

【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22年11月19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9丁目7番1号

【事務連絡者氏名】 岩淵 浩一

【電話番号】 03 - 4530 - 7085

【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・ストリート日本株マーケット・ニュートラ
ル・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 500億円を上限とします。

【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理由】

平成22年5月19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。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

5【運用状況】

原届出書の第二部 ファンド情報、第1 ファンドの状況、5 運用状況は、以下の内容に更新・訂正されます。

(1)【投資状況】

(平成22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	78,274,540	99.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		786,840	1.00
純資産総額		79,061,380	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(日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド)

(平成22年9月30日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	5,450,820,200	89.04
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		671,182,097	10.96
純資産総額		6,122,002,297	100.00

(注1) 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。

(注2) その他資産として、下記のとおり信用取引を利用しています。

資産の種類	国/地域名	数量(株)	簿価金額(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
信用取引 株式信用売証券 (181銘柄)	日本	6,483,304	5,649,127,351	5,360,440,370	87.56

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成22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	日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド		57,831,208	1.3718	79,332,852	1.3535	78,274,540	99.00
投資比率：合計										99.00

(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	-	99.00

合計	99.00
----	-------

(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(日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド)

投資有価証券の主要銘柄(上位30銘柄)

(平成22年9月30日現在)

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	リンテック	その他製品	50,400	1,690	85,176,000	1,839	92,685,600	1.51
2	日本	株式	日本製粉	食料品	191,000	462	88,242,000	430	82,130,000	1.34
3	日本	株式	A D E K A	化学	92,800	839	77,859,200	847	78,601,600	1.28
4	日本	株式	旭硝子	ガラス・土石 製品	89,000	957	85,173,000	851	75,739,000	1.24
5	日本	株式	フォスター電 機	電気機器	35,700	2,363	84,374,451	2,116	75,541,200	1.23
6	日本	株式	ソニーフィナ ンシャルホール ディングス	保険業	277	261,600	72,463,200	272,000	75,344,000	1.23
7	日本	株式	コーナン商事	小売業	79,100	1,006	79,574,600	920	72,772,000	1.19
8	日本	株式	日本曹達	化学	208,000	359	74,672,000	342	71,136,000	1.16
9	日本	株式	ダイセル化学 工業	化学	117,000	603	70,551,000	562	65,754,000	1.07
10	日本	株式	日本新薬	医薬品	55,000	1,018	55,990,000	1,160	63,800,000	1.04
11	日本	株式	日清紡ホール ディングス	繊維製品	76,000	888	67,488,000	837	63,612,000	1.04
12	日本	株式	出光興産	石油・石炭製 品	8,600	6,800	58,480,000	7,160	61,576,000	1.01
13	日本	株式	タチエス	輸送用機器	52,300	909	47,529,700	1,131	59,151,300	0.97
14	日本	株式	日本触媒	化学	81,000	785	63,585,000	726	58,806,000	0.96
15	日本	株式	日産車体	輸送用機器	97,000	671	65,119,921	604	58,588,000	0.96
16	日本	株式	フジクラ	非鉄金属	139,000	482	66,998,000	418	58,102,000	0.95
17	日本	株式	丸紅	卸売業	123,000	536	65,928,000	472	58,056,000	0.95
18	日本	株式	東京ドーム	サービス業	272,000	251	68,272,000	213	57,936,000	0.95
19	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	73,900	729	53,873,100	764	56,459,600	0.92
20	日本	株式	東京急行電鉄	陸運業	153,000	373	57,069,000	369	56,457,000	0.92
21	日本	株式	三菱商事	卸売業	28,400	2,282	64,808,800	1,981	56,260,400	0.92
22	日本	株式	京セラ	電気機器	7,100	8,320	59,072,000	7,890	56,019,000	0.92
23	日本	株式	東映	情報・通信業	148,910	446	66,413,860	374	55,692,340	0.91
24	日本	株式	N E C フィー ルディング	サービス業	60,100	1,219	73,261,900	926	55,652,600	0.91
25	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	20,300	2,367	48,050,100	2,731	55,439,300	0.91

26	日本	株式	オリエンタル ランド	サービス業	7,100	6,380	45,298,000	7,780	55,238,000	0.90
27	日本	株式	日本電気硝子	ガラス・土石 製品	48,000	1,191	57,156,000	1,138	54,624,000	0.89
28	日本	株式	シーエーシー	情報・通信業	86,900	616	53,530,400	627	54,486,300	0.89
29	日本	株式	アイシン精機	輸送用機器	20,700	2,385	49,369,500	2,604	53,902,800	0.88
30	日本	株式	三井製糖	食料品	157,000	298	46,786,000	335	52,595,000	0.86
									投資比率：合計	30.91

(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。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
株式	電気機器	11.28
	化学	8.74
	小売業	8.19
	輸送用機器	6.16
	卸売業	5.60
	機械	5.59
	食料品	5.18
	サービス業	4.41
	情報・通信業	4.14
	陸運業	3.63
	建設業	2.96
	非鉄金属	2.79
	その他製品	2.68
	医薬品	2.55
	繊維製品	2.23
	ガラス・土石製品	2.13
	石油・石炭製品	1.74
	鉄鋼	1.70
	保険業	1.23
	銀行業	1.18
	不動産業	1.05
	金属製品	0.78
	ゴム製品	0.78
倉庫・運輸関連業	0.74	
その他金融業	0.72	
水産・農林業	0.48	
パルプ・紙	0.38	
	小計	89.04
合計		89.04

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

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
信用取引の主要銘柄（上位30銘柄）

（平成22年9月30日現在）

順位	国/ 地域名	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式信用売	サンリオ	卸売業	84,600	754	63,788,400	1,595	134,937,000	2.20
2	日本	株式信用売	ミスミグループ 本社	卸売業	58,700	1,686	98,968,200	1,750	102,725,000	1.68
3	日本	株式信用売	京浜急行電鉄	陸運業	111,000	718	79,698,000	807	89,577,000	1.46
4	日本	株式信用売	東燃ゼネラル石 油	石油・石炭製 品	110,000	756	83,160,000	773	85,030,000	1.39
5	日本	株式信用売	全日本空輸	空運業	271,000	269	72,899,000	309	83,739,000	1.37
6	日本	株式信用売	千代田化工建設	建設業	110,000	839	92,290,000	683	75,130,000	1.23
7	日本	株式信用売	近畿日本鉄道	陸運業	257,000	282	72,474,000	282	72,474,000	1.18
8	日本	株式信用売	伊藤園	食料品	50,600	1,350	68,310,000	1,371	69,372,600	1.13
9	日本	株式信用売	パソナグループ	サービス業	1,129	61,200	69,094,800	58,800	66,385,200	1.08
10	日本	株式信用売	住友化学	化学	181,000	412	74,572,000	366	66,246,000	1.08
11	日本	株式信用売	M S & A D イン シュアランスグ ループホール	保険業	33,400	2,359	78,781,239	1,917	64,027,800	1.05
12	日本	株式信用売	日本毛織	繊維製品	98,000	602	58,996,000	641	62,818,000	1.03
13	日本	株式信用売	ゼリア新薬工業	医薬品	62,000	934	57,908,000	1,013	62,806,000	1.03
14	日本	株式信用売	日本ペイント	化学	110,000	588	64,680,000	563	61,930,000	1.01
15	日本	株式信用売	アドバンテスト	電気機器	35,800	2,235	80,013,000	1,661	59,463,800	0.97
16	日本	株式信用売	ヤマハ発動機	輸送用機器	47,400	1,177	55,789,800	1,253	59,392,200	0.97
17	日本	株式信用売	住生活グループ	金属製品	36,100	1,789	64,582,900	1,637	59,095,700	0.97
18	日本	株式信用売	J S R	化学	41,500	1,835	76,152,500	1,421	58,971,500	0.96
19	日本	株式信用売	シマノ	輸送用機器	13,100	3,920	51,352,000	4,420	57,902,000	0.95
20	日本	株式信用売	アサツー ディ・ ケイ	サービス業	30,600	1,780	54,468,000	1,803	55,171,800	0.90
21	日本	株式信用売	堀場製作所	電気機器	26,200	2,210	57,896,734	2,039	53,421,800	0.87
22	日本	株式信用売	清水建設	建設業	172,000	343	58,996,000	309	53,148,000	0.87
23	日本	株式信用売	カゴメ	食料品	32,700	1,593	52,091,100	1,616	52,843,200	0.86

24	日本	株式信用売	小田急電鉄	陸運業	67,000	760	50,920,000	772	51,724,000	0.84
25	日本	株式信用売	西松屋チェーン	小売業	65,500	787	51,548,500	769	50,369,500	0.82
26	日本	株式信用売	スギホールディングス	小売業	26,000	2,125	55,250,000	1,884	48,984,000	0.80
27	日本	株式信用売	沢井製薬	医薬品	6,300	6,170	38,871,000	7,510	47,313,000	0.77
28	日本	株式信用売	日本ケミファ	医薬品	169,000	253	42,757,000	278	46,982,000	0.77
29	日本	株式信用売	アリアケジャパン	食料品	36,700	1,375	50,462,500	1,276	46,829,200	0.76
30	日本	株式信用売	トレンドマイクロ	情報・通信業	18,700	3,240	60,588,000	2,491	46,581,700	0.76
投資比率：合計									31.76	

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成22年9月30日現在、同日前1年以内における各月末および各計算期間末の純資産の推移は次のとおりです。

計算期間・月末		純資産総額（円）		1口当たりの純資産額（円）	
第1期	（平成15年 2月20日）	分配付： 分配落：	107,341,912 107,341,912	分配付： 分配落：	1.0383 1.0383
第2期	（平成16年 2月20日）	分配付： 分配落：	198,643,529 198,643,529	分配付： 分配落：	1.1064 1.1064
第3期	（平成17年 2月21日）	分配付： 分配落：	713,259,880 713,259,880	分配付： 分配落：	1.1616 1.1616
第4期	（平成18年 2月20日）	分配付： 分配落：	506,893,661 506,893,661	分配付： 分配落：	1.1421 1.1421
第5期	（平成19年 2月20日）	分配付： 分配落：	226,529,845 224,557,773	分配付： 分配落：	1.1487 1.1387
第6期	（平成20年 2月20日）	分配付： 分配落：	153,699,757 153,699,757	分配付： 分配落：	1.1147 1.1147
第7期	（平成21年 2月20日）	分配付： 分配落：	106,967,021 106,967,021	分配付： 分配落：	1.0095 1.0095
第8期	（平成22年 2月22日）	分配付： 分配落：	92,631,936 92,631,936	分配付： 分配落：	0.9751 0.9751
平成21年 9月末日		98,177,222		0.9865	
10月末日		98,720,724		0.9919	
11月末日		94,401,140		0.9848	
12月末日		94,491,183		0.9858	
平成22年 1月末日		92,962,820		0.9786	
2月末日		92,175,002		0.9703	
3月末日		84,098,054		0.9731	
4月末日		84,744,711		0.9806	
5月末日		83,895,218		0.9707	
6月末日		80,755,716		0.9508	

7月末日	80,490,716	0.9477
8月末日	77,851,098	0.9365
9月末日	79,061,380	0.9511

【分配の推移】

計算期間		一口当たりの分配金
第1期	(平成15年 2月20日)	0.0000円
第2期	(平成16年 2月20日)	0.0000円
第3期	(平成17年 2月21日)	0.0000円
第4期	(平成18年 2月20日)	0.0000円
第5期	(平成19年 2月20日)	0.0100円
第6期	(平成20年 2月20日)	0.0000円
第7期	(平成21年 2月20日)	0.0000円
第8期	(平成22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 9月30日 至平成15年 2月20日	3.8%
第2期	自平成15年 2月21日 至平成16年 2月20日	6.6%
第3期	自平成16年 2月21日 至平成17年 2月21日	5.0%
第4期	自平成17年 2月22日 至平成18年 2月20日	1.7%
第5期	自平成18年 2月21日 至平成19年 2月20日	0.6%
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	9.4%
第8期	自平成21年 2月21日 至平成22年 2月22日	3.4%
	自平成22年 2月23日 至平成22年 9月30日	2.5%

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

第2【財務ハイライト情報】

原届出書の第二部 ファンド情報、第2 財務ハイライト情報につきましては、末尾に以下の中間財務諸表が、追加されます。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前中間計算期間(平成21年2月21日から平成21年8月20日まで)及び当中間計算期間(平成22年2月23日から平成22年8月22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。

中間財務諸表

ステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープン

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

区 分	注記 番号	前中間計算期間末 (平成21年 8月20日現在)	当中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		3,681,705	1,760,740
親投資信託受益証券		96,935,366	78,182,556
未収利息		7	9
流動資産合計		100,617,078	79,943,305
資産合計		100,617,078	79,943,305
負債の部			
流動負債			
未払解約金			895,183
未払受託者報酬		51,898	43,592
未払委託者報酬		882,227	741,005
その他未払費用		31,082	26,091
流動負債合計		965,207	1,705,871
負債合計		965,207	1,705,871
純資産の部			
元本等			
元本	1	99,523,242	83,126,017
剰余金			
中間剰余金又は中間欠損金()	3	128,629	4,888,583
(分配準備積立金)		(3,936,107)	(3,316,050)
元本等合計		99,651,871	78,237,434
純資産合計		99,651,871	78,237,434
負債純資産合計		100,617,078	79,943,305

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

区 分	注記 番号	前中間計算期間 自平成21年 2月21日 至平成21年 8月20日	当中間計算期間 自平成22年 2月23日 至平成22年 8月22日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		1,281	546

有価証券売買等損益		52,475	2,160,933
営業収益合計		53,756	2,160,387
営業費用			
受託者報酬		51,898	43,592
委託者報酬		882,227	741,005
その他費用		31,082	26,091
営業費用合計		965,207	810,688
営業損失（ ）		911,451	2,971,075
経常損失（ ）		911,451	2,971,075
中間純損失（ ）		911,451	2,971,075
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）		85,200	127,364
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,003,669	2,360,978
剰余金増加額又は欠損金減少額			316,106
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額			316,106
剰余金減少額又は欠損金増加額		48,789	
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		48,789	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		128,629	4,888,583

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	前中間計算期間 自 平成21年 2月21日 至 平成21年 8月20日	当中間計算期間 自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
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22年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22年8月22日までとなっております。

[次へ](#)

< 参考 >

当ファンドは「日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド」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21年 8月20日現在)	(平成22年 8月22日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		694,949	590,357
コール・ローン		3,178,337,358	1,087,958,975
株式	3	9,047,096,118	5,441,859,776
未収入金		11,992,026	
信用取引預け金		7,535,740,234	5,376,128,465
未収配当金		8,624,500	4,935,400
未収利息		6,095	2,086
差入保証金		10,000,000	10,000,000
流動資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059
資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059
負債の部			
流動負債			
信用売証券		8,932,095,400	5,396,303,450
その他未払費用		19,936,901	12,685,476
流動負債合計		8,952,032,301	5,408,988,926
負債合計		8,952,032,301	5,408,988,926
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,769,694,594	4,873,249,839
剰余金			
剰余金又は欠損金()		3,070,764,385	1,639,236,294
元本等合計		10,840,458,979	6,512,486,133
純資産合計		10,840,458,979	6,512,486,133
負債純資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年 2月21日 至平成21年 8月20日	自平成22年 2月23日 至平成22年 8月22日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>信用売証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>信用売証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p> <p>その他費用 信用取引に係る以下の費用を計上しております。</p> <p>借株料 信用売り株式の借入に係る費用として、予め借入先と合意した料率と計算方法に基づき、原則として、借入実行日（信用売り受渡日）の翌営業日から日々計上しております。</p>	<p>受取配当金 同左</p> <p>その他費用 信用取引に係る以下の費用を計上しております。</p> <p>借株料 同左</p>

	<p>支払配当金相当額</p> <p>信用売り株式の借入先に支払うべき配当金相当額として、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、確定金額との差額については確定時に計上しております。</p>	<p>支払配当金相当額</p> <p>同左</p>
--	--	---------------------------

第三部【ファンドの詳細情報】

第4【ファンドの経理状況】

原届出書の第三部 ファンドの詳細情報、第4 ファンドの経理状況につきましては、以下の中間財務諸表が、末尾に追加されます。

- (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、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前中間計算期間(平成21年2月21日から平成21年8月20日まで)及び当中間計算期間(平成22年2月23日から平成22年8月22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。

中間財務諸表

ステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープン

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前中間計算期間末 (平成21年 8月20日現在)	当中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,681,705	1,760,740
親投資信託受益証券	96,935,366	78,182,556
未収利息	7	9
流動資産合計	100,617,078	79,943,305
資産合計	100,617,078	79,943,305
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	895,183
未払受託者報酬	51,898	43,592
未払委託者報酬	882,227	741,005
その他未払費用	31,082	26,091
流動負債合計	965,207	1,705,871
負債合計	965,207	1,705,871
純資産の部		
元本等		
元本	99,523,242	83,126,017
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	128,629	4,888,583
(分配準備積立金)	3,936,107	3,316,050
元本等合計	99,651,871	78,237,434
純資産合計	99,651,871	78,237,434
負債純資産合計	100,617,078	79,943,305

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前中間計算期間 自平成21年 2月21日 至平成21年 8月20日	当中間計算期間 自平成22年 2月23日 至平成22年 8月22日
営業収益		
受取利息	1,281	546
有価証券売買等損益	52,475	2,160,933
営業収益合計	53,756	2,160,387
営業費用		
受託者報酬	51,898	43,592
委託者報酬	882,227	741,005
その他費用	31,082	26,091
営業費用合計	965,207	810,688
営業損失（ ）	911,451	2,971,075
経常損失（ ）	911,451	2,971,075
中間純損失（ ）	911,451	2,971,075
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	85,200	127,364
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,003,669	2,360,978
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	316,106
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	316,106
剰余金減少額又は欠損金増加額	48,789	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	48,789	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	128,629	4,888,583

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前中間計算期間 自 平成21年 2月21日 至 平成21年 8月20日	当中間計算期間 自 平成22年 2月23日 至 平成22年 8月22日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券 同左
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22年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成22年2月23日から平成22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	前中間計算期間末 (平成21年 8月20日現在)	当中間計算期間末 (平成22年 8月22日現在)
1 期首元本額	105,963,352円	94,992,914円
期中追加設定元本額	円	円
期中一部解約元本額	6,440,110円	11,866,897円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	99,523,242口	83,126,017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4,888,583円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間（自 平成21年2月21日 至 平成21年8月20日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

該当する事項はありません。

(有価証券関係に関する注記)

前中間計算期間（自 平成21年2月21日 至 平成21年8月20日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

前中間計算期間（自 平成21年2月21日 至 平成21年8月20日）

該当する事項はありません。

当中間計算期間（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	前中間計算期間末 (平成21年 8月20日現在)	当中間計算期間末 (平成22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)	1.0013 円 (10,013 円)	0.9412 円 (9,412 円)

[次へ](#)

<参考>

当ファンドは「日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド」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21年 8月20日現在)	(平成22年 8月22日現在)
		金額	金額
資産の部			
流動資産			
金銭信託		694,949	590,357
コール・ローン		3,178,337,358	1,087,958,975
株式	3	9,047,096,118	5,441,859,776
未収入金		11,992,026	
信用取引預け金		7,535,740,234	5,376,128,465
未収配当金		8,624,500	4,935,400
未収利息		6,095	2,086
差入保証金		10,000,000	10,000,000
流動資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059
資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059
負債の部			
流動負債			
信用売証券		8,932,095,400	5,396,303,450
その他未払費用		19,936,901	12,685,476
流動負債合計		8,952,032,301	5,408,988,926
負債合計		8,952,032,301	5,408,988,926
純資産の部			
元本等			
元本	1	7,769,694,594	4,873,249,839
剰余金			
剰余金又は欠損金()		3,070,764,385	1,639,236,294
元本等合計		10,840,458,979	6,512,486,133
純資産合計		10,840,458,979	6,512,486,133
負債純資産合計		19,792,491,280	11,921,475,059

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成21年 2月21日 至平成21年 8月20日	自平成22年 2月23日 至平成22年 8月22日

<p>1 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>信用売証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>信用売証券 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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
<p>2 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上しております。</p> <p>その他費用 信用取引に係る以下の費用を計上しております。</p> <p>借株料 信用売り株式の借入に係る費用として、予め借入先と合意した料率と計算方法に基づき、原則として、借入実行日（信用売り受渡日）の翌営業日から日々計上しております。</p> <p>支払配当金相当額 信用売り株式の借入先に支払うべき配当金相当額として、原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には予想配当金額を計上し、確定金額との差額については確定時に計上しております。</p>	<p>受取配当金 同左</p> <p>その他費用 信用取引に係る以下の費用を計上しております。</p> <p>借株料 同左</p> <p>支払配当金相当額 同左</p>

（貸借対照表に関する注記）

区分	（平成21年 8月20日現在）	（平成22年 8月22日現在）
----	-----------------	-----------------

1	本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	10,466,842,282円	6,877,372,000円
	同期中における追加設定元本額	円	円
	同期中における一部解約元本額	2,697,147,688円	2,004,122,161円
	同中間期末における元本の内訳 ファンド名		
	ステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープン	69,477,757円	58,502,362円
	日本株式ロングショート・マーケットニュートラルファンド<適格機関投資家限定>	7,700,216,837円	4,814,747,477円
	計	7,769,694,594円	4,873,249,839円
2	本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	7,769,694,594口	4,873,249,839口
3	差入保証金代用有価証券	信用取引に係る差入保証金代用有価証券として以下の通り、差入れを行っております。 株式 4,707,321,950円	信用取引に係る差入保証金代用有価証券として以下の通り、差入れを行っております。 株式 2,494,987,716円

（有価証券関係に関する注記）

（自 平成21年2月21日 至 平成21年8月20日）

該当する事項はありません。

（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

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）

（自 平成21年2月21日 至 平成21年8月20日）

該当する事項はありません。

（自 平成22年2月23日 至 平成22年8月22日）

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）

	（平成21年 8月20日現在）	（平成22年 8月22日現在）
本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の1口当たり純資産額	1.3952 円	1.3364 円
（1万口当たり純資産額）	（13,952 円）	（13,364 円）

2【ファンドの現況】

原届出書の第三部 ファンドの詳細情報、第4 ファンドの経理状況、2 ファンドの現況は、以下の内容に更新・訂正されます。

【純資産額計算書】

（平成22年9月30日現在）

資産総額	79,224,648 円
負債総額	163,268 円
純資産総額（ - ）	79,061,380 円
発行済口数	83,126,017 口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	0.9511 円 (9,511 円)

< 参考情報 >

親投資信託受益証券（日本株式ロングショート・マーケットニュートラルマザーファンド）

（平成22年9月30日現在）

資産総額	11,573,421,091 円
負債総額	5,451,418,794 円
純資産総額（ - ）	6,122,002,297 円
発行済口数	4,523,019,529 口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	1.3535 円 (13,535 円)

第5【設定及び解約の実績】

原届出書の第三部 ファンドの詳細情報、第5 設定及び解約の実績は、以下の内容に更新・訂正されます。

	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 9月30日 至平成15年 2月20日	103,377,539	0	103,377,539
第2期	自平成15年 2月21日 至平成16年 2月20日	143,260,182	67,091,247	179,546,474
第3期	自平成16年 2月21日 至平成17年 2月21日	496,266,649	61,780,156	614,032,967
第4期	自平成17年 2月22日 至平成18年 2月20日	56,425,180	226,646,644	443,811,503
第5期	自平成18年 2月21日 至平成19年 2月20日	0	246,604,289	197,207,214
第6期	自平成19年 2月21日 至平成20年 2月20日	1,488,774	60,813,338	137,882,650
第7期	自平成20年 2月21日 至平成21年 2月20日	0	31,919,298	105,963,352
第8期	自平成21年 2月21日 至平成22年 2月22日	0	10,970,438	94,992,914
	自平成22年 2月23日 至平成22年 9月30日	0	11,866,897	83,126,017

（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。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

原届出書の第四部 特別情報、第1 委託会社等の概況、1 委託会社等の概況は、以下の内容に更新・訂正されます。

(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22年10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22年10月29日現在)。

発行済株式の総数

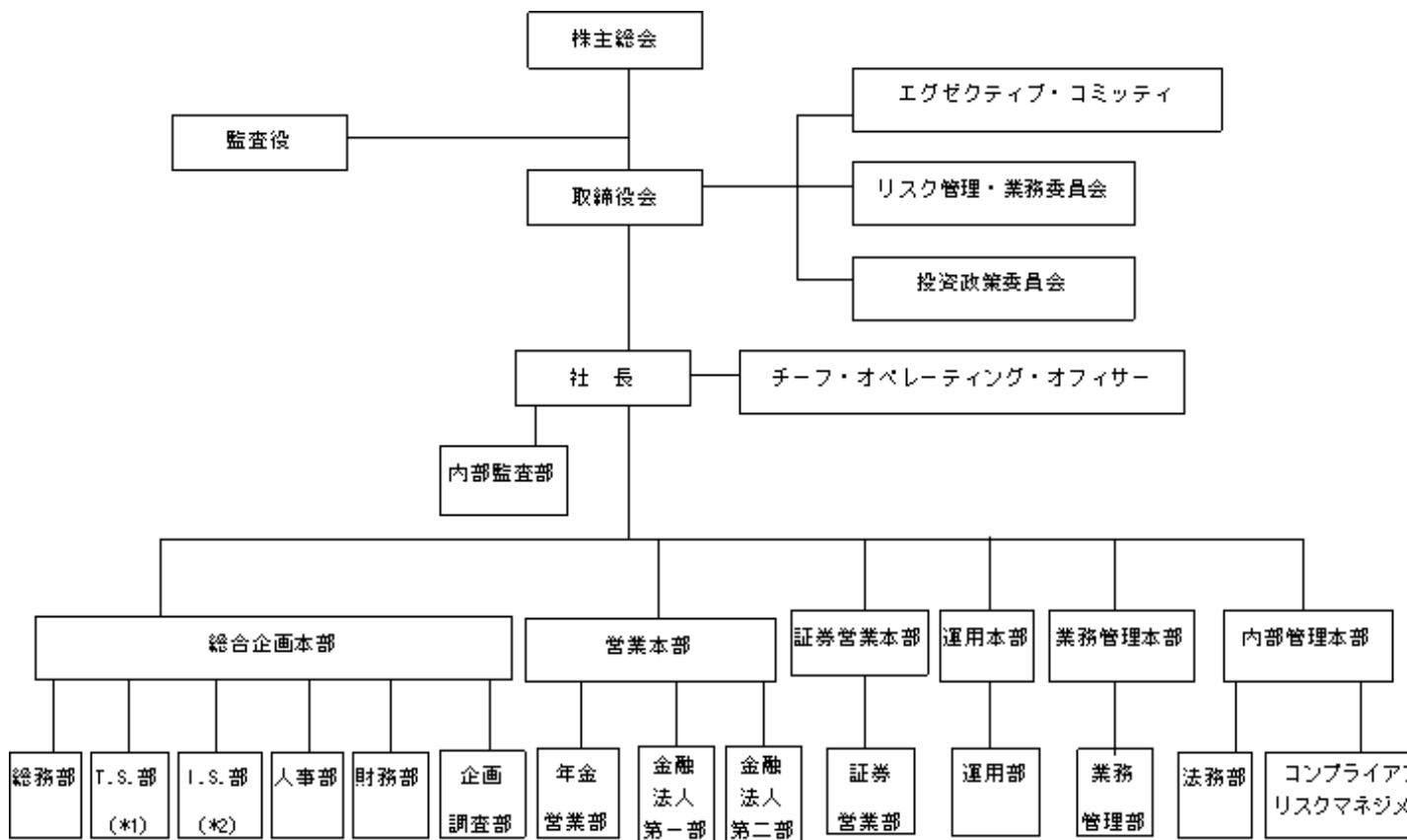
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成22年10月29日現在)。

最近5年間ににおける主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(2) 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	年金営業部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、コンサルタントとの折衝
	金融法人第一部 金融法人第二部	投資運用業務、投資助言業務に係る顧客の開拓・サポート、投資信託販売会社との交渉・連絡、コンサルタントとの折衝等
証券営業本部	証券営業部	グループ会社の運用するETF、海外ファンド等の国内投資家向け需要喚起・勧誘、自社設定投信の企画・勧誘等
運用本部	運用部	投資一任・助言に係る資産及び投資信託の運用の指図、売買発注、運用報告の作成、運用手法・運用モデルの研究開発等
業務管理本部	業務管理部	資産運用管理業務、投資信託管理業務、運用報告書等の作成、投資パフォーマンスの計測・要因分析、ソフトウェアの開発・PC管理・サポート、システム管理等
総合企画本部	企画調査部	商品設計、企画提案書の作成、契約締結手続き、勧誘資料作成、広告、営業イベント企画等
	財務部	会社経理・決算、税務申告、予算管理等の経理業務、ディスクロージャー資料作成等
	テクノロジー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[ソフトウェアの開発・保守管理、セキュリティ管理]
	インフラストラクチャー・サービス部	電子情報処理組織の保守および管理に関する業務[コンピューター機器及び付属機器の設置・保守管理]
	総務部	備品の購入・管理、オフィスの安全・防犯管理等の総務関連業務（総務業務）、メンテナンスを含む施設管理に関する業務（管財業務）および対外広報管理等の広報に関する業務（広報業務）
	人事部	福利厚生、給与支払等の人事に関する事務的業務
内部管理本部	コンプライアンス・リスクマネジメント部	法令遵守状況の確認・指導、投資判断その他に関するリスク管理、内部管理責任者、情報管理責任者、広告審査、内部監査対応等
	法務部	法務調査・契約書類等の作成等の法務的業務
	内部監査部	経営諸活動の内部統制システムの妥当性や有効性について検証・評価し、その結果及び改善案を経営陣に対して報告

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】

原届出書の第四部 特別情報、第1 委託会社等の概況、2 事業の内容及び営業の概況は、以下の内容に更新・訂正されます。

「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22年10月末日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計107本（追加型/国内/株式型13本、追加型/海外/株式型25本、追加型/国内/債券型6本、追加型/海外/債券型15本、追加型/内外/資産複合型39本、追

加型/内外/株式型1本、追加型/海外/資産複合型8本)であり、その純資産総額は926,823,430,793円です(親投資信託は除きます。)

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の第四部 特別情報、第1 委託会社等の概況、3 委託会社等の経理状況は、以下の内容に更新・訂正されます。

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」といいます）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び当事業年度（平成21年4月1日から平成22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21年3月31日現在)		当事業年度 (平成22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	25		69	
預金	5,263,429		6,652,255	
有価証券	50,737		49,072	
前払費用	25,202		23,912	
未収入金	594,303	4	666,368	
未収委託者報酬	513,913		596,483	
未収収益	21,245		25,258	
未収消費税等	672		-	
繰延税金資産	62,690		79,106	
流動資産計	6,532,220	94.5	8,092,526	95.9
固定資産				
有形固定資産	210,474		190,517	
建物附属設備	170,391	1	156,889	
器具備品	40,082	1	33,628	
無形固定資産	4,035		2,851	
ソフトウェア	4,035	2	2,851	
投資その他の資産	167,003		154,500	
長期差入保証金	143,411		133,462	
繰延税金資産	18,742		16,187	
その他投資	4,850		4,850	
固定資産計	381,513	5.5	347,869	4.1
資産合計	6,913,734	100.0	8,440,395	100.0
(負 債 の 部)		%		%
流動負債				
預り金	118,197		54,823	
未払金	453,265		724,822	

未払手数料		260,007		302,298		
その他未払金	4	193,258		422,523		
未払費用	4		113,280		94,329	
未払法人税等			138,985		406,808	
未払消費税等			-		18,985	
賞与引当金			26,400		62,492	
その他の流動負債			5,335		3,562	
流動負債計			855,464	12.4	1,365,824	16.2
固定負債						
役員退職慰労引当金			32,134		37,339	
退職給付引当金			11,503		10,758	
固定負債計			43,637	0.6	48,098	0.6
負債合計			899,102	13.0	1,413,922	16.8
(純資産の部)				%		%
株主資本			6,014,631	87.0	7,026,473	83.2
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		5,595,511			6,607,353	
純資産合計			6,014,631	87.0	7,026,473	83.2
負債・純資産合計			6,913,734	100.0	8,440,395	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

科 目	期 別	前事業年度			当事業年度		
		自 平成20年 4月 1日		構成比	自 平成21年 4月 1日		構成比
		至 平成21年 3月 31日	至 平成22年 3月 31日				
		金 額	構成比	金 額	構成比		
営業収益				%		%	
委託者報酬			6,889,542		6,090,712		
投資顧問収入	1		2,359,466		2,069,761		
その他営業収益			30,660		16,491		
営業収益計			9,279,668	100.0	8,176,964	100.0	
営業費用							
支払手数料			3,684,541		3,146,528		
広告宣伝費			25,730		11,395		
公告費			1,140		1,140		
調査費			703,510		556,209		
調査費	1	275,300			240,382		
委託調査費	1	426,567			314,332		
図書費		1,642			1,494		
委託計算費			168,721		187,144		
営業雑経費			62,768		47,159		
通信費		12,063			7,740		

印刷費		10,291			9,869	
協会費		27,006			15,464	
諸会費		4,313			5,333	
その他		9,094			8,752	
営業費用計			4,646,413	50.1		3,949,576
48.3						
一般管理費						
給料			1,317,850			1,201,883
役員報酬	1	374,484			267,365	
給料・手当	1	771,542			761,261	
賞与	1	145,423			110,764	
賞与引当金繰入額		26,400			62,492	
退職金			62,794			-
交際費			9,257			5,925
旅費交通費			32,298			27,228
租税公課			13,827			21,458
不動産賃借料			186,096			160,720
役員退職慰労引当金繰入額			5,976			5,204
退職給付費用			36,316			39,747
固定資産減価償却費			20,414			21,584
福利厚生費			95,841			87,474
事務手数料	1		811,546			744,715
諸経費			116,992			100,465
一般管理費計			2,709,212	29.2		2,416,409
29.6						
営業利益			1,924,042	20.7		1,810,977
22.1						
営業外収益						
受取利息			33			0
有価証券売却益			-			3,857
雑収入			49			402
営業外収益計			83	0.0		4,259
0.1						
営業外費用						
為替差損			-			231
有価証券売却損			4,967			-
営業外費用計			4,967	0.0		231
0.0						
経常利益			1,919,158	20.7		1,815,005
22.2						
特別損失						
ゴルフ会員権評価損			7,966			-
事務処理損失			-			93
特別損失計			7,966	0.1		93
0.0						
税引前当期純利益			1,911,192	20.6		1,814,912
22.2						
法人税,住民税及び事業税			844,967	9.1		816,931
10.0						
法人税等調整額			51,267	0.6		13,860
0.2						
当期純利益			1,014,957	10.9		1,011,841
12.4						

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

前事業年度

当事業年度

(自 平成20年4月 1日
至 平成21年3月31日)

(自 平成21年4月 1日
至 平成22年3月31日)

株主資本		
資本金		
前期末残高	310,000	310,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	310,000	310,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	77,500	77,500
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	77,500	77,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	31,620	31,620
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	31,620	31,620
繰越利益剰余金		
前期末残高	4,580,554	5,595,511
当期変動額		
当期純利益	1,014,957	1,011,841
当期変動額合計	1,014,957	1,011,841
当期末残高	5,595,511	6,607,353
利益剰余金合計		
前期末残高	4,689,674	5,704,631
当期変動額		
当期純利益	1,014,957	1,011,841
当期変動額合計	1,014,957	1,011,841
当期末残高	5,704,631	6,716,473
株主資本合計		
前期末残高	4,999,674	6,014,631
当期変動額		
当期純利益	1,014,957	1,011,841
当期変動額合計	1,014,957	1,011,841
当期末残高	6,014,631	7,026,473
純資産合計		
前期末残高	4,999,674	6,014,631
当期変動額		
当期純利益	1,014,957	1,011,841
当期変動額合計	1,014,957	1,011,841
当期末残高	6,014,631	7,026,473

重要な会計方針

	前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 決算末日の市場価格等に基づく時価法（取得原価は移動平均法により算定）を採用しております。	(1) 有価証券 同 左
2.固定資産の減価償却方法	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 建物附属設備6～18年 器具備品 8年 (2) 無形固定資産及び長期前払費用 定額法により償却しております。 なお、ソフトウェア（自社利用）については、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。	(1) 有形固定資産 定額法により償却しております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。 同 左 (2) 無形固定資産 同 左
3.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	該当事項はありません。	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
4.引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 数理計算上の差異は、その発生時の翌期に一括償却しております。 (3) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に備えて、役員退職慰労金規定に基づく期末要支給額を計上しております。	(1) 賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。 (2) 退職給付引当金 当事業年度から「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号 平成20年7月31日）を適用しております。 数理計算上の差異を翌期から償却するため、これによる営業損益、経常損益及び税引前当期純利益に与える影響はありません。 また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額の未処理残高は20,032千円であります。 (3) 役員退職慰労引当金 同 左
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。	(1) 消費税等の処理方法 同 左

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 21,433千円 器具備品 14,520千円	1. 有形固定資産の減価償却累計額 建物附属設備 34,935千円 器具備品 21,419千円
2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 3,274千円	2. 無形固定資産の減価償却累計額 ソフトウェア 5,658千円
3. 授権株式数及び発行済株式総数 授権株式数 8,800株 発行済株式数 6,200株	3. 授権株式数及び発行済株式総数 授権株式数 8,800株 発行済株式数 6,200株
4. 関係会社に係る注記 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。なお、以下はすべて親会社に対するものであります。 その他未払金 63,034千円 未払費用 9,383千円 未収入金 36,567千円	4. 関係会社に係る注記 該当事項はありません。

(損益計算書関係)

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
1. 関係会社に係る注記 各科目に含まれている関係会社との取引は次のとおりであります。なお、以下はすべて親会社に対するものであります。 投資顧問収入 367,521千円 調査費 207,735千円 委託調査費 350,427千円 給料・手当 24,637千円 賞与 213,295千円 事務手数料 739,279千円	1. 関係会社に係る注記 各科目に含まれている関係会社との取引は次のとおりであります。 (但し、親会社であったステート・ストリート・バンク アンド トラストカンパニーは平成21年10月に関係会社ではなくなっております。当該金額は10月以降の関係会社でなくなった期間の金額も含めた当期中における取引金額全てについて記載しております。) 投資顧問収入 258,438千円 調査費 168,552千円 委託調査費 269,665千円 役員報酬 133,413千円 給料・手当 17,308千円 賞与 40,494千円 事務手数料 694,820千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
1. 当該事業年度の末日における発行済株式数 6,200株	1. 当該事業年度の末日における発行済株式数 6,200株
2. 配当金支払額 該当事項はありません。	2. 配当金支払額 該当事項はありません。

(リース取引関係)

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日

<p>(会計方針の変更) 当会計期間から平成19年3月30日改正の「リース取引に関する会計基準」(企業会計基準委員企業会計基準第13号)及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準適用指針第16号)を適用しております。 なお、リース取引開始日が適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、引き続き通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理を適用しております。 これによる営業利益、経常利益及び税引前当期純利益に与える影響は軽微であります。</p> <p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引</p> <p style="text-align: center;">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 style="text-align: center;">車両</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">14,722千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">6,751千円</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">7,970千円</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">未経過リース料期末残高相当額</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>1年内</td> <td style="text-align: right;">8,133千円</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">-千円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">8,133千円</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">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 style="width: 100%;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">3,298千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">3,000千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">249千円</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">減価償却費相当額の算定方法</p> <p>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 style="text-align: center;">利息相当額の算定方法</p> <p>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>	取得価額相当額	14,722千円	減価償却累計額相当額	6,751千円	期末残高相当額	7,970千円	1年内	8,133千円	1年超	-千円	合計	8,133千円	支払リース料	3,298千円	減価償却費相当額	3,000千円	支払利息相当額	249千円	<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの) 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 style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p style="text-align: center;">未経過リース料期末残高相当額</p> <p style="text-align: center;">該当事項はありません。</p> <p style="text-align: center;">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 style="width: 100%;"> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">2,473千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">2,250千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">60千円</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">減価償却費相当額の算定方法</p> <p style="text-align: center;">同 左</p> <p style="text-align: center;">利息相当額の算定方法</p> <p style="text-align: center;">同 左</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
取得価額相当額	14,722千円																								
減価償却累計額相当額	6,751千円																								
期末残高相当額	7,970千円																								
1年内	8,133千円																								
1年超	-千円																								
合計	8,133千円																								
支払リース料	3,298千円																								
減価償却費相当額	3,000千円																								
支払利息相当額	249千円																								
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)

当事業年度(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号平成20年3月10日)を適用しております。

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法に関する事項

（1）現金及び預金

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

（2）未収委託者報酬、（3）未収入金及び（4）その他未払金

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

（注2）金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

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

該当事項はありません。

（有価証券関係）

前事業年度 (平成21年3月31日現在)		当事業年度 (平成22年3月31日現在)	
売買目的の有価証券 貸借対照表計上額	50,737千円	売買目的の有価証券 貸借対照表計上額	49,072千円
当事業年度の損益 に含まれた評価差額	787千円	当事業年度の損益 に含まれた評価差額	1,112千円

（デリバティブ取引関係）

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22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

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

2. 退職給付債務及びその内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成21年3月 31日現在)	当事業年度 (平成22年3月 31日現在)
退職給付債務	131,064	161,243
(1)年金資産	111,300	130,452
(2)退職給付引当金	11,503	10,758
(3)未認識数理計算上の差異	8,260	20,032
	なお、当期は事業譲受により引き継いだ退職給付債務17,931千円、年金資産12,686千円及び退職給付引当金5,245千円を含んでおります。	

3. 退職給付費用の内訳

(単位：千円)

	前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
退職給付費用	36,316	39,747
(1)勤務費用	22,465	29,006
(2)利息費用	2,519	3,276
(3)期待運用収益（減算）	547	796
(4)過去勤務債務の費用処理額	-	-
(5)数理計算上の差異の費用処理額	11,878	8,260

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21年3月 31日現在)	当事業年度 (平成22年3月 31日現在)
(1)割引率	2.5%	1.0%
(2)期待運用収益率	0.75%	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
(4)過去勤務債務の処理年数	1年	1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 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22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	10,742	賞与引当金繰入超過額	25,428
未払事業税	11,593	未払事業税	30,949
その他未払金	21,027	その他	26,538
その他	34,566		
繰延税金資産（流動）合計	77,929	繰延税金資産（流動）合計	82,915
繰延税金負債（流動）との相殺	15,238	繰延税金負債（流動）との相殺	3,809
繰延税金資産（流動）の純額	62,690	繰延税金資産（流動）の純額	79,106
繰延税金資産（固定）		繰延税金資産（固定）	
役員退職給与引当金	13,075	役員退職給与引当金	15,193
退職給付引当金	5,667	退職給付引当金	5,365
		その他	3,247
繰延税金資産（固定）合計	18,742	繰延税金資産（固定）合計	23,807
		繰延税金負債（固定）との相殺	7,619
繰延税金資産合計	81,433	繰延税金資産（固定）の純額	16,187
繰延税金負債（流動）		繰延税金資産合計	95,293
事業譲受に係る調整項目	15,238	繰延税金負債（流動）	
繰延税金負債（流動）合計	15,238	事業譲受に係る調整項目	3,809
繰延税金負債（流動）との相殺	15,238	繰延税金負債（流動）合計	3,809
繰延税金負債（流動）の純額	-	繰延税金負債（流動）との相殺	3,809
繰延税金資産の純額	81,433	繰延税金負債（流動）の純額	-
=====		繰延税金負債（固定）	
		事業譲受に係る調整項目	7,619
		繰延税金負債（固定）合計	7,619
		繰延税金負債（固定）との相殺	7,619
		繰延税金負債（固定）の純額	-
		繰延税金資産の純額	95,293
		=====	
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	
法定実効税率	40.7%	法定実効税率	40.7%
交際費等永久に損金に算入されない項目	5.9%	交際費等永久に損金に算入されない項目	3.6%
その他	0.3%	その他	0.0%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	44.2%
=====		=====	

（企業結合関係等）

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日												
<p>（事業譲受） 平成20年7月1日をもってステート・ストリート信託銀行株式会社より運用サービスについて事業を譲り受けました。</p> <p>1. 事業譲受相手企業の名称及び事業の内容、事業譲受の目的、事業譲受日、企業結合の法的形式並びに事業譲受企業の名称</p> <p>(1)事業譲受相手企業の名称及び事業の内容 ステート・ストリート信託銀行株式会社（銀行・信託業）</p> <p>(2)事業譲受の目的 ステート・ストリートグループ内の事業再編成</p> <p>(3)事業譲受日 平成20年7月1日</p> <p>(4)企業結合の法的形式 ステート・ストリート信託銀行株式会社を譲渡企業、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譲受会社とする事業譲受</p> <p>(5)事業譲受企業の名称 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</p> <p>2. 事業譲受相手企業から引き継いだ資産、負債及び純資産の内訳及び価額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 70%;">有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">42,421千円</td> </tr> <tr> <td>その他（資産）</td> <td style="text-align: right;">33,564千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金</td> <td style="text-align: right;">26,712千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;">5,245千円</td> </tr> <tr> <td>その他（負債）</td> <td style="text-align: right;">20,100千円</td> </tr> <tr> <td>純資産</td> <td style="text-align: right;">23,927千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	42,421千円	その他（資産）	33,564千円	賞与引当金	26,712千円	退職給付引当金	5,245千円	その他（負債）	20,100千円	純資産	23,927千円	<p>該当事項はありません。</p>
有形固定資産	42,421千円												
その他（資産）	33,564千円												
賞与引当金	26,712千円												
退職給付引当金	5,245千円												
その他（負債）	20,100千円												
純資産	23,927千円												

（関連当事者情報）

前事業年度

（追加情報）

当事業年度より、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準第11号 平成18年10月17日）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第13号 平成18年10月17日）を適用しております。

この結果、従来の開示対象範囲に対し、追加はありません。

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日
--

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の内 容又は 職業	議決権の 所有（被 所有）割 合	関係内容		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				
親会社	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	3.3億 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	所有 100%	なし	助言などの投資顧問サービス の提供並びに受入れ及びソフトウェアの使用契約及び人件費等及び事務手数料の支払	投資顧問料の受取	367,521	未収入金	36,567
								ソフトウェア使用料の支払	207,735	未払金	63,034
								投資顧問料の支払	350,427	未払費用	9,383
								人件費等の支払	237,932		
								事務手数料	739,279		

(2) 兄弟会社等

前事業年度											
自 平成20年4月 1日											
至 平成21年3月 31日											
属性	会社等の 名称	住所	資本金又 は 出資金	事業の内 容 又は 職業	議決権 の所有 (被所 有)割合	関係内容		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				
親会社の子会社	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	助言などの投資顧問サービス の提供及び費用の立替払い	投資顧問料の受取	165,174	未払金	20,619
								人件費等の支払	54,108		
								事務所賃借料の支払	11,429		
								資産運用に係る事業の譲受	譲受資産 75,985		
									譲受負債 52,057		

ステート・ストリート株式会社	東京都港区	1千万円	サービス業	なし	なし	備品の賃借及び事務管理サービスなどの役務の受入れ	備品賃借料の支払 役務料の支払	313 68,048	未払金	715
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	56,392	未収入金	3,294
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	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	56,513		
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情報提供コンサルタントサービスの提供	投資顧問料の受取 情報提供 コンサルタントサービスの提供	27,128 1,200	未収入金 未収入金	1,509 1,200
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・GmbH	ドイツミュンヘン	250万ユーロ	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	27,492	未収入金	3,227
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	5,352	未払金	2,166
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	6,081	未収収益	6,081
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	14,352	未収入金	790

(注) 上記(2)の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社とステート・ストリート株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

1. ソフトウェア使用料及び事務手数料については、グループ全体の費用を一定の基準で配分した金

額に基づき決定しております。

2. 事務所賃借料、備品賃借料については、実際支払額を基として支払いを行っております。
3. 役員料については、当社との間で締結された役員提供契約に基づいて支払われております。
4. 投資顧問料については、当社との間で締結された投資顧問契約に記載された料率に基づいて計算されております。
5. 事業譲受については、第三者の評価額を基に決定しております。

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・バンクアンドトラストカンパニー

（非上場）

ステート・ストリート・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

該当はありません。

当事業年度

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(2) 兄弟会社等

当事業年度											
自 平成21年4月 1日											
至 平成22年3月 31日											
属性	会社等の 名称	住 所	資本金又は 出資金	事業の内 容 又は 職業	議決権 の所有 (被所 有)割合	関係内容		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				

親会社の子会社	ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	助言などの投資顧問サービスを提供並びに受入れ及びソフトウェアの使用契約及び人件費等及び事務手数料の支払	投資顧問料の受取 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	258,438 168,552 269,665 191,216 694,820	未収入金 未払金 未払費用	33,424 365,368 14,565
	ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービス の受入、兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 事務所賃借料の支払 人件費等の支払	41,455 8,722 59,715	未払金	3,619
	ステート・ストリート株式会社	東京都港区	1千万円	サービス業	なし	なし	備品の賃借及び事務管理サービスなどの役務の受入れ	備品賃借料の支払 役務料の支払	263 47,703	未払金	-

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国 ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	14,590	未収入金	1,052
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国 ルクセンブルク市	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	43,978		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	投資顧問料の受取 紹介料の受取	10,790 82	未収入金 未収収益	- 82
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・GmbH	ドイツ ミュンヘン	250万ユーロ	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	46,435	未収入金	-
タッカーマン・グループ	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	1百万ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	4,461	未払金	2,512
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ, 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	11,647	未収収益	6,394
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・オーストラリア	オーストラリア シドニー	8百万オーストラリアドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の受取	9,894	未収入金	650

(注) 上記(2)の金額のうち、ステート・ストリート信託銀行株式会社とステート・ストリート株式会社に関しましては、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には、消費税等が含まれております。

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション

(ニューヨーク証券取引所に上場)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク

(非上場)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス

(非上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前事業年度 自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
1株当たり純資産 970,101円91銭 1株当たり当期純利益 163,702円80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 1,133,302円12銭 1株当たり当期純利益 163,200円20銭 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

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20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
当期純利益 (千円)	1,014,957	1,011,841
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益 (千円)	1,014,957	1,011,841
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20年4月 1日 至 平成21年3月 31日	当事業年度 自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月 31日
該当事項はありません。	当社が設定した私募投資信託4ファンドの繰上償還を翌事業年度で予定しており、翌事業年度の営業収益および営業費用が、大幅に減少する可能性があります。 なお、当事業年度における上記4ファンドからの営業収益および営業費用は以下のとおりです。 委託者報酬 4,008,136千円 支払手数料 2,614,000千円

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の第四部 特別情報、第2 その他の関係法人の概況は、以下の内容に更新・訂正されます。

1. 受託会社

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

名 称

中央三井アセット信託銀行株式会社

(再信託受託銀行:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

資本金の額(平成22年3月現在)

11,000百万円

(51,000百万円)

事業の内容

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

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

2. 販売会社

(1) 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 名 称	(2) 資本の額	(3) 事業の内容
中央三井信託銀行株式会社	399,697百万円 (平成22年3月現在)	銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。

(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21年10月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員

業務執行社員

公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成21年2月21日から平成21年8月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成21年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成21年2月21日から平成21年8月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月26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

業務執行社員

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 松重 忠之 印

公認会計士 高木 竜二 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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20年4月1日から平成21年3月31日までの第12期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

() 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10月13日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員

業務執行社員

公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成22年2月23日から平成22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。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成22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22年2月23日から平成22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。

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。

独立監査人の監査報告書

平成22年6月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 松村 直孝 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 高木 竜二 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第13期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

追加情報

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

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。
以上

() 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。