

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成23年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】 東京都港区赤坂九丁目7番1号

【事務連絡者氏名】 太田 裕之

【電話番号】 03 - 4530 - 7093

【届出の対象とした募集（売出）内
国投資信託受益証券に係るファンド
の名称】 ステート・ストリート日本株マーケット・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23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】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(略)

ファンドの関係法人

(略)

3) 中央三井アセット信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

（再信託受託会社：日本トラスティー・サービス信託銀行株式会社）

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

(略)

委託会社の概況（平成23年3月末現在）

(略)

3) 大株主の状況

(平成23年3月末現在)

| 氏名または名称 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|---|--------------------------------------|--------|------|
| ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス・インク | アメリカ合衆国デラウェア州ウィルミントン センターヴィル・ロード2711 | 6,200株 | 100% |

<訂正後>

(略)

ファンドの関係法人

(略)

3) 中央三井アセット信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）

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

（再信託受託会社：日本トラスティー・サービス信託銀行株式会社）

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

(略)

委託会社の概況（平成23年9月30日現在）

(略)

3) 大株主の状況

(平成23年9月30日現在)

| 氏名または名称 | 住所 | 所有株数 | 所有比率 |
|---|--------------------------------------|--------|------|
| ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インターナショナル・ホールディングス・インク | アメリカ合衆国デラウェア州ウィルミントン センターヴィル・ロード2711 | 6,200株 | 100% |

2【投資方針】

(4)【分配方針】（信託約款「運用の基本方針」中「収益分配方針」）

<訂正前>

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入および売買益等(評価益を含みます。)の範囲内とします。

収益分配金額は委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

<訂正後>

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収入および売買益等(評価益を含みます。)の範囲内とします。

収益分配金額は委託者が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないこともあります。

収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。

<収益分配金に関する留意事項>

・分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

・受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全てが、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

3【投資リスク】

<訂正前>

(1) ファンドのリスク特性

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

（略）

<訂正後>

(1) ファンドのリスク特性

当ファンドは、主にマザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界主要先進国の国債および政府機関債等に投資を行います。主として以下に掲げる要因等により基準価額が大きく変動する場合がありますので、受益権のお申込者はこの点を充分にご理解頂いたうえ、当ファンドの受益権へのお申込みを行ってください。なお、当ファンドは、金融機関の預金とは異なり、元本が保証されている商品ではなく、信託財産に生じた利益および損失は、すべて当ファンドの受益者に帰属します。したがって、投資者の皆さまの投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金とは異なります。

（略）

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

個人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は、配当所得として、平成23年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）の税率により源泉徴収が行われます。確定申告は不要ですが、確定申告による総合課税または申告分離課税を選択することができます。

一部解約および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、平成23年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）をご利用の場合には、原則として確定申告は不要です。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに償還時および解約時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税7%）、平成24年1月1日以降は15%（所得税15%）の税率により源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

(略)

< 訂正後 >

(略)

個人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金は、配当所得として、平成25年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）の税率により源泉徴収が行われます。確定申告は不要ですが、確定申告による総合課税または申告分離課税を選択することができます。

一部解約および償還時の差益（譲渡益）については、譲渡所得として、平成25年12月31日までは10%（所得税7%、地方税3%）、平成26年1月1日以降は20%（所得税15%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）をご利用の場合には、原則として確定申告は不要です。

法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに償還時および解約時の個別元本超過額については、平成25年12月31日までは7%（所得税7%）、平成26年1月1日以降は15%（所得税15%）の税率により源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

(略)

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

(1)【投資状況】

(平成23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 | 55,407,164 | 100.21 |
| コール・ローン、その他資産(負債控除後) | | 118,398 | 0.21 |
| 純資産総額 | | 55,288,766 | 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23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 | 3,590,679,042 | 88.43 |
| コール・ローン、その他資産（負債控除後） | | 470,013,154 | 11.57 |
| 純資産総額 | | 4,060,692,196 | 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 （169銘柄） | 日本 | 4,241,778 | 4,001,298,454 | 3,596,480,750 | 88.57 |

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成23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 | | 41,155,140 | 1.3927 | 57,316,764 | 1.3463 | 55,407,164 | 100.21 |
| | | | | | | | | | 投資比率：合計 | 100.21 |

（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 | - | 100.21 |
| 合計 | | 100.21 |

（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23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 | シップヘルスケアホールディングス | 卸売業 | 39,600 | 1,071 | 42,411,600 | 1,927 | 76,309,200 | 1.88 |
| 2 | 日本 | 株式 | ADEKA | 化学 | 72,200 | 929 | 67,073,800 | 835 | 60,287,000 | 1.48 |
| 3 | 日本 | 株式 | コーナン商事 | 小売業 | 41,500 | 1,176 | 48,804,000 | 1,372 | 56,938,000 | 1.40 |
| 4 | 日本 | 株式 | 東映 | 情報・通信業 | 148,910 | 440 | 65,520,400 | 382 | 56,883,620 | 1.40 |
| 5 | 日本 | 株式 | 山崎製パン | 食料品 | 48,000 | 963 | 46,224,000 | 1,178 | 56,544,000 | 1.39 |
| 6 | 日本 | 株式 | 日本曹達 | 化学 | 159,000 | 435 | 69,165,000 | 354 | 56,286,000 | 1.39 |
| 7 | 日本 | 株式 | シーエーシー | 情報・通信業 | 86,900 | 699 | 60,743,100 | 637 | 55,355,300 | 1.36 |
| 8 | 日本 | 株式 | 日清紡ホールディングス | 繊維製品 | 76,000 | 906 | 68,856,000 | 681 | 51,756,000 | 1.27 |
| 9 | 日本 | 株式 | 日本製粉 | 食料品 | 136,000 | 407 | 55,352,000 | 377 | 51,272,000 | 1.26 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|----|--------------|----------|---------|-------|------------|-------|------------|-------|
| 10 | 日本 | 株式 | 島忠 | 小売業 | 26,500 | 1,898 | 50,297,000 | 1,868 | 49,502,000 | 1.22 |
| 11 | 日本 | 株式 | 日本触媒 | 化学 | 51,000 | 976 | 49,776,000 | 970 | 49,470,000 | 1.22 |
| 12 | 日本 | 株式 | サークルKサンクス | 小売業 | 37,300 | 1,425 | 53,152,500 | 1,308 | 48,788,400 | 1.20 |
| 13 | 日本 | 株式 | NECフィールディング | サービス業 | 48,500 | 1,037 | 50,294,500 | 987 | 47,869,500 | 1.18 |
| 14 | 日本 | 株式 | 出光興産 | 石油・石炭製品 | 6,800 | 9,810 | 66,708,000 | 7,020 | 47,736,000 | 1.18 |
| 15 | 日本 | 株式 | 東京急行電鉄 | 陸運業 | 122,000 | 382 | 46,604,000 | 390 | 47,580,000 | 1.17 |
| 16 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 61,300 | 884 | 54,189,200 | 748 | 45,852,400 | 1.13 |
| 17 | 日本 | 株式 | ケーヨー | 小売業 | 90,300 | 452 | 40,815,600 | 487 | 43,976,100 | 1.08 |
| 18 | 日本 | 株式 | 旭硝子 | ガラス・土石製品 | 57,000 | 1,148 | 65,436,000 | 762 | 43,434,000 | 1.07 |
| 19 | 日本 | 株式 | 丸紅 | 卸売業 | 98,000 | 654 | 64,092,000 | 439 | 43,022,000 | 1.06 |
| 20 | 日本 | 株式 | タチエス | 輸送用機器 | 31,100 | 1,667 | 51,843,700 | 1,376 | 42,793,600 | 1.05 |
| 21 | 日本 | 株式 | 住友電気工業 | 非鉄金属 | 46,400 | 1,242 | 57,628,800 | 917 | 42,548,800 | 1.05 |
| 22 | 日本 | 株式 | 日新 | 倉庫・運輸関連業 | 215,000 | 247 | 53,105,000 | 194 | 41,710,000 | 1.03 |
| 23 | 日本 | 株式 | セイノーホールディングス | 陸運業 | 65,000 | 637 | 41,405,000 | 634 | 41,210,000 | 1.01 |
| 24 | 日本 | 株式 | 大和冷機工業 | 機械 | 103,000 | 434 | 44,702,000 | 399 | 41,097,000 | 1.01 |
| 25 | 日本 | 株式 | 三菱重工業 | 機械 | 122,000 | 358 | 43,676,000 | 329 | 40,138,000 | 0.99 |
| 26 | 日本 | 株式 | 三井化学 | 化学 | 147,000 | 325 | 47,775,000 | 261 | 38,367,000 | 0.94 |
| 27 | 日本 | 株式 | エディオン | 小売業 | 57,900 | 882 | 51,067,800 | 652 | 37,750,800 | 0.93 |
| 28 | 日本 | 株式 | 雪印メグミルク | 食料品 | 23,100 | 1,484 | 34,280,400 | 1,596 | 36,867,600 | 0.91 |
| 29 | 日本 | 株式 | 武蔵精密工業 | 輸送用機器 | 19,600 | 2,232 | 43,747,200 | 1,877 | 36,789,200 | 0.91 |
| 30 | 日本 | 株式 | DCMホールディングス | 小売業 | 53,900 | 526 | 28,351,400 | 680 | 36,652,000 | 0.90 |
| | | | | | | | | | 投資比率：合計 | 35.07 |

(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 | 小売業 | 10.80 |
| | 化学 | 10.47 |
| | 電気機器 | 7.53 |
| | 卸売業 | 6.37 |
| | 機械 | 6.22 |
| | 食料品 | 5.98 |
| | 情報・通信業 | 5.56 |
| | 輸送用機器 | 4.31 |
| | サービス業 | 4.22 |
| | 陸運業 | 3.98 |
| | 非鉄金属 | 3.42 |
| | 医薬品 | 3.25 |
| | 繊維製品 | 1.88 |
| | 金属製品 | 1.78 |
| | 鉄鋼 | 1.64 |
| | ガラス・土石製品 | 1.49 |
| | 石油・石炭製品 | 1.41 |
| | ゴム製品 | 1.32 |
| | 倉庫・運輸関連業 | 1.03 |
| | その他金融業 | 0.92 |
| 建設業 | 0.91 | |
| 保険業 | 0.86 | |
| 銀行業 | 0.79 | |
| 水産・農林業 | 0.70 | |
| その他製品 | 0.50 | |

| | | |
|----|-------|-------|
| | パルプ・紙 | 0.50 |
| | 鉱業 | 0.30 |
| | 不動産業 | 0.29 |
| | 小計 | 88.43 |
| 合計 | | 88.43 |

(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23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 | ゼンショー | 小売業 | 52,600 | 895 | 47,077,000 | 1,093 | 57,491,800 | 1.42 |
| 2 | 日本 | 株式信用売 | パソナグループ | サービス業 | 705 | 69,200 | 48,786,000 | 79,000 | 55,695,000 | 1.37 |
| 3 | 日本 | 株式信用売 | 日本ケミファ | 医薬品 | 169,000 | 293 | 49,517,000 | 318 | 53,742,000 | 1.32 |
| 4 | 日本 | 株式信用売 | 住生活グループ | 金属製品 | 24,200 | 1,941 | 46,972,200 | 2,183 | 52,828,600 | 1.30 |
| 5 | 日本 | 株式信用売 | 千代田化工建設 | 建設業 | 67,000 | 753 | 50,451,000 | 765 | 51,255,000 | 1.26 |
| 6 | 日本 | 株式信用売 | ゼリア新薬工業 | 医薬品 | 38,000 | 1,013 | 38,494,000 | 1,320 | 50,160,000 | 1.24 |
| 7 | 日本 | 株式信用売 | アサツー ディ・ケイ | サービス業 | 23,000 | 2,355 | 54,165,000 | 2,147 | 49,381,000 | 1.22 |
| 8 | 日本 | 株式信用売 | ビジョン | その他製品 | 15,400 | 2,523 | 38,854,200 | 3,185 | 49,049,000 | 1.21 |
| 9 | 日本 | 株式信用売 | ミスミグループ 本社 | 卸売業 | 26,300 | 2,054 | 54,020,200 | 1,735 | 45,630,500 | 1.12 |
| 10 | 日本 | 株式信用売 | 日本ペイント | 化学 | 72,000 | 625 | 45,000,000 | 627 | 45,144,000 | 1.11 |
| 11 | 日本 | 株式信用売 | 江崎グリコ | 食料品 | 43,000 | 951 | 40,893,000 | 996 | 42,828,000 | 1.05 |
| 12 | 日本 | 株式信用売 | コロワイド | 小売業 | 84,000 | 512 | 43,008,000 | 504 | 42,336,000 | 1.04 |
| 13 | 日本 | 株式信用売 | シマノ | 輸送用機器 | 10,200 | 4,090 | 41,718,000 | 4,125 | 42,075,000 | 1.04 |
| 14 | 日本 | 株式信用売 | アリアケジャパン | 食料品 | 25,800 | 1,460 | 37,668,000 | 1,577 | 40,686,600 | 1.00 |
| 15 | 日本 | 株式信用売 | 日本毛織 | 繊維製品 | 57,000 | 731 | 41,667,000 | 694 | 39,558,000 | 0.97 |
| 16 | 日本 | 株式信用売 | ヤクルト本社 | 食料品 | 15,900 | 2,347 | 37,317,300 | 2,417 | 38,430,300 | 0.95 |
| 17 | 日本 | 株式信用売 | 浜松ホトニクス | 電気機器 | 12,000 | 3,240 | 38,880,000 | 3,145 | 37,740,000 | 0.93 |
| 18 | 日本 | 株式信用売 | 小田急電鉄 | 陸運業 | 51,000 | 778 | 39,678,000 | 738 | 37,638,000 | 0.93 |

| | | | | | | | | | | |
|----|----|-------|--------------------------------|--------|---------|-------|------------|-------|------------|-------|
| 19 | 日本 | 株式信用売 | カゴメ | 食料品 | 24,500 | 1,533 | 37,558,500 | 1,531 | 37,509,500 | 0.92 |
| 20 | 日本 | 株式信用売 | 京浜急行電鉄 | 陸運業 | 52,000 | 672 | 34,944,000 | 716 | 37,232,000 | 0.92 |
| 21 | 日本 | 株式信用売 | MS & ADイン シュアランスグ ループホール | 保険業 | 21,500 | 2,246 | 48,289,000 | 1,696 | 36,464,000 | 0.90 |
| 22 | 日本 | 株式信用売 | ヤマハ発動機 | 輸送用機器 | 34,400 | 1,538 | 52,907,200 | 1,036 | 35,638,400 | 0.88 |
| 23 | 日本 | 株式信用売 | 近畿日本鉄道 | 陸運業 | 122,000 | 263 | 32,086,000 | 292 | 35,624,000 | 0.88 |
| 24 | 日本 | 株式信用売 | 松竹 | 情報・通信業 | 48,000 | 646 | 31,008,000 | 730 | 35,040,000 | 0.86 |
| 25 | 日本 | 株式信用売 | 大陽日酸 | 化学 | 63,000 | 746 | 46,998,000 | 542 | 34,146,000 | 0.84 |
| 26 | 日本 | 株式信用売 | 清水建設 | 建設業 | 97,000 | 347 | 33,659,000 | 344 | 33,368,000 | 0.82 |
| 27 | 日本 | 株式信用売 | クレディセゾン | その他金融業 | 22,000 | 1,664 | 36,608,000 | 1,509 | 33,198,000 | 0.82 |
| 28 | 日本 | 株式信用売 | 牧野フライス製 作所 | 機械 | 69,000 | 757 | 52,233,000 | 461 | 31,809,000 | 0.78 |
| 29 | 日本 | 株式信用売 | J S R | 化学 | 23,600 | 1,811 | 42,739,600 | 1,346 | 31,765,600 | 0.78 |
| 30 | 日本 | 株式信用売 | 日新製鋼 | 鉄鋼 | 222,000 | 177 | 39,294,000 | 140 | 31,080,000 | 0.77 |
| | | | | | | | | | 投資比率：合計 | 30.65 |

(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23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： | 107,341,912 | 分配付： | 1.0383 |
| | | 分配落： | 107,341,912 | 分配落： | 1.0383 |
| 第2期 | (平成16年 2月20日) | 分配付： | 198,643,529 | 分配付： | 1.1064 |
| | | 分配落： | 198,643,529 | 分配落： | 1.1064 |
| 第3期 | (平成17年 2月21日) | 分配付： | 713,259,880 | 分配付： | 1.1616 |
| | | 分配落： | 713,259,880 | 分配落： | 1.1616 |
| 第4期 | (平成18年 2月20日) | 分配付： | 506,893,661 | 分配付： | 1.1421 |
| | | 分配落： | 506,893,661 | 分配落： | 1.1421 |
| 第5期 | (平成19年 2月20日) | 分配付： | 226,529,845 | 分配付： | 1.1487 |
| | | 分配落： | 224,557,773 | 分配落： | 1.1387 |
| 第6期 | (平成20年 2月20日) | 分配付： | 153,699,757 | 分配付： | 1.1147 |
| | | 分配落： | 153,699,757 | 分配落： | 1.1147 |
| 第7期 | (平成21年 2月20日) | 分配付： | 106,967,021 | 分配付： | 1.0095 |
| | | 分配落： | 106,967,021 | 分配落： | 1.0095 |

| | | | |
|------------|---------------|------------------------------------|----------------------------|
| 第8期 | (平成22年 2月22日) | 分配付： 92,631,936 分配落： 92,631,936 | 分配付： 0.9751 分配落： 0.9751 |
| 第9期 | (平成23年 2月21日) | 分配付： 76,868,159 分配落： 76,868,159 | 分配付： 0.9709 分配落： 0.9709 |
| 平成22年 9月末日 | | 79,061,380 | 0.9511 |
| 10月末日 | | 79,684,175 | 0.9586 |
| 11月末日 | | 75,716,581 | 0.9564 |
| 12月末日 | | 77,091,352 | 0.9738 |
| 平成23年 1月末日 | | 76,502,752 | 0.9663 |
| 2月末日 | | 75,267,061 | 0.9635 |
| 3月末日 | | 68,575,183 | 0.9617 |
| 4月末日 | | 66,588,269 | 0.9641 |
| 5月末日 | | 56,797,499 | 0.9393 |
| 6月末日 | | 55,620,309 | 0.9331 |
| 7月末日 | | 56,204,613 | 0.9429 |
| 8月末日 | | 55,410,413 | 0.9295 |
| 9月末日 | | 55,288,766 | 0.9275 |

【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 |
| 第9期 | (平成23年 2月21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% |
| 第9期 | 自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日 | 0.4% |
| | 自平成23年 2月22日 至平成23年 9月30日 | 4.5% |

(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。

(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 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 |
| 第9期 | 自平成22年 2月23日 至平成23年 2月21日 | 0 | 15,824,435 | 79,168,479 |
| | 自平成23年 2月22日 至平成23年 9月30日 | 0 | 19,557,788 | 59,610,691 |

(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3【ファンドの経理状況】

原届出書の第二部 ファンド情報、第3 ファンドの経理状況につきましては、末尾に以下の中間財務諸表が、追加されます。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、前中間計算期間(平成22年2月23日から平成22年8月22日まで)については、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しており、当中間計算期間(平成23年2月22日から平成23年8月21日まで)については、改正後の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前中間計算期間(平成22年2月23日から平成22年8月22日まで)及び当中間計算期間(平成23年2月22日から平成23年8月21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22年 8月22日現在) | 当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,760,740 | 189,880 |
| 親投資信託受益証券 | 78,182,556 | 56,107,118 |
| 未収利息 | 9 | - |
| 流動資産合計 | 79,943,305 | 56,296,998 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 895,183 | - |
| 未払受託者報酬 | 43,592 | 32,756 |
| 未払委託者報酬 | 741,005 | 556,788 |
| その他未払費用 | 26,091 | 19,596 |
| 流動負債合計 | 1,705,871 | 609,140 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 83,126,017 ¹ | 59,610,691 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 4,888,583 ³ | 3,922,833 |
| (分配準備積立金) | 3,316,050 | 2,414,229 |
| 元本等合計 | 78,237,434 | 55,687,858 |
| 純資産合計 | 78,237,434 | 55,687,858 |
| 負債純資産合計 | 79,943,305 | 56,296,998 |

(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22年 2月23日 至平成22年 8月22日 | 当中間計算期間 自平成23年 2月22日 至平成23年 8月21日 |
|-------------------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 546 | 5 |
| 有価証券売買等損益 | 2,160,933 | 2,159,501 |
| 営業収益合計 | 2,160,387 | 2,159,496 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 43,592 | 32,756 |
| 委託者報酬 | 741,005 | 556,788 |
| その他費用 | 26,091 | 19,596 |
| 営業費用合計 | 810,688 | 609,140 |
| 営業損失() | 2,971,075 | 2,768,636 |
| 経常損失() | 2,971,075 | 2,768,636 |
| 中間純損失() | 2,971,075 | 2,768,636 |
| 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額() | 127,364 | 547,048 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 2,360,978 | 2,300,320 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 316,106 | 599,075 |
| 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 | 599,075 |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 4,888,583 | 3,922,833 |

(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22年 2月23日 至 平成22年 8月22日 | 当中間計算期間 自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21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。 | 計算期間 平成23年2月20日が休日のため、当中間計算期間は平成23年2月22日から平成23年8月21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22年 8月22日現在) | 当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在) |
|----------------------|--|--|
| 1 期首元本額 | 94,992,914円 | 79,168,479円 |
| 期中追加設定元本額 | 円 | 円 |
| 期中一部解約元本額 | 11,866,897円 | 19,557,788円 |
| 2 中間計算期間末日における受益権の総数 | 83,126,017口 | 59,610,691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3,922,833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。

当中間計算期間（自 平成23年2月22日 至 平成23年8月21日）

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 当中間計算期間末 (平成23年 8月21日現在) |
|-------------------------|---------------------------------------|
| 1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 | 中間貸借対照表計上額は期末時価を計上しているため、その差額ははありません。 |

| | |
|---------------------------|---|
| 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 「中間注記表（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 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> |

（有価証券関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

前中間計算期間末（平成22年8月22日現在）

該当する事項はありません。

当中間計算期間末（平成23年8月21日現在）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

| | 前中間計算期間末 （平成22年 8月22日現在） | 当中間計算期間末 （平成23年 8月21日現在） |
|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額） | 0.9412円 （9,412円） | 0.9342円 （9,342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22年 8月22日現在) | (平成23年 8月21日現在) |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| | | 金 額 | 金 額 |
| 資産の部 | | | |
| 流動資産 | | | |
| 金銭信託 | | 590,357 | 368,365 |
| コール・ローン | | 1,087,958,975 | 805,104,222 |
| 株式 | 3 | 5,441,859,776 | 3,489,321,810 |
| 未収入金 | | | 45,040,070 |
| 信用取引預け金 | | 5,376,128,465 | 3,440,257,348 |
| 未収配当金 | | 4,935,400 | 2,967,700 |
| 未収利息 | | 2,086 | 1,544 |
| 差入保証金 | | 10,000,000 | 10,000,000 |
| 流動資産合計 | | 11,921,475,059 | 7,793,061,059 |
| 資産合計 | | 11,921,475,059 | 7,793,061,059 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 信用売証券 | | 5,396,303,450 | 3,472,328,540 |
| 未払金 | | | 13,317,980 |
| その他未払費用 | | 12,685,476 | 10,983,675 |
| 流動負債合計 | | 5,408,988,926 | 3,496,630,195 |
| 負債合計 | | 5,408,988,926 | 3,496,630,195 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 4,873,249,839 | 3,175,285,911 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 1,639,236,294 | 1,121,144,953 |
| 元本等合計 | | 6,512,486,133 | 4,296,430,864 |
| 純資産合計 | | 6,512,486,133 | 4,296,430,864 |
| 負債純資産合計 | | 11,921,475,059 | 7,793,061,059 |

(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22年 2月23日 至 平成22年 8月22日 | 自 平成23年 2月22日 至 平成23年 8月21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）、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>株式 同左</p> <p>信用売証券 同左</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22年 8月22日現在） | （平成23年 8月21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 | 6,877,372,000円 | 4,516,033,965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 | 2,004,122,161円 | 1,340,748,054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 | 58,502,362円 | 41,465,611円 |
| 日本株式ロングショート・マーケット | 4,814,747,477円 | 3,133,820,300円 |
| ニュートラルファンド 適格機関投資家限定 | | |
| 計 | 4,873,249,839円 | 3,175,285,911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 | 4,873,249,839口 | 3,175,285,911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 2,494,987,716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 1,637,948,720円 |

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

| 区分 | （平成23年 8月21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期末時価を計上しているため、その差額はありません。 |
| 2 金融商品の時価の算定方法 | (1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。 (3)デリバティブ取引 該当する事項はありません。 |

| | |
|---------------------------|---|
| 3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
|---------------------------|---|

(有価証券関係に関する注記)

(平成22年8月22日現在)

該当する事項はありません。

(平成23年8月21日現在)

該当する事項はありません。

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

(平成22年8月22日現在)

該当する事項はありません。

(平成23年8月21日現在)

該当する事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| | (平成22年 8月22日現在) | (平成23年 8月21日現在) |
|--|----------------------|----------------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.3364円 (13,364円) | 1.3531円 (13,531円) |

2【ファンドの現況】（下記の内容に更新されます。）

【純資産額計算書】

（平成23年9月30日現在）

| | |
|----------------------------------|---------------------|
| 資産総額 | 55,407,164円 |
| 負債総額 | 118,398円 |
| 純資産総額（ - ） | 55,288,766円 |
| 発行済口数 | 59,610,691口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額） | 0.9275円 （9,275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23年9月30日現在）

| | |
|----------------------------------|----------------------|
| 資産総額 | 7,685,669,454円 |
| 負債総額 | 3,624,977,258円 |
| 純資産総額（ - ） | 4,060,692,196円 |
| 発行済口数 | 3,016,124,092口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額） | 1.3463円 （13,463円） |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】（下記の内容に更新されます。）

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23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23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23年9月30日現在)。

最近5年間における主な資本金の額の増減

該当事項はありません。

(略)

(2) 委託会社の機構

各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

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

| | |
|-------|--|
| 内部監査部 | 経営諸活動の内部統制システムの妥当性や有効性について検証・評価し、その結果及び改善案を経営陣に対して報告 |
|-------|--|

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また金融商品取引法に定める投資助言業、第1種金融商品取引業及び第2種金融商品取引業を行っています。

平成23年9月30日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計114本であり、その純資産総額は877,783百万円です(親投資信託は除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)

第2【その他の関係法人の概況】（下記の内容に更新されます。）

（1）【名称、資本金の額及び事業の内容】

1. 受託会社

名称

中央三井アセット信託銀行株式会社

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

（再信託受託銀行：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

資本金の額（平成23年9月末日現在）

11,000百万円

（51,000百万円）

事業の内容

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

2. 販売会社

（1）名称、資本金の額及び事業の内容

| (1) 名称 | (2) 資本金の額 | (3) 事業の内容 |
|--------------|---------------------------|--|
| 中央三井信託銀行株式会社 | 399,697百万円 (平成23年3月現在) | 銀行法に基づく銀行業および金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づく信託業を営むとともに、金融商品取引法に基づく登録を受けて投資信託証券の募集の取扱い等を行っています。 |

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

（2）【関係業務の概要】

受託会社は主として、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。

販売会社は主として、受益権の募集取扱、収益分配金の再投資、収益分配金・償還金及び解約金の支払いの取扱い、目論見書・運用報告書の交付等を行います。

（3）【資本関係】

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成22年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 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株マーケット・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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月21日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 松村 直孝 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 高木 竜二 印

業務執行社員

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

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

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

追加情報

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

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

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

独立監査人の中間監査報告書

平成23年10月12日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中あらた監査法人
指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成23年2月22日から平成23年8月21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23年8月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(平成23年2月22日から平成23年8月21日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月20日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 高木 竜二 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 丘本 正彦 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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