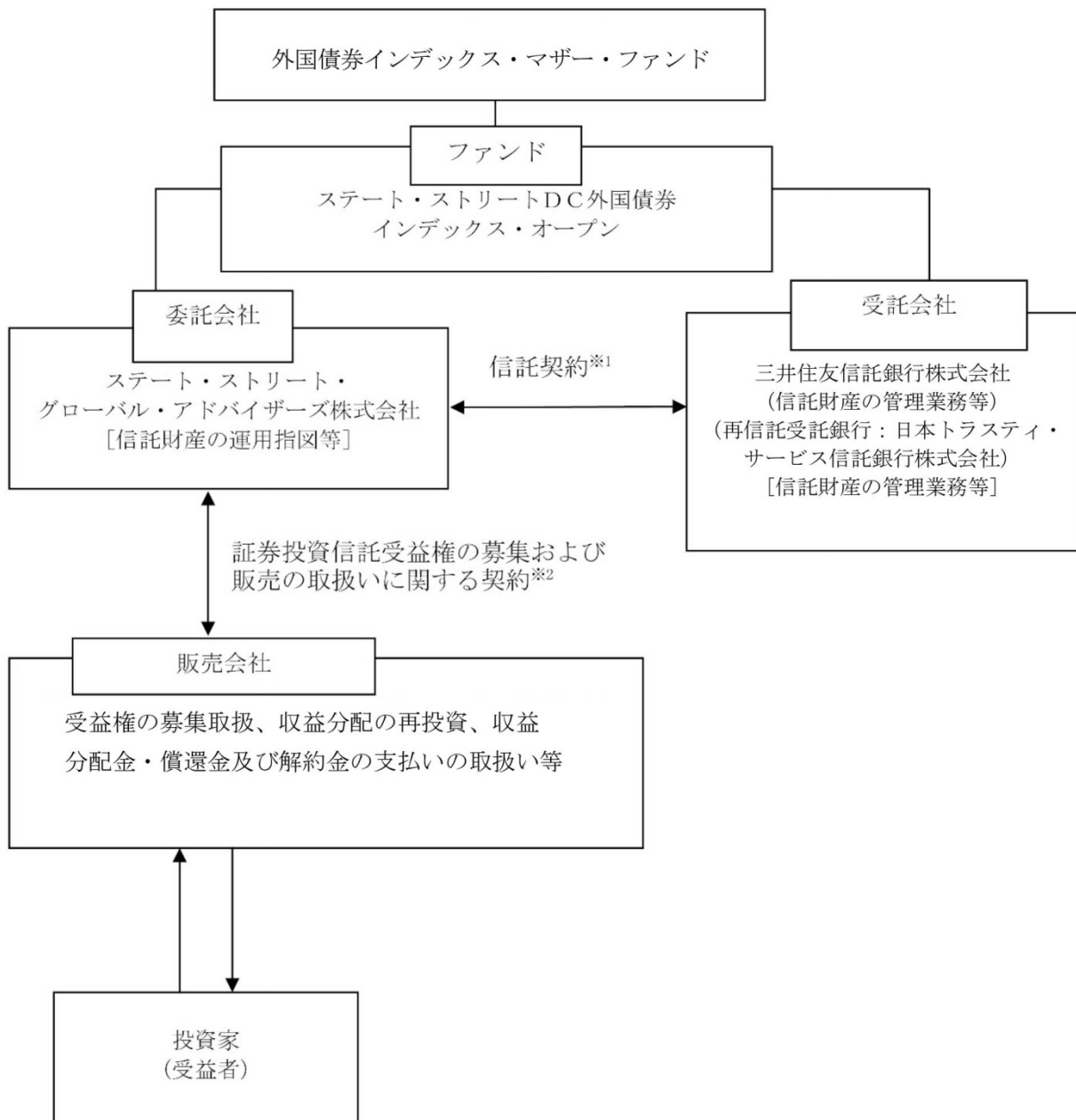
ファンドの関係法人は以下のとおりです。

1) ~ 2) &lt;略&gt;

3) 販売会社

&lt;略&gt;

## ファンド関係法人



&lt; 略 &gt;

## 委託会社の概況（平成28年9月30日現在）

- 1) 資本金  
3億1千万円
- 2) 沿革
 

平成10年 2 月25日	ステート・ストリート投資顧問株式会社 設立
平成10年 3 月31日	投資顧問業の登録
平成10年 8 月28日	ステート・ストリート投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年 9 月30日	投資一任契約に係る業務の認可
平成10年 9 月30日	証券投資信託の委託会社としての認可取得
平成19年 9 月30日	金融商品取引業者の登録
平成20年 7 月 1日	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社に商号変更



## 3) 大株主の状況

(平成28年9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・ジャパン・ホールディングス合同会社	東京都港区虎ノ門一丁目23番1号虎ノ門ヒルズ森タワー	6,200株	100%

## 2 【投資方針】

## (1) 【投資方針】

&lt; 訂正前 &gt;

ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

~ &lt; 略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

外国債券インデックス・マザー・ファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資することにより、シティ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

~ &lt; 略 &gt;

## (2) 【投資対象】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

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・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド受益証券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15条第1項）。

&lt; 以下略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

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外国債券インデックス・マザー・ファンド受益証券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15条第1項）。

&lt; 以下略 &gt;

## (3) 【運用体制】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

上記運用体制は平成28年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

上記運用体制は平成28年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## (5) 【投資制限】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

（参考）「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

（参考）「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要

当ファンドが主たる投資対象とする「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の投資方針の概要は、以下の通りです。

< 略 >

### 3【投資リスク】

< 訂正前 >

(1) ~ (2) < 略 >

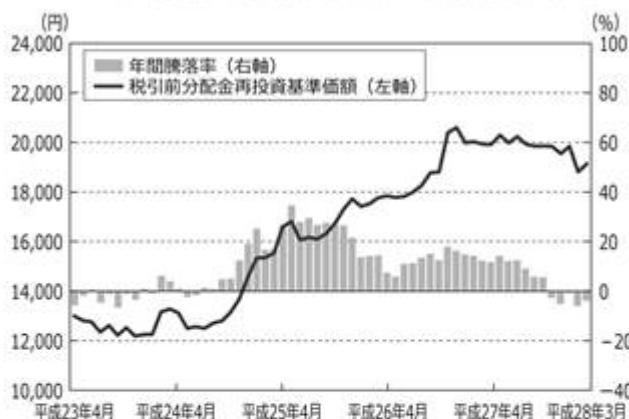
(3) リスク管理体制

< 略 >

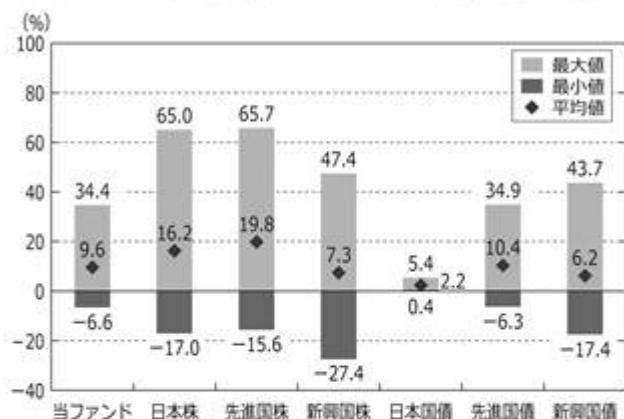
上記リスクに対する管理体制は平成28年3月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### <参考情報> 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>



<ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。  
 ※当ファンドの税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)および代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、平成23年4月～平成28年3月の5年間の各月末における直近1年前を対比して計算しており、決算日に対応した数値とは異なります。  
 ※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。  
 ※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。  
 ※代表的な資産クラスを表す指数については、最終ページにてご確認ください。

## 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券株式会社に帰属します。

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

上記「ベンチマーク」をご覧ください。

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

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

<訂正後>

(1)～(2) <略>

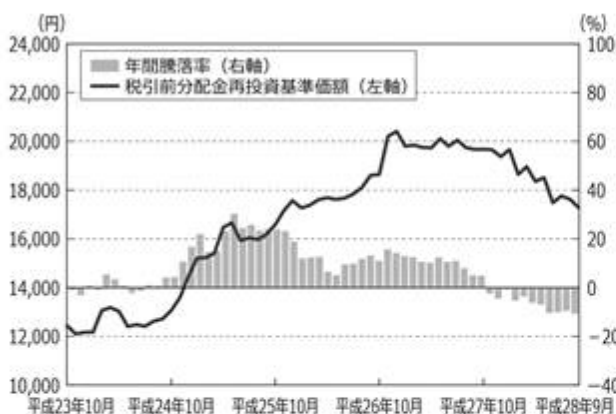
(3) リスク管理体制

<略>

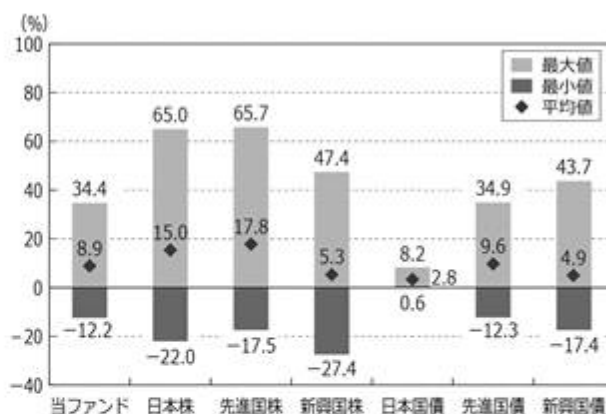
上記リスクに対する管理体制は平成28年9月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報> 代表的な資産クラスと騰落率の比較等

<ファンドの分配金再投資基準価額・年間騰落率の推移>



<ファンドと代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較>



※当ファンドの騰落率は、月末における税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)を用いて計算しています。  
 ※当ファンドの税引前の分配金再投資基準価額(信託報酬控除後)および代表的な資産クラスを表す指数の年間騰落率は、平成23年10月～平成28年9月の5年間の各月末における直近1年前を対比して計算しており、決算日に対応した数値とは異なります。

※平均値・最大値・最小値は、同期間の各月末における年間騰落率の該当値を表示しています。

※代表的な資産クラスの全てが当ファンドの投資対象とは限りません。また、海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して円換算しております。

※代表的な資産クラスを表す指数については、最終ページにてご確認ください。

## 「代表的な資産クラスとの騰落率の比較」に用いた指数

### 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)

東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

### 先進国株:MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

### 日本国債:NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、同指数に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

### 先進国債:シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

上記「ベンチマーク」をご覧ください。

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

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

## 4【手数料等及び税金】

### (3)【信託報酬等】

<訂正前>

当ファンドから支払われる信託報酬は、以下の合計額とします。

・日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とし、信託報酬率およびその配分については、下記の通りとします。

		報酬額(年率)	役務の内容
信託報酬率合計		<略>	
配 分	委託会社	<略>	<略>
	販売会社	<略>	<略>
	受託会社	<略>	<略>

<略>

<訂正後>

信託報酬の総額は、日々のファンドの純資産総額に信託報酬率を乗じて得た額とします。

信託報酬率およびその配分については、下記の通りとします。

		報酬率(年率)	役務の内容
信託報酬率合計		<略>	
配 分	委託会社	<略>	<略>
	販売会社	<略>	<略>
	受託会社	<略>	<略>

<略>

## 5【運用状況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

## (1)【投資状況】

(平成28年9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	12,110,152,708	100.01
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,065,827	0.01
純資産総額		12,109,086,881	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(外国債券インデックス・マザー・ファンド)

(平成28年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	63,795,430,823	42.55
	フランス	14,963,731,809	9.98
	イタリア	14,267,403,277	9.52
	イギリス	11,680,214,148	7.79
	ドイツ	11,097,874,642	7.40
	スペイン	8,219,485,658	5.48
	ベルギー	3,865,426,213	2.58
	オランダ	3,523,214,141	2.35
	カナダ	3,063,167,200	2.04
	オーストラリア	2,899,117,074	1.93
	オーストラリア	2,326,500,739	1.55
	メキシコ	1,239,101,075	0.83
	アイルランド	1,214,979,096	0.81
	デンマーク	1,038,971,514	0.69
	フィンランド	924,655,756	0.62
	ポーランド	885,995,228	0.59
	南アフリカ	725,906,873	0.48
	マレーシア	699,568,470	0.47
	スウェーデン	685,632,479	0.46
	シンガポール	562,029,372	0.37
ノルウェー	385,993,802	0.26	
スイス	364,376,363	0.24	
小計		148,428,775,752	98.99
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		1,508,856,153	1.01
純資産総額		149,937,631,905	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28年9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	外国債券インデック ス・マザー・ファンド		5,818,272,657	2.2365	13,012,615,316	2.0814	12,110,152,708	100.01
									投資比率：合計	100.01

(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		100.01
合計		100.01

(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（外国債券インデックス・マザー・ファンド）

投資有価証券の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成28年9月30日現在）

順位	国/ 地域 名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.625	2021/02/15	12,000,000	11,252	1,350,190,137	11,206	1,344,734,208	0.90
2	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/12/31	12,000,000	10,255	1,230,576,048	10,240	1,228,850,688	0.82
3	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2022/02/15	11,500,000	10,463	1,203,231,936	10,531	1,211,081,376	0.81
4	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.000	2045/11/15	10,200,000	10,916	1,113,448,144	11,682	1,191,614,461	0.79
5	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2021/02/28	11,000,000	10,462	1,150,874,022	10,505	1,155,511,385	0.77
6	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.250	2025/11/15	10,000,000	10,556	1,055,617,124	10,717	1,071,710,208	0.71
7	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2020/09/30	10,000,000	10,482	1,048,211,689	10,491	1,049,079,552	0.70
8	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.625	2044/02/15	7,800,000	12,377	965,373,427	13,032	1,016,515,069	0.68
9	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.875	2017/09/30	9,800,000	10,291	1,008,546,004	10,235	1,003,016,358	0.67
10	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/05/15	9,500,000	10,293	977,825,849	10,390	987,057,600	0.66
11	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	8.000	2021/11/15	7,200,000	13,811	994,404,372	13,551	975,693,127	0.65
12	イタ リア	国債 証券	ITALIAN GOVERNMENT BOND	5.000	2025/03/01	6,500,000	14,788	961,207,780	14,982	973,859,322	0.65
13	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	3.625	2020/02/15	8,800,000	11,089	975,851,683	11,011	968,973,096	0.65
14	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.375	2020/12/31	9,000,000	10,643	957,859,200	10,658	959,178,816	0.64
15	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	1.750	2022/09/30	9,000,000	10,289	925,978,434	10,388	934,897,881	0.62
16	アメ リカ	国債 証券	US TREASURY N/B	2.000	2023/02/15	8,800,000	10,453	919,890,302	10,531	926,740,531	0.62

17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2020/01/31	9,000,000	10,212	919,089,792	10,255	922,984,934	0.62
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2019/04/30	8,900,000	10,204	908,157,708	10,223	909,813,649	0.61
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2018/04/30	8,800,000	10,075	886,590,228	10,098	888,636,897	0.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2018/09/30	8,500,000	10,255	871,673,612	10,231	869,593,574	0.58
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	8,100,000	10,712	867,675,732	10,518	851,957,740	0.57
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000	2025/08/15	8,000,000	10,441	835,251,200	10,507	840,590,336	0.56
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.250	2018/11/30	8,200,000	10,233	839,105,578	10,210	837,185,625	0.56
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2019/12/31	8,200,000	10,121	829,930,265	10,179	834,656,614	0.56
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.000	2019/09/30	8,200,000	10,094	827,691,468	10,151	832,359,774	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	2022/11/15	8,000,000	10,199	815,929,190	10,309	824,694,272	0.55
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	7,500,000	10,750	806,247,456	10,751	806,330,880	0.54
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	7,500,000	10,644	798,335,258	10,497	787,287,456	0.53
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2018/08/31	7,600,000	10,286	781,753,461	10,252	779,140,520	0.52
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	7,000,000	11,077	775,360,857	11,013	770,936,857	0.51
										投資比率：合計	19.20

(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28年9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(%)
国債証券		98.99
合計		98.99

(注1) 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。

(注2) 平成28年9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

該当する事項はありません。

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

平成28年9月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期間末の純資産の推移は次の通りです。

計算期間・月末		純資産総額(円)		1口当たりの純資産額(円)	
第1期	(平成15年 2月20日)	分配付：	68,057,895	分配付：	1.1738
		分配落：	68,057,895	分配落：	1.1738

第2期	(平成16年 2月20日)	分配付： 861,482,111 分配落： 861,482,111	分配付： 1.2174 分配落： 1.2174
第3期	(平成17年 2月21日)	分配付： 2,115,938,779 分配落： 2,115,938,779	分配付： 1.2816 分配落： 1.2816
第4期	(平成18年 2月20日)	分配付： 2,881,650,764 分配落： 2,881,650,764	分配付： 1.3946 分配落： 1.3946
第5期	(平成19年 2月20日)	分配付： 4,111,428,887 分配落： 4,111,428,887	分配付： 1.5190 分配落： 1.5190
第6期	(平成20年 2月20日)	分配付： 5,110,551,727 分配落： 5,110,551,727	分配付： 1.5507 分配落： 1.5507
第7期	(平成21年 2月20日)	分配付： 4,728,933,577 分配落： 4,728,933,577	分配付： 1.2757 分配落： 1.2757
第8期	(平成22年 2月22日)	分配付： 5,652,356,831 分配落： 5,652,356,831	分配付： 1.3535 分配落： 1.3535
第9期	(平成23年 2月21日)	分配付： 5,844,801,165 分配落： 5,844,801,165	分配付： 1.2529 分配落： 1.2529
第10期	(平成24年 2月20日)	分配付： 6,754,928,437 分配落： 6,754,928,437	分配付： 1.2788 分配落： 1.2788
第11期	(平成25年 2月20日)	分配付： 8,992,060,646 分配落： 8,992,060,646	分配付： 1.5652 分配落： 1.5652
第12期	(平成26年 2月20日)	分配付： 10,318,599,428 分配落： 10,318,599,428	分配付： 1.7513 分配落： 1.7513
第13期	(平成27年 2月20日)	分配付： 13,069,782,240 分配落： 13,069,782,240	分配付： 1.9961 分配落： 1.9961
第14期	(平成28年 2月22日)	分配付： 12,645,784,716 分配落： 12,645,784,716	分配付： 1.8847 分配落： 1.8847
	平成27年 9月末日	13,136,861,634	1.9848
	10月末日	13,208,400,357	1.9856
	11月末日	13,207,164,493	1.9832
	12月末日	13,071,930,874	1.9545
	平成28年 1月末日	13,352,680,965	1.9837
	2月末日	12,619,170,151	1.8811
	3月末日	12,923,766,275	1.9135
	4月末日	12,513,007,878	1.8518
	5月末日	12,673,559,350	1.8677
	6月末日	11,999,942,407	1.7632
	7月末日	12,265,858,402	1.7912
	8月末日	12,231,321,044	1.7775
	9月末日	12,109,086,881	1.7426

## 【分配の推移】

	計算期間	一口当たりの分配金
第1期	自平成14年 3月 8日 至平成15年 2月20日	0.0000円
第2期	自平成15年 2月21日 至平成16年 2月20日	0.0000円
第3期	自平成16年 2月21日 至平成17年 2月21日	0.0000円



第4期	自平成17年 2月22日 至平成18年 2月20日	0.0000円
第5期	自平成18年 2月21日 至平成19年 2月20日	0.0000円
第6期	自平成19年 2月21日 至平成20年 2月20日	0.0000円
第7期	自平成20年 2月21日 至平成21年 2月20日	0.0000円
第8期	自平成21年 2月21日 至平成22年 2月22日	0.0000円
第9期	自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	0.0000円
第10期	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	0.0000円
第11期	自平成24年 2月21日 至平成25年 2月20日	0.0000円
第12期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	0.0000円
第13期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	0.0000円
第14期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22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 3月 8日 至平成15年 2月20日	17.4%
第2期	自平成15年 2月21日 至平成16年 2月20日	3.7%
第3期	自平成16年 2月21日 至平成17年 2月21日	5.3%
第4期	自平成17年 2月22日 至平成18年 2月20日	8.8%
第5期	自平成18年 2月21日 至平成19年 2月20日	8.9%
第6期	自平成19年 2月21日 至平成20年 2月20日	2.1%
第7期	自平成20年 2月21日 至平成21年 2月20日	17.7%
第8期	自平成21年 2月21日 至平成22年 2月22日	6.1%
第9期	自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	7.4%
第10期	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	2.1%
第11期	自平成24年 2月21日 至平成25年 2月20日	22.4%

第12期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	11.9%
第13期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	14.0%
第14期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	5.6%
	自平成28年 2月23日 至平成28年 9月30日	7.5%

(注) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末の分配基準価額（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 3月 8日 至平成15年 2月20日	57,982,907	0	57,982,907
第2期	自平成15年 2月21日 至平成16年 2月20日	711,594,979	61,965,529	707,612,357
第3期	自平成16年 2月21日 至平成17年 2月21日	1,093,600,690	150,193,723	1,651,019,324
第4期	自平成17年 2月22日 至平成18年 2月20日	840,451,795	425,250,550	2,066,220,569
第5期	自平成18年 2月21日 至平成19年 2月20日	1,073,829,994	433,402,976	2,706,647,587
第6期	自平成19年 2月21日 至平成20年 2月20日	1,151,409,543	562,395,610	3,295,661,520
第7期	自平成20年 2月21日 至平成21年 2月20日	1,110,387,838	698,996,995	3,707,052,363
第8期	自平成21年 2月21日 至平成22年 2月22日	885,529,173	416,325,912	4,176,255,624
第9期	自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日	935,633,624	446,851,818	4,665,037,430
第10期	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	1,139,314,633	522,256,582	5,282,095,481
第11期	自平成24年 2月21日 至平成25年 2月20日	1,006,067,684	543,298,196	5,744,864,969
第12期	自平成25年 2月21日 至平成26年 2月20日	1,127,463,336	980,370,944	5,891,957,361
第13期	自平成26年 2月21日 至平成27年 2月20日	1,409,159,825	753,494,993	6,547,622,193
第14期	自平成27年 2月21日 至平成28年 2月22日	1,115,329,592	953,085,362	6,709,866,423
	自平成28年 2月23日 至平成28年 9月30日	638,279,199	399,323,873	6,948,821,749

(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 第1期の設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

## (参考情報) 運用実績

## 基準価額・純資産の推移

(平成28年9月30日現在)



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

## &lt;基準価額・純資産総額&gt;

基準価額	17,426円
純資産総額	12,109百万円

## 分配の推移

計算期間	分配金
第10期 (平成24年 2月20日)	0円
第11期 (平成25年 2月20日)	0円
第12期 (平成26年 2月20日)	0円
第13期 (平成27年 2月20日)	0円
第14期 (平成28年 2月22日)	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

## 主要な資産の状況

## &lt;銘柄別投資比率&gt;

国/地域名	種類	銘柄名	利率	償還日	投資比率	
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625%	2021/02/15	0.90%
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.375%	2018/12/31	0.82%
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000%	2022/02/15	0.81%
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.000%	2045/11/15	0.79%
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000%	2021/02/28	0.77%
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.250%	2025/11/15	0.71%
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.000%	2020/09/30	0.70%
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625%	2044/02/15	0.68%
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875%	2017/09/30	0.67%
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.750%	2022/05/15	0.66%

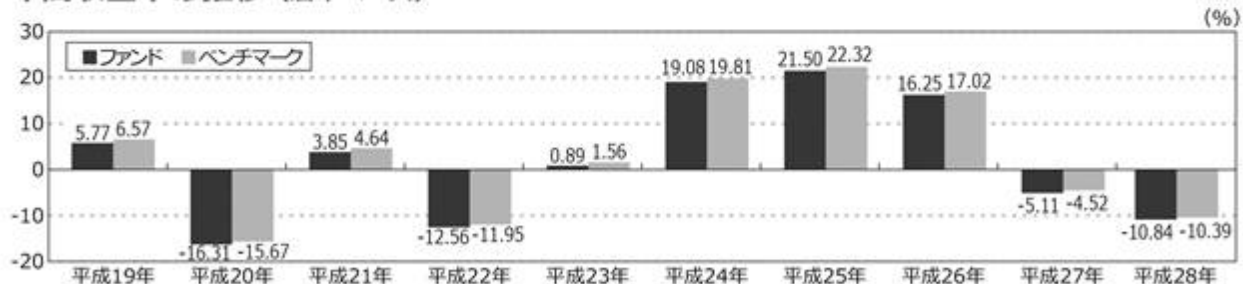
(注) 投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

## &lt;国/地域別投資比率&gt;

国/地域名	種類	投資比率	
1	アメリカ	国債証券	42.55%
2	フランス	国債証券	9.98%
3	イタリア	国債証券	9.52%
4	イギリス	国債証券	7.79%
5	ドイツ	国債証券	7.40%
6	スペイン	国債証券	5.48%
7	ベルギー	国債証券	2.58%
8	オランダ	国債証券	2.35%
9	カナダ	国債証券	2.04%
10	オーストラリア	国債証券	1.93%

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

## 年間収益率の推移 (暦年ベース)



※平成28年のファンドとベンチマークの収益率は9月末までで算出しております。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

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

## 第2【管理及び運営】

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### <訂正前>

1)~2) <略>

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

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

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：[www.ssga.com](http://www.ssga.com)

##### <訂正後>

1)~2) <略>

3) 基準価額の公表

基準価額は、販売会社でご確認いただけます。

また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

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

電話番号 03 - 4530 - 7333

(受付時間：原則として委託会社の毎営業日午前9時～午後5時)

ホームページアドレス：[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)

#### (5)【その他】

##### <訂正前>

1)~3) <略>

4) 運用報告書の交付

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成し、販売会社を通じて知られたる受益者に対して交付します。

5)~6) <略>

##### <訂正後>

1)~3) <略>

4) 運用報告書の交付（信託約款第54条）

毎決算時（毎年2月20日。ただし、該当日が休日の場合は翌営業日。）および償還時に、期中の運用経過等を記載した運用報告書を作成します。

(a)交付運用報告書は、知られたる受益者に対して販売会社を通じて交付されます。

(b)運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページ（[www.ssga.com/jp](http://www.ssga.com/jp)）に掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、販売会社を通じて交付されます。

5)~6) <略>

### 第3【ファンドの経理状況】

< 訂正前 >

( 1 ) < 略 >

( 2 ) < 略 >

< 訂正後 >

( 1 ) < 略 >

( 2 ) < 略 >

( 3 ) 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。

( 4 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成28年2月23日から平成28年8月22日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 1 【財務諸表】

末尾に「中間財務諸表」を追加します。

< 末尾追加 >

## 中間財務諸表

ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン

## ( 1 ) 【中間貸借対照表】

( 単位 : 円 )

	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	45,143,953	119,379
コール・ローン	983,210	44,132,697
親投資信託受益証券	12,645,079,492	11,954,569,193
流動資産合計	12,691,206,655	11,998,821,269
<b>資産合計</b>	12,691,206,655	11,998,821,269
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	3,714,493	4,898,542
未払受託者報酬	3,439,035	3,197,501
未払委託者報酬	36,108,411	33,255,589
未払利息	-	128
その他未払費用	2,160,000	2,160,037
流動負債合計	45,421,939	43,511,797
<b>負債合計</b>	45,421,939	43,511,797
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	1 6,709,866,423	1 6,861,827,658
<b>剰余金</b>		
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	5,935,918,293	5,093,481,814
(分配準備積立金)	3,132,003,593	2,974,205,808
元本等合計	12,645,784,716	11,955,309,472
<b>純資産合計</b>	12,645,784,716	11,955,309,472
<b>負債純資産合計</b>	12,691,206,655	11,998,821,269

## （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27年 2月21日 至 平成27年 8月20日	当中間計算期間 自 平成28年 2月23日 至 平成28年 8月22日
<b>営業収益</b>		
受取利息	1,606	-
有価証券売買等損益	349,579,596	931,016,410
その他収益	53	-
<b>営業収益合計</b>	<b>349,581,255</b>	<b>931,016,410</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	-	10,281
受託者報酬	3,348,590	3,197,501
委託者報酬	35,162,823	33,255,589
その他費用	2,160,000	2,162,084
<b>営業費用合計</b>	<b>40,671,413</b>	<b>38,625,455</b>
営業利益又は営業損失（ ）	308,909,842	969,641,865
経常利益又は経常損失（ ）	308,909,842	969,641,865
中間純利益又は中間純損失（ ）	308,909,842	969,641,865
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	3,037,925	19,628,296
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,522,160,047	5,935,918,293
剰余金増加額又は欠損金減少額	589,496,066	417,620,165
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	589,496,066	417,620,165
剰余金減少額又は欠損金増加額	572,621,954	310,043,075
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	572,621,954	310,043,075
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	<b>6,844,906,076</b>	<b>5,093,481,814</b>

## (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。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 平成28年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成28年2月23日から平成28年8月22日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	6,547,622,193円	6,709,866,423円
期中追加設定元本額	1,115,329,592円	503,471,180円
期中一部解約元本額	953,085,362円	351,509,945円
2 受益権の総数	6,709,866,423口	6,861,827,658口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。  (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左  (2)有価証券 売買目的有価証券 同左



3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	(3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。  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。	(3)デリバティブ取引 同左  同左
---------------------------	---	-----------------------------

(有価証券関係に関する注記)  
該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)  
該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前計算期間末 (平成28年 2月22日現在)	当中間計算期間末 (平成28年 8月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8847円 (18,847円)	1.7423円 (17,423円)

#### <参考>

当ファンドは「外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、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。

「外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表 (単位：円)

区 分	注記 番号	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
預金		894,688,759	709,211,004
金銭信託		228,226,721	328,815
コール・ローン		4,970,649	121,558,375
国債証券		157,110,348,596	149,441,292,460
派生商品評価勘定		2,390,400	
未収入金		705,397,652	800,871,440
未収利息		1,514,348,734	1,272,823,781
前払費用		28,008,805	63,280,968
流動資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843
資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843

負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		427,200	
未払金			947,631,914
未払解約金		1,699,257,258	66,655,000
未払利息			353
その他未払費用			442
流動負債合計		1,699,684,458	1,014,287,709
負債合計		1,699,684,458	1,014,287,709
純資産の部			
元本等			
元本	1	70,807,053,573	72,799,330,559
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		87,981,642,285	78,595,748,575
元本等合計		158,788,695,858	151,395,079,134
純資産合計		158,788,695,858	151,395,079,134
負債純資産合計		160,488,380,316	152,409,366,843

## (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>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>
2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<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 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>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	(平成28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1 期首元本額	93,621,001,523円	70,807,053,573円
期中追加設定元本額	15,970,215,085円	11,971,227,143円
期中一部解約元本額	38,784,163,035円	9,978,950,157円
元本の内訳		
ファンド名		
ステート・ストリートDC外国債券インデックス・オープン	5,638,579,993円	5,748,494,515円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	13,076,343円	13,292,507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)	61,405,248円	78,814,435円
海外国債インデックス・ファンド 適格機関投資家限定	279,991,019円	円
外国債券インデックス・ファンド/ 為替ヘッジ付き(年金1) < 適格機関 投資家限定 >	1,492,168,040円	2,596,507,751円
外国債券パッシブ・ファンド < 適格 機関投資家限定 >	8,960,328,412円	8,313,589,602円
バランスファンドVA30A < 適格機関投 資家限定 >	26,395,685円	20,092,632円
バランスファンドVA30B < 適格機関投 資家限定 >	3,770,477,898円	2,705,743,591円
バランスファンドVA40A < 適格機関投 資家限定 >	317,363円	328,881円
バランスファンドVA40B < 適格機関投 資家限定 >	35,052,645円	38,188,169円
バランスファンドVA50A < 適格機関投 資家限定 >	6,470,910円	5,883,560円
バランスファンドVA50B < 適格機関投 資家限定 >	11,276,376,409円	11,111,999,262円
外国債券インデックス・ファンドVA1 < 適格機関投資家限定 >	382,866,199円	336,718,421円
バランスファンドVA50C < 適格機関投 資家限定 >	20,017,905円	12,996,037円
バランスファンドVA25A < 適格機関投 資家限定 >	5,453,974,047円	5,169,106,442円
バランスファンドVA37.5A < 適格機関 投資家限定 >	1,985,114,455円	1,964,086,978円
バランスファンドVA75A < 適格機関投 資家限定 >	55,498,781円	51,720,996円
4資産バランス20VA < 適格機関投資家 限定 >	454,677,212円	506,653,510円
4資産バランス40VA < 適格機関投資家 限定 >	1,506,849,551円	1,201,143,598円
4資産バランス30VA < 適格機関投資家 限定 >	676,329,234円	671,374,745円

バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	5,046,371,273円	4,970,924,195円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	523,220,146円	520,353,498円
世界4資産バランスVA45<適格機関投資家限定>	1,103,520,704円	1,112,267,199円
外国債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	288,454,006円	297,329,932円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	114,367,726円	121,028,930円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	65,727,530円	70,368,279円
外国債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	716,413,612円	1,103,994,678円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	43,432,480円	41,205,054円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	881,281,263円	915,441,949円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	6,542,069円	6,703,256円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	9,187,897円	9,611,205円
バランスファンドVA50D<適格機関投資家限定>	104,299円	円
外国債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	12,829,440,380円	13,909,843,006円
外国債券インデックス・ファンドA<適格機関投資家限定>	341,665,536円	722,685,619円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	1,472,157,148円	1,479,110,120円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	2,477,695,241円	2,544,089,560円
外国債券インデックス・ファンドA/為替ヘッジ付き<適格機関投資家限定>	1,362,187,622円	2,221,576,472円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	38,772,789円	38,541,501円
外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付きVA4<適格機関投資家限定>	31,804,629円	21,820,573円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)年金<適格機関投資家限定>	1,966,382円	円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	760,270,336円	647,467,877円
フレックス資産配分戦略ファンド<適格機関投資家限定>	596,092,651円	707,548,043円
Tadリスクバジェット型マルチ配分戦略ファンド(ステイブル)<適格機関投資家限定>	410,505円	円

ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン	円	30,237,382円
ステート・ストリート先進国債券インデックス・オープン（為替ヘッジあり）	円	67,951,789円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド年金為替ヘッジ	円	227,667,620円
世界国債タームスプレッド・プレミア戦略ファンド／為替ヘッジ付	円	464,827,190円
計	70,807,053,573円	72,799,330,559円
2 受益権の総数	70,807,053,573口	72,799,330,559口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	（平成28年 2月22日現在）	（平成28年 8月22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 該当する事項はありません。</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>	<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）

取引の時価等に関する事項  
通貨関連

（単位：円）

区 分	種 類	（平成28年 2月22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 売建 アメリカ・ドル オーストラリア・ドル イギリス・ポンド メキシコ・ペソ ポーランド・ズロチ ユーロ	790,585,000 8,050,300 80,830,000 33,841,500 54,245,000 615,749,400		789,880,000 8,076,000 80,655,000 33,990,000 54,473,000 614,264,000	705,000 25,700 175,000 148,500 228,000 1,485,400
	合 計	1,583,301,200		1,581,338,000	1,963,200

（平成28年8月22日現在）

該当する事項はありません。

（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28年 2月22日現在)	(平成28年 8月22日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2426円 (22,426円)	2.0796円 (20,796円)

## 2【ファンドの現況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

【純資産額計算書】

(平成28年9月30日現在)

資産総額	12,126,843,003円
負債総額	17,756,122円
純資産総額( - )	12,109,086,881円
発行済口数	6,948,821,749口
1口当たり純資産額( / )	1.7426円

<参考情報>

親投資信託受益証券(外国債券インデックス・マザー・ファンド)

(平成28年9月30日現在)

資産総額	150,119,262,119円
負債総額	181,630,214円
純資産総額( - )	149,937,631,905円
発行済口数	72,036,805,846口
1口当たり純資産額( / )	2.0814円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

#### 1【委託会社等の概況】

##### (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28年9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28年9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28年9月30日現在)。

最近5年間にける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

##### (2) 委託会社の機構

会社の意思決定機構

取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定します。代表取締役社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、代表取締役社長に事故があるときにその職務を代行します。監査役は、委託会社の会計監査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。

投資運用の意思決定機構

###### 1) 運用基本方針の決定

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

###### 2) 運用実施計画の作成

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

###### 3) 運用の実行

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、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、第一種金融商品取引業及び第二種金融商品取引業を行っています。

平成28年9月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計126本であり、その純資産総額は1,246,983百万円です(親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)



### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、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27年4月1日から平成28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27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(資産の部)		%		%
流動資産				
預金	8,366,245		6,002,331	
有価証券	38,658		6,448	
差入保証金	61,568		-	
前払金	34,267		94,019	
前払費用	16,572		19,057	
未収入金	631,179		527,437	
未収委託者報酬	620,043		544,116	
未収収益	20,425		28,476	
繰延税金資産	89,899		969,336	
流動資産計	9,878,861	97.4	8,191,223	74.4
固定資産				
有形固定資産	153,132		130,133	
建物附属設備	1	-	103,983	
器具備品	1	302	22,098	
リース資産	1	6,365	4,051	
建設仮勘定		146,463	-	
無形固定資産		804	201	
ソフトウェア	2	804	201	
投資その他の資産		108,598	2,686,381	
長期差入保証金		80,034	75,114	
繰延税金資産		23,714	2,606,416	
その他投資		4,850	4,850	
固定資産計		262,535	2,816,715	25.6
資産合計		10,141,396	11,007,938	100.0

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 (平成27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28年3月31日現在)	
	金 額	構成比	金 額	構成比
(負債の部)		%		%
流動負債				
預り金		35,845	59,514	
未払金		560,375	586,597	
未払手数料	135,048		112,932	
その他未払金	425,326		473,664	
未払費用		11,999	1,560	
未払法人税等		154,604	3,917,946	
未払消費税等		89,514	39,613	
賞与引当金		53,368	58,531	

リース債務		-			1,861	
流動負債計		905,707	8.9		4,665,626	42.4
固定負債						
退職給付引当金		58,673			73,140	
長期リース債務		6,502			2,834	
固定負債計		65,175	0.6		75,974	0.7
負債合計		970,883	9.6		4,741,600	43.1
(純資産の部)			%			%
株主資本		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	8,751,393			5,847,217		
純資産合計		9,170,513	90.4		6,266,337	56.9
負債・純資産合計		10,141,396	100.0		11,007,938	100.0

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別 科 目	前事業年度 自平成26年4月1日 至平成27年3月31日		当事業年度 自平成27年4月1日 至平成28年3月31日	
	金 額	構成比	金 額	構成比
営業収益		%		%
委託者報酬	2,546,857		2,509,890	
投資顧問収入	1,644,728		1,578,998	
その他営業収益	37,200		155,119	
営業収益計	4,228,786	100.0	4,244,008	100.0
営業費用				
支払手数料	590,805		559,139	
広告宣伝費	16,509		16,680	
公告費	1,190		1,190	
調査費	379,903		410,480	
調査費	257,107		265,829	
委託調査費	120,214		142,735	
図書費	2,581		1,915	
委託計算費	166,328		151,283	
営業雑経費	36,320		42,905	
通信費	5,792		4,838	
印刷費	7,774		11,461	
協会費	10,010		10,719	
諸会費	2,763		4,744	
その他	9,978		11,140	
営業費用計	1,191,058	28.2	1,181,679	27.8
一般管理費				
給料	1,319,517		1,209,889	

役員報酬	337,945			289,386		
給料・手当	689,216			689,687		
賞与	257,155			187,055		
賞与引当金繰入額	35,199			43,760		
交際費		3,610			2,655	
旅費交通費		32,522			27,724	
租税公課		17,227			99,542	
不動産賃借料		126,366			85,870	
退職給付費用		57,683			80,570	
固定資産減価償却費		16,581			25,224	
福利厚生費		80,872			84,742	
事務手数料	1	84,588			522,979	
諸経費		183,190			148,610	
一般管理費計		1,922,160	45.5		2,287,811	53.9
営業利益		1,115,567	26.4		774,517	18.2
営業外収益						
受取利息		0			0	
有価証券運用益		678			-	
雑収入		3,846			278	
営業外収益計		4,525	0.1		278	0.0
営業外費用						
支払利息		201			174	
為替差損		2,420			2,081	
有価証券運用損		-			1,242	
雑損失		500			360	
営業外費用計		3,122	0.1		3,858	0.1
経常利益		1,116,969	26.4		770,936	18.2
特別損失						
固定資産減損損失	2	95,541			-	
固定資産除却損失		3,268			-	
事業再構築費用		-			101,509	
事務処理損失		15,453			173	
特別損失計		114,263	2.7		101,682	2.4
税引前当期純利益		1,002,706	23.7		669,254	15.8
法人税、住民税及び事業税		426,689	10.1		4,035,569	95.1
法人税等調整額		8,861	0.2		3,462,138	81.6
当期純利益		567,156	13.4		95,824	2.3

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本							株主資本 合計	純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			利益剰余金 合計		
		資本 準備金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益 剰余金				
					別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,184,237	8,293,357	8,603,357	8,603,357
当期変動額									
当期純利益	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156

当期変動額合計	-	-	-	-	-	567,156	567,156	567,156	567,156
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株 主 資 本								純資産合計	
	資本金	資本剰余金		利益剰余金			株主資本合計			
		資本準備金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金					利益剰余金合計
					別途積立金	繰越利益剰余金				
当期首残高	310,000	-	-	77,500	31,620	8,751,393	8,860,513	9,170,513	9,170,513	
当期変動額										
剰余金の配当	-	-	-	-	-	3,000,000	3,000,000	3,000,000	3,000,000	
当期純利益	-	-	-	-	-	95,824	95,824	95,824	95,824	
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,904,175	2,904,175	2,904,175	2,904,175	
当期末残高	310,000	-	-	77,500	31,620	5,847,217	5,956,337	6,266,337	6,266,337	

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	有価証券 売買目的有価証券 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。
2. 固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 リース資産以外の有形固定資産 定額法により償却しております。なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備 9～10年 器具備品 3～7年 リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引にかかるリース資産 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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用 その発生年度の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異 発生の翌事業年度に一括損益処理しております。</p>
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	<p>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>

(未適用の会計基準等)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日）

(1)概要

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」は、日本公認会計士協会における税効果会計に関する会計上の実務指針及び監査上の実務指針（会計処理に関する部分）を企業会計基準委員会に移管するに際して、企業会計基準委員会が、当該実務指針のうち主に日本公認会計士協会監査委員会報告第66号「繰延税金資産の回収可能性の判断に関する監査上の取扱い」において定められている繰延税金資産の回収可能性に関する指針について、企業を5つに分類し、当該分類に応じて繰延税金資産の計上額を見積るという取扱いの枠組みを基本的に踏襲した上で、分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの一部について必要な見直しを行ったもので、繰延税金資産の回収可能性について、「税効果会計に係る会計基準」（企業会計審議会）を適用する際の指針を定めたものであります。

（分類の要件及び繰延税金資産の計上額の取扱いの見直し）

- ・（分類1）から（分類5）に係る分類の要件をいずれも満たさない企業の取扱い
- ・（分類2）及び（分類3）に係る分類の要件
- ・（分類2）に該当する企業におけるスケジューリング不能な将来減算一時差異に関する取扱い
- ・（分類3）に該当する企業における将来の一時差異等加減算前課税所得の合理的な見積可能期間に関する取扱い
- ・（分類4）に係る分類の要件を満たす企業が（分類2）又は（分類3）に該当する場合の取扱い

(2)適用予定日

平成28年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）



	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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1. 発行済株式の総数に関する事項

	当事業年度期首	当期増加株式数	当期減少株式数	当事業年度末
発行済株式	6,200株	-	-	6,200株

2. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

（決議）	株式の種類	配当金の総額	1株あたりの配当額	基準日	効力発生日
平成28年3月24日 取締役会	普通株式	3,000,000千円	483,870.96円	平成27年9月30日	平成28年3月25日

3. 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が当事業年度の末日後となるもの。  
該当ありません。

（リース取引関係）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
所有権移転外ファイナンス・リース取引	同左
リース資産の内容 社用車両であります。	
リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減却償却方法」に記載の通りであります。	

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言業、第二種金融商品取引業及び第一種金融商品取引業を行っております。これらの事業を行うための資金運用については、短期的な預金等に限定し、資金調達については、現状必要性を想定しておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託及び投資法人に関する法律により、信託銀行において分別管理される信託財産のため、当該報酬は、計理上日々の未払委託者報酬として投資信託財産の負債項目に計上されております。このため、顧客の信用リスクは限定されております。

同じく営業債権である未収投資顧問料は、概ね6か月以内に回収される債権であり、また顧客の業種等も多岐にわたり分散されていることから、顧客の信用リスクは限定されております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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27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	8,366,245	8,366,245	



(2)未収委託者報酬	620,043	620,043	
(3)未収入金	631,179	631,179	
(4)長期差入保証金	80,034	35,636	44,398
(5)未払手数料	135,048	135,048	

## (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(5)未払手数料

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。

## (4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

## (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

記載すべき事項はありません。

平成28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	6,002,331	6,002,331	
(2)未収委託者報酬	544,116	544,116	
(3)未収入金	527,437	527,437	
(4)長期差入保証金	75,114	45,594	29,520
(5)未払手数料	112,932	112,932	

## (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(5)未払手数料

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。

## (4) 長期差入保証金

原状回復費見積り額を控除した将来のキャッシュフローを賃貸借契約終了期日までの期間および信用リスクなどを加味した利率により割り引いた現在価値によっております。

## (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

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27年3月31日現在)		当事業年度 (平成28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	38,658千円	貸借対照表計上額	6,448千円
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	311千円	に含まれた評価差額	1,448千円

## (デリバティブ取引関係)

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

平成23年4月1日に確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、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. 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付債務の期首残高	391,473
勤務費用	46,659
利息費用	3,914
数理計算上の差異の発生額	7,645
退職給付の支払額	8,106
退職給付債務の期末残高	426,295

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付債務の期首残高	426,295
勤務費用	46,270
利息費用	4,262
数理計算上の差異の発生額	20,018
退職給付の支払額	38,975
退職給付債務の期末残高	457,872

## 3. 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
年金資産の期首残高	278,789

期待運用収益	2,052
数理計算上の差異の発生額	11,804
事業主からの拠出額	50,203
退職給付の支払額	8,106
年金資産の期末残高	311,134

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
年金資産の期首残高	311,134
期待運用収益	2,295
数理計算上の差異の発生額	6,922
事業主からの拠出額	46,651
退職給付の支払額	38,975
年金資産の期末残高	328,027

## 4. 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
積立型制度の退職給付債務	426,295
年金資産	311,134
	115,161
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	115,161
未認識数理計算上の差異	4,158
未認識過去勤務費用	52,329
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	58,673

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
積立型制度の退職給付債務	457,872
年金資産	328,027
	129,844
非積立型制度の退職給付債務	-
未積立退職給付債務	129,844
未認識数理計算上の差異	13,096
未認識過去勤務費用	43,608

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	73,140
---------------------	--------

## 5．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日
退職給付費用	42,241
(1)勤務費用	46,659
(2)利息費用	3,914
(3)期待運用収益（減算）	2,052
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	15,002

(単位：千円)

	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
退職給付費用	61,118
(1)勤務費用	46,270
(2)利息費用	4,262
(3)期待運用収益（減算）	2,295
(4)過去勤務費用の費用処理額	8,721
(5)数理計算上の差異の費用処理額	4,158

## 6．年金資産に関する事項

前事業年度（平成27年3月31日現在）

## 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.5%
その他	2.5%
合計	100.0%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

当事業年度（平成28年3月31日現在）

## 年金資産の内訳

保険資産（一般勘定）	97.7%
その他	2.3%
合計	100.0%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

#### 7．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成27年3月31日現在)
(1)割引率	1.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

	当事業年度 (平成28年3月31日現在)
(1)割引率	0.0%
(2)長期期待運用収益率	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準
(4)過去勤務費用の処理年数	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年

(注) 当事業年度の期首時点において適用した割引率は1.0%でありましたが、期末時点において割引率の再検討を行った結果、割引率の変更により退職給付債務の額に重要な影響を及ぼすと判断し、割引率を0.0%に変更しております。

#### 8．確定拠出制度

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,442千円であります。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当社の確定拠出制度への要拠出額は15,211千円であります。

（税効果会計関係）

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28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	14,194	連結納税適用に伴う影響額	647,569
未払事業税	11,023	未払事業税	236,325
その他	64,681	賞与引当金繰入超過額	15,182
		その他	70,259
繰延税金資産（流動）合計	89,899	繰延税金資産（流動）合計	969,336
繰延税金負債（流動）との相殺	-	繰延税金負債（流動）との相殺	-
繰延税金資産（流動）の純額	89,899	繰延税金資産（流動）の純額	969,336
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
退職給付引当金	20,103	連結納税適用に伴う影響額	2,575,170
その他	3,610	退職給付引当金	23,491
		その他	7,754
繰延税金資産（固定）合計	23,714	繰延税金資産（固定）合計	2,606,416
繰延税金負債（固定）との相殺	-	繰延税金負債（固定）との相殺	-
繰延税金資産（固定）の純額	23,714	繰延税金資産（固定）の純額	2,606,416
繰延税金資産合計	113,613	繰延税金資産合計	3,575,752
繰延税金負債（流動）		繰延税金負債（流動）	
その他	-	その他	-
繰延税金負債（流動）合計	-	繰延税金負債（流動）合計	-
繰延税金資産（流動）との相殺	-	繰延税金資産（流動）との相殺	-
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	-	事業譲受に係る調整項目	-
繰延税金負債（固定）合計	-	繰延税金負債（固定）合計	-
繰延税金資産（固定）との相殺	-	繰延税金資産（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	113,613	繰延税金資産の純額	3,575,752
=====		=====	

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	35.6%	法定実効税率	33.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	7.5%	交際費等永久に損金に算入されない項目	8.1%
その他	0.2%	税率変更差異	40.5%
		その他	3.8%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	43.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	85.6%
	=====		=====

（税率変更に伴う影響）

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は9,318千円減少し、法人税等調整額は9,318千円増加しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から、平成28年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。この税率変更により、繰延税金資産は178,278千円減少し、法人税等調整額は178,278千円増加しております。

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する差入保証金および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89,966千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および本社オフィス移転に伴う新たな資産除去債務の発生により31,670千円増加しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

### (1) 資産除去債務の概要

当社は、本社オフィス及びバックアップセンターの不動産賃貸借契約に基づき、退去時における原状回復に係る債務を資産除去債務として認識しておりますが、当該資産除去債務に関しては、資産除去債務の負債計上に代えて、不動産賃貸借契約に関する長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額を合理的に見積り、そのうち当事業年度の負担に属する金額を費用に計上する方法によっております。

### (2) 資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を賃貸借契約期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。

### (3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は35,341千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、資産除去費用の見積額の更新および旧オフィス賃借契約終了に伴う一部の資産除去債務の履行により54,624千円減少しております。

## (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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

当事業年度 自 平成26年4月 1日 至 平成27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ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払  投資顧問料の支払  人件費等の支払  事務手数料の受取  事務手数料の支払	162,092	未収入金	240,569
	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	35,271	前払金	34,267
	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	440	-	-
	ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルグ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	66,188	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	407	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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27年4月1日 至 平成28年3月31日）

当事業年度 自 平成27年4月1日 至 平成28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・アド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ  ソフトウェアの使用契約  人件費等及び事務手数料の支払	ソフトウェア使用料の支払  投資顧問料の支払  人件費等の支払  事務手数料の受取  事務手数料の支払	167,037  118,594  235,888  141,249  522,979	未収入金  未払金	228,410  205,912
	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  人件費等の支払	38,211  133,176	前払金	94,019
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インテグリティ・キャピタル	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	399  10,659	-	-
	ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	290	-	-

(注) 上記の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- ETF商品の紹介料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて計算されております。

#### 親会社又は重要な関連会社に関する注記

##### (1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション（ニューヨーク証券取引所に上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク（非上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス（非上場）  
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ジャパン・ホールディングス合同会社（非上場）

##### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

##### (1株当たり情報)

前事業年度	当事業年度
自 平成26年4月 1日	自 平成27年4月 1日
至 平成27年3月31日	至 平成28年3月31日

1株当たり純資産 1,479,115円06銭 1株当たり当期純利益 91,476円79銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。	1株当たり純資産 1,010,699円58銭 1株当たり当期純利益 15,455円49銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。
--	--

(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26年4月 1日 至 平成27年3月31日	当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28年3月31日
当期純利益 (千円)	567,156	95,824
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)	567,156	95,824
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26年4月 1日 至 平成27年3月31日
該当事項はありません。

当事業年度 自 平成27年4月 1日 至 平成28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】

以下は全文更新につき、訂正・更新後のものを記載いたします。

<訂正・更新後>

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

資本金の額

342,037百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容

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

(参考) 再信託受託会社

名 称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成28年3月末現在）

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

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円 (平成28年3月末現在)	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。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円 (平成28年3月末現在)	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。
ソニー生命保険株式会社	70,000百万円 (平成28年3月末現在)	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。
日本生命保険相互会社	200,000百万円 (平成28年3月末現在)	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。
株式会社みずほ銀行	1,404,065百万円 (平成28年3月末現在)	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。
株式会社横浜銀行	215,628百万円 (平成28年3月末現在)	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。
三井生命保険株式会社	167,280百万円 (平成28年3月末現在)	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】

### (1) 受託会社

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。

### (2) 販売会社

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】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

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28年10月6日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂  
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外国債券インデックス・オープンの平成28年2月23日から平成28年8月22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外国債券インデックス・オープンの平成28年8月22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28年2月23日から平成28年8月22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。XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28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

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員	公認会計士 櫻井 雄一郎 印
業務執行社員	
指定有限責任社員	公認会計士 伊藤 雅人 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27年4月1日から平成28年3月31日までの第19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28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。