

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年11月20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24年5月18日付をもって提出した有価証券届出書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】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的および基本的性格】

(略)

< 訂正前 >

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年 1回	グローバル			
	年 2回	日本			ブル・ベア型
	年 4回	北米			
債券 一般 国債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	あり ()	条件付運用型
	年12回 (毎月)	アジア			
	年12回 (毎月)	オセアニア			ロング・ ショート型/ 絶対収益追求型
不動産投信	日々	中南米			
その他資産 (投資信託証券 (株式))	その他 ()	アフリカ	ファンド・ オブ・ ファンズ	なし	
		中近東 (中東)			その他 ()
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		エマージング			

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

< 訂正後 >

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株	年 1回	グローバル			
	年 2回	日本			ブル・ベア型
	年 4回	北米			
債券 一般 国債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年 6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	あり ()	条件付運用型
	年12回 (毎月)	アジア			
	年12回 (毎月)	オセアニア			ロング・ ショート型/ 絶対収益追求型
不動産投信	日々	中南米			
			ファンド・	なし	

その他資産 (投資信託証券 (株式))	その他 ()	アフリカ 中近東 (中東)	オブ・ ファンズ		その他 ()
資産複合 資産配分固定型 資産配分変動型		エマージング			

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

(注)当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

当ファンドは、マザーファンドの受益証券(投資信託証券)を主要投資対象とするファミリーファンド方式で運用を行うため、属性区分におけるファンドの投資対象資産は、「その他資産(投資信託証券(債券))」となり、商品分類における投資対象資産(収益の源泉)である「債券」とは分類・区分が異なります。

(3)【ファンドの仕組み】

(略)

<訂正前>

ファンドの関係法人

(略)

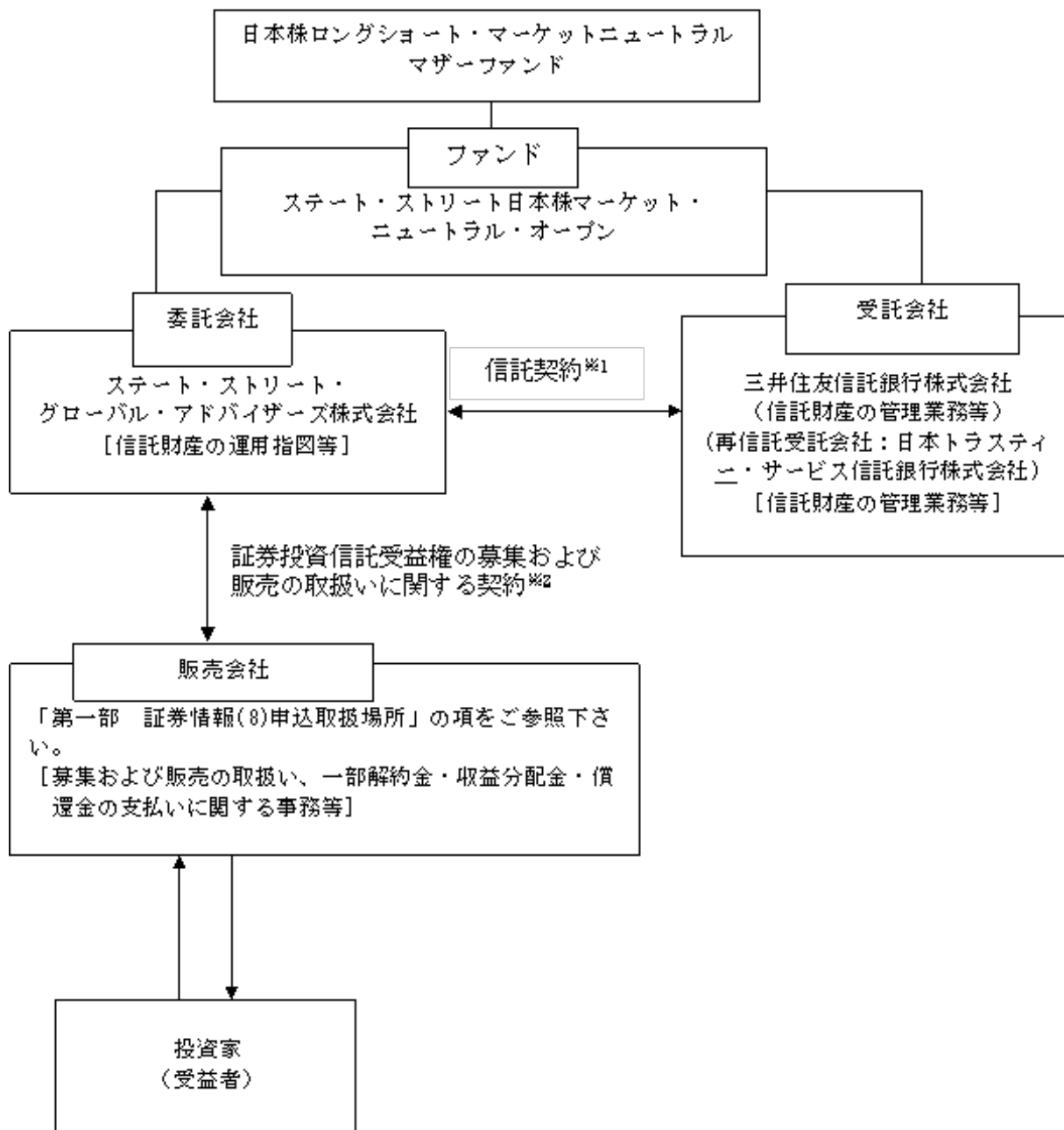
2) 三井住友信託銀行株式会社(以下「受託会社」といいます。)

(再信託受託会社：日本トラスティニ・サービス信託銀行株式会社)

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

(略)

ファンド関係法人



1 信託契約

委託会社および受託会社、受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項、信託の元本および収益の管理および運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが信託契約を締結することにより成立します。信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

2 証券投資信託受益権の募集および販売の取扱いに関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

委託会社の概況（平成24年3月末現在）

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社名変更
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20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24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>

ファンドの関係法人

(略)

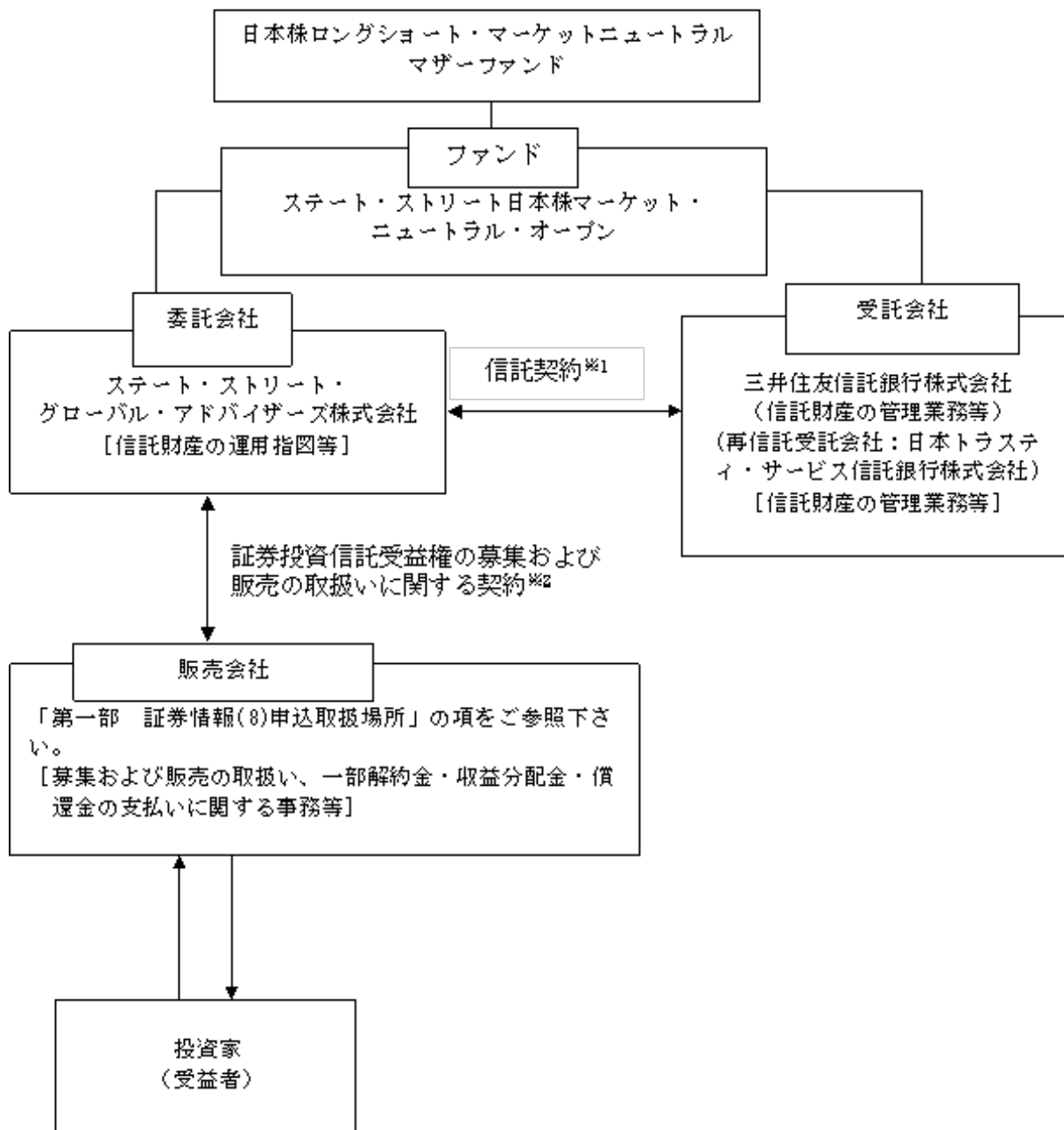
2) 三井住友信託銀行株式会社(以下「受託会社」といいます。)

(再信託受託会社：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

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

(略)

ファンド関係法人



1 信託契約

委託会社および受託会社、受益者に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益権に関する事項、信託の元本および収益の管理および運営に関する事項等が定められます。

なお、ファンドは、委託会社と受託会社とが信託契約を締結することにより成立します。信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、あらかじめ監督官庁に届け出た信託約款の内容に基づいて締結されます。

2 証券投資信託受益権の募集および販売の取扱いに関する契約

販売会社の募集の取扱い、換金の取扱い、償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められます。

委託会社の概況（平成24年9月28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社名変更
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20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24年9月28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】

(3)【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

上記運用体制は平成24年3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。

< 訂正後 >

(略)

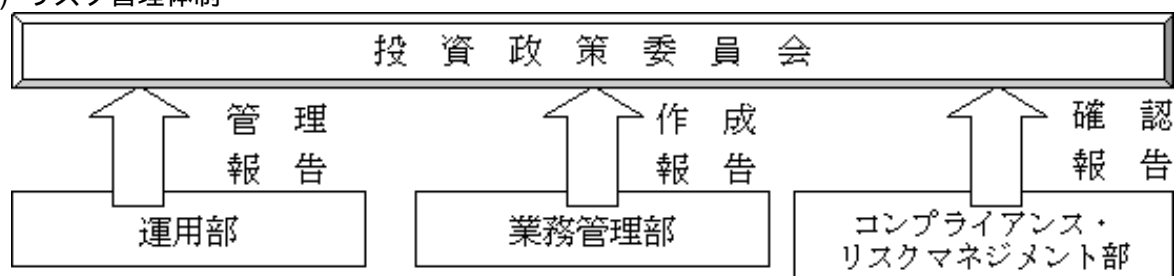
上記運用体制は平成24年9月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

3【投資リスク】

< 訂正前 >

(略)

(2) リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

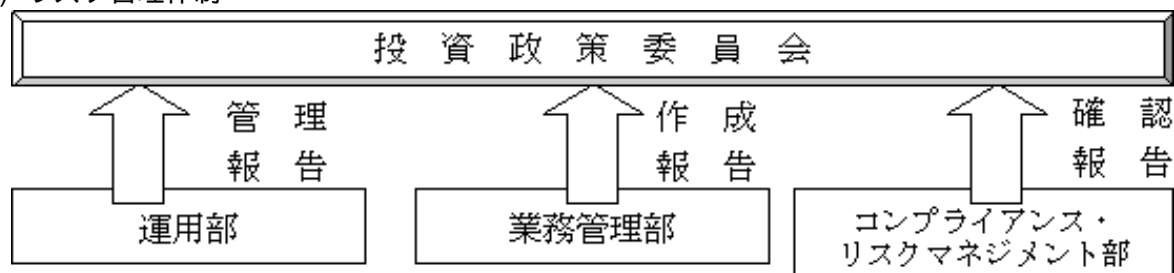
< 訂正後 >

(略)

(2) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

(3) リスク管理体制



運用部に属するポートフォリオ・マネージャーは信託約款に定める運用方針に加え、内部ガイドラインを作成し、徹底したリスク管理と厳格なポートフォリオ管理を行います。

業務管理部の運用評価グループは、毎月パフォーマンス分析レポートを作成し、月次収益率と対ベンチマーク超過リターンの算出と要因分析を行います。

コンプライアンス・リスクマネジメント部では、全ファンドにおける運用ガイドライン遵守状況を運用部から離れた立場で確認しております。

投資政策委員会において投資行動やパフォーマンスに関する運用の報告内容を確認するとともに、毎月末の運用ガイドライン遵守状況等の確認をします。

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

（下記の内容に更新されます。）

<更新後>

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

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

[平成24年12月31日までの間]

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

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

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

<換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

[平成24年12月31日までの間]

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

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

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

[譲渡損失と収益分配金との間の損益通算について]

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

法人の投資家に対する課税

[平成24年12月31日までの間]

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

[平成25年1月1日から平成25年12月31日までの間]

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

なお、益金不算入制度は適用されません。

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】（下記の内容に更新されます。）

(1)【投資状況】

(平成24年9月28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	42,161,644	100.21
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		89,135	0.21
純資産総額		42,072,509	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24年9月28日現在)

種類	国/地域名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	3,347,914,570	91.64
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		305,355,283	8.36
純資産総額		3,653,269,853	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 (162銘柄)	日本	4,513,538	3,522,189,321	3,402,994,360	93.15

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

(平成24年9月28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		32,764,722	1.3771	45,120,299	1.2868	42,161,644	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24年9月28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	東映	情報・通信業	148,910	389	57,925,990	439	65,371,490	1.79
2	日本	株式	シーエーシー	情報・通信業	86,900	680	59,092,000	674	58,570,600	1.60
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	14,600	3,482	50,829,921	3,720	54,312,000	1.49
4	日本	株式	日本曹達	化学	159,000	369	58,671,000	337	53,583,000	1.47
5	日本	株式	丸紅	卸売業	98,000	557	54,586,000	498	48,804,000	1.34
6	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	61,300	899	55,108,700	791	48,488,300	1.33
7	日本	株式	積水ハウス	建設業	62,000	746	46,252,000	775	48,050,000	1.32
8	日本	株式	日本製粉	食料品	136,000	366	49,776,000	348	47,328,000	1.30
9	日本	株式	東京鐵鋼	鉄鋼	181,000	288	52,147,075	261	47,241,000	1.29
10	日本	株式	N E C フィールド イング	サービス業	48,500	983	47,675,500	954	46,269,000	1.27
11	日本	株式	日本触媒	化学	51,000	940	47,940,000	873	44,523,000	1.22
12	日本	株式	日新	倉庫・運輸関連 業	215,000	215	46,225,000	206	44,290,000	1.21
13	日本	株式	ユニー	小売業	71,800	776	55,684,378	607	43,582,600	1.19
14	日本	株式	出光興産	石油・石炭製品	6,800	8,470	57,596,000	6,400	43,520,000	1.19
15	日本	株式	島忠	小売業	26,500	1,821	48,256,500	1,630	43,195,000	1.18
16	日本	株式	A D E K A	化学	72,200	761	54,944,200	589	42,525,800	1.16
17	日本	株式	キョーリン製薬ホー ルディングス	医薬品	22,000	1,420	31,240,000	1,921	42,262,000	1.16
18	日本	株式	横浜ゴム	ゴム製品	73,000	528	38,544,000	576	42,048,000	1.15
19	日本	株式	東邦ホールディング ス	卸売業	26,300	1,521	40,008,089	1,598	42,027,400	1.15
20	日本	株式	A O K I ホールディ ングス	小売業	24,600	1,405	34,569,127	1,690	41,574,000	1.14
21	日本	株式	双日	卸売業	407,500	138	56,406,201	101	41,157,500	1.13
22	日本	株式	スズケン	卸売業	15,800	2,506	39,590,125	2,595	41,001,000	1.12
23	日本	株式	ケーヨー	小売業	90,300	524	47,317,200	451	40,725,300	1.11
24	日本	株式	住友商事	卸売業	38,100	1,129	42,997,674	1,053	40,119,300	1.10
25	日本	株式	東芝テック	電気機器	115,000	283	32,545,000	346	39,790,000	1.09
26	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	29,100	1,448	42,136,800	1,338	38,935,800	1.07
27	日本	株式	住友電気工業	非鉄金属	46,400	1,021	47,374,400	825	38,280,000	1.05
28	日本	株式	コーナン商事	小売業	41,500	1,203	49,924,500	922	38,263,000	1.05
29	日本	株式	フジ・メディア・ ホールディングス	情報・通信業	292	121,037	35,342,893	127,800	37,317,600	1.02
30	日本	株式	大和冷機工業	機械	103,000	425	43,775,000	362	37,286,000	1.02
									投資比率：合計	36.71

（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	卸売業	11.08
	小売業	10.67
	情報・通信業	10.27
	化学	8.57
	機械	6.67
	食料品	5.32
	電気機器	4.87
	輸送用機器	4.16
	サービス業	3.49
	非鉄金属	2.92
	建設業	2.62
	医薬品	2.55
	鉄鋼	2.32
	陸運業	1.98

その他製品	1.71
銀行業	1.62
その他金融業	1.36
金属製品	1.23
倉庫・運輸関連業	1.21
石油・石炭製品	1.19
ゴム製品	1.15
パルプ・紙	1.09
保険業	1.07
繊維製品	0.95
鉱業	0.85
不動産業	0.52
空運業	0.20
合計	91.64

(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24年9月28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	ヤクルト本社	食料品	15,900	2,687	42,722,852	3,700	58,830,000	1.61
2	日本	株式信用売	シマノ	輸送用機器	10,200	4,655	47,480,503	5,680	57,936,000	1.59
3	日本	株式信用売	東光	電気機器	285,000	242	69,080,461	199	56,715,000	1.55
4	日本	株式信用売	ビジョン	その他製品	15,400	3,105	47,816,499	3,570	54,978,000	1.50
5	日本	株式信用売	ゼリア新薬工業	医薬品	38,000	1,432	54,415,429	1,421	53,998,000	1.48
6	日本	株式信用売	千代田化工建設	建設業	44,000	961	42,283,551	1,214	53,416,000	1.46
7	日本	株式信用売	ミスミグループ本社	卸売業	26,300	1,848	48,601,890	1,934	50,864,200	1.39
8	日本	株式信用売	日本ペイント	化学	72,000	601	43,271,547	657	47,304,000	1.29
9	日本	株式信用売	アリアケジャパン	食料品	25,800	1,566	40,402,376	1,751	45,175,800	1.24
10	日本	株式信用売	松竹	情報・通信業	58,000	741	42,992,835	777	45,066,000	1.23
11	日本	株式信用売	L I X I Lグループ	金属製品	24,200	1,558	37,703,205	1,862	45,060,400	1.23
12	日本	株式信用売	スタートトゥデイ	小売業	40,000	1,196	47,843,019	1,120	44,800,000	1.23
13	日本	株式信用売	コロワイド	小売業	66,500	582	38,702,590	669	44,488,500	1.22

14	日本	株式信用売	カゴメ	食料品	24,500	1,570	38,464,597	1,791	43,879,500	1.20
15	日本	株式信用売	任天堂	その他製品	4,400	12,028	52,925,320	9,890	43,516,000	1.19
16	日本	株式信用売	カカクコム	サービス業	14,400	2,343	33,732,292	2,937	42,292,800	1.16
17	日本	株式信用売	小田急電鉄	陸運業	51,000	746	38,045,601	821	41,871,000	1.15
18	日本	株式信用売	ファーストリテイリング	小売業	2,300	17,420	40,065,580	18,150	41,745,000	1.14
19	日本	株式信用売	江崎グリコ	食料品	43,000	951	40,892,572	966	41,538,000	1.14
20	日本	株式信用売	エムスリー	サービス業	267	107,670	28,747,831	148,300	39,596,100	1.08
21	日本	株式信用売	日本ケミファ	医薬品	82,000	435	35,669,611	475	38,950,000	1.07
22	日本	株式信用売	シスメックス	電気機器	10,200	3,036	30,963,986	3,755	38,301,000	1.05
23	日本	株式信用売	京浜急行電鉄	陸運業	52,000	684	35,567,628	736	38,272,000	1.05
24	日本	株式信用売	ポイント	小売業	13,340	2,815	37,550,117	2,815	37,552,100	1.03
25	日本	株式信用売	近畿日本鉄道	陸運業	122,000	297	36,233,620	306	37,332,000	1.02
26	日本	株式信用売	メイテック	サービス業	20,300	1,622	32,926,255	1,778	36,093,400	0.99
27	日本	株式信用売	パソナグループ	サービス業	705	69,199	48,785,489	51,000	35,955,000	0.98
28	日本	株式信用売	東宝	情報・通信業	24,800	1,322	32,790,302	1,435	35,588,000	0.97
29	日本	株式信用売	テルモ	精密機器	10,500	3,366	35,345,932	3,360	35,280,000	0.97
30	日本	株式信用売	エービーシー・マート	小売業	10,200	2,902	29,600,090	3,450	35,190,000	0.96
投資比率：合計										36.17

(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24年9月28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 分配落：506,893,661	分配付：1.1421 分配落：1.1421
第5期	(平成19年 2月20日)	分配付：226,529,845 分配落：224,557,773	分配付：1.1487 分配落：1.1387
第6期	(平成20年 2月20日)	分配付：153,699,757 分配落：153,699,757	分配付：1.1147 分配落：1.1147
第7期	(平成21年 2月20日)	分配付：106,967,021 分配落：106,967,021	分配付：1.0095 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
第10期	(平成24年 2月20日)	分配付：55,226,479 分配落：55,226,479	分配付：0.9417 分配落：0.9417
平成23年 9月末日		55,288,766	0.9275
10月末日		54,831,212	0.9198
11月末日		54,653,015	0.9168
12月末日		55,761,762	0.9354
平成24年 1月末日		56,147,534	0.9419
2月末日		54,886,118	0.9359
3月末日		50,446,010	0.9322
4月末日		49,716,095	0.9187
5月末日		47,416,196	0.9253
6月末日		46,408,162	0.9057
7月末日		44,783,446	0.9065
8月末日		43,200,614	0.8744
9月末日		42,072,509	0.8693

【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
第10期	(平成24年 2月20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%
第10期	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	3.0%
	自平成24年 2月21日 至平成24年 9月28日	7.7%

(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
第10期	自平成23年 2月22日 至平成24年 2月20日	0	20,520,569	58,647,910
	自平成24年 2月21日 至平成24年 9月28日	0	10,250,665	48,397,245

（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2【管理及び運営】

2【換金（解約）手続等】（下記の内容に更新されます。）

<更新後>

- 1) 受益者（販売会社を含みます。以下同じ。）は、毎月5日および20日（いずれも当日が休業日の場合には翌営業日とします。）を解約請求受付日として、解約請求受付日の5営業日以前において、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます（信託約款第43条第1項）。なお、一部解約の請求の受け付けは、営業日の午後3時までとし、この受付時間を過ぎた場合は翌営業日の取扱いとさせていただきます。
- 2) 受益者が、上記1)の一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、受益権をもって行うものとします（信託約款第43条第2項）。
- 3) 委託会社は、一部解約の申込を受け付けた場合には、信託契約の一部を解約します。なお、上記1)の一部解約の実行の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます（信託約款第43条第3項）。一部解約金は、受益者の解約請求受付日から起算して、原則として5営業日目に当該受益者に支払います（信託約款第41条第4項）。
- 4) 委託会社は、取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるとき（非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更、クーデター等政変、戦争、天災地変等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）は、委託会社の判断により、上記1)による一部解約の実行の請求の受付を中止及び既に受け付けた上記1)による一部解約の実行の請求の受付を取り消すことができます。（信託約款第43条第4項）。
- 5) 上記4)の規定により一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該一部解約の実行の中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして下記6)の規定に準じて計算された価額とします。
- 6) 一部解約の価額は、解約請求受付日の基準価額から当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします（信託約款第43条第3項）。
- 7) 解約価額は、販売会社又は委託会社においてご確認いただけます。ご照会方法の詳細については、下記3（1）3）をご参照ください。

第3【ファンドの経理状況】（下記の内容が追加されます。）

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間計算期間(平成24年2月21日から平成24年8月20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)

		当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3
親投資信託受益証券		44,547,930
流動資産合計		44,547,933
資産合計		44,547,933
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		25,518
未払委託者報酬		433,792
その他未払費用		15,249
流動負債合計		474,559
負債合計		474,559
純資産の部		
元本等		
元本	1	49,405,149
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3	5,331,775
(分配準備積立金)		2,148,089
元本等合計		44,073,374
純資産合計		44,073,374
負債純資産合計		44,547,933

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自平成24年2月21日 至平成24年8月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	2,166,996
営業収益合計	2,166,996
営業費用	
受託者報酬	25,518
委託者報酬	433,792
その他費用	15,249
営業費用合計	474,559
営業損失()	2,641,555
経常損失()	2,641,555
中間純損失()	2,641,555
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	176,590
期首剰余金又は期首欠損金()	3,421,431
剰余金増加額又は欠損金減少額	554,621
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	554,621
中間剰余金又は中間欠損金()	5,331,775

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
-------------------	--

(追加情報)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	58,647,910円 円 9,242,761円
2 受益権の総数	49,405,149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5,331,775円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当する事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	中間貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載しております。

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

（有価証券関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

該当する事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	当中間計算期間末 (平成24年 8月20日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8921円 (8,921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、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24年 8月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
金銭信託		402,259
コール・ローン		153,784,893
株式	3	3,506,135,162
未収入金		114,925,927
信用取引預け金		3,598,361,063
未収配当金		4,647,700
未収利息		294
流動資産合計		7,378,257,298
資産合計		7,378,257,298
負債の部		
流動負債		
信用売証券		3,524,936,550
未払金		81,722,647
その他未払費用		6,911,769
流動負債合計		3,613,570,966
負債合計		3,613,570,966
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,857,013,868
剰余金		
剰余金又は欠損金()		907,672,464
元本等合計		3,764,686,332
純資産合計		3,764,686,332
負債純資産合計		7,378,257,298

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 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。
-------------------	---

2 収益及び費用の計上基準	<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>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>
---------------	---

（追加情報）

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成24年 8月20日現在）
1 期首元本額	3,011,493,187円
期中追加設定元本額	円
期中一部解約元本額	154,479,319円
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	33,807,339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	2,823,206,529円
計	2,857,013,868円
2 受益権の総数	2,857,013,868口

3 差入保証金代用有価証券	<p>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。</p> <p style="text-align: center;">株式</p> <p style="text-align: right;">1,499,050,800円</p> <p>なお、上記の金額には、約定未受渡株式を含んでおります。</p>
---------------	--

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成24年 8月20日現在）
1 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表計上額は時価を計上しているため、その差額はありません。
2 金融商品の時価の算定方法	<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、信用売証券 「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 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	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）

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）

	（平成24年 8月20日現在）
1口当たり純資産額	1.3177円
（1万口当たり純資産額）	（13,177円）

2【ファンドの現況】（下記の内容に更新されます。）

【純資産額計算書】

（平成24年9月28日現在）

資産総額	42,161,645円
負債総額	89,136円
純資産総額（ - ）	42,072,509円
発行済口数	48,397,245口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8693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24年9月28日現在）

資産総額	7,080,190,422円
負債総額	3,426,920,569円
純資産総額（ - ）	3,653,269,853円
発行済口数	2,839,056,188口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2868円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】（下記の内容に更新されます。）

(1) 資本金の額

資本金の額

委託会社の資本金の額は金3億1千万円です(平成24年9月28日現在)。

発行する株式の総数

委託会社の発行する株式の総数は6,200株です(平成24年9月28日現在)。

発行済株式の総数

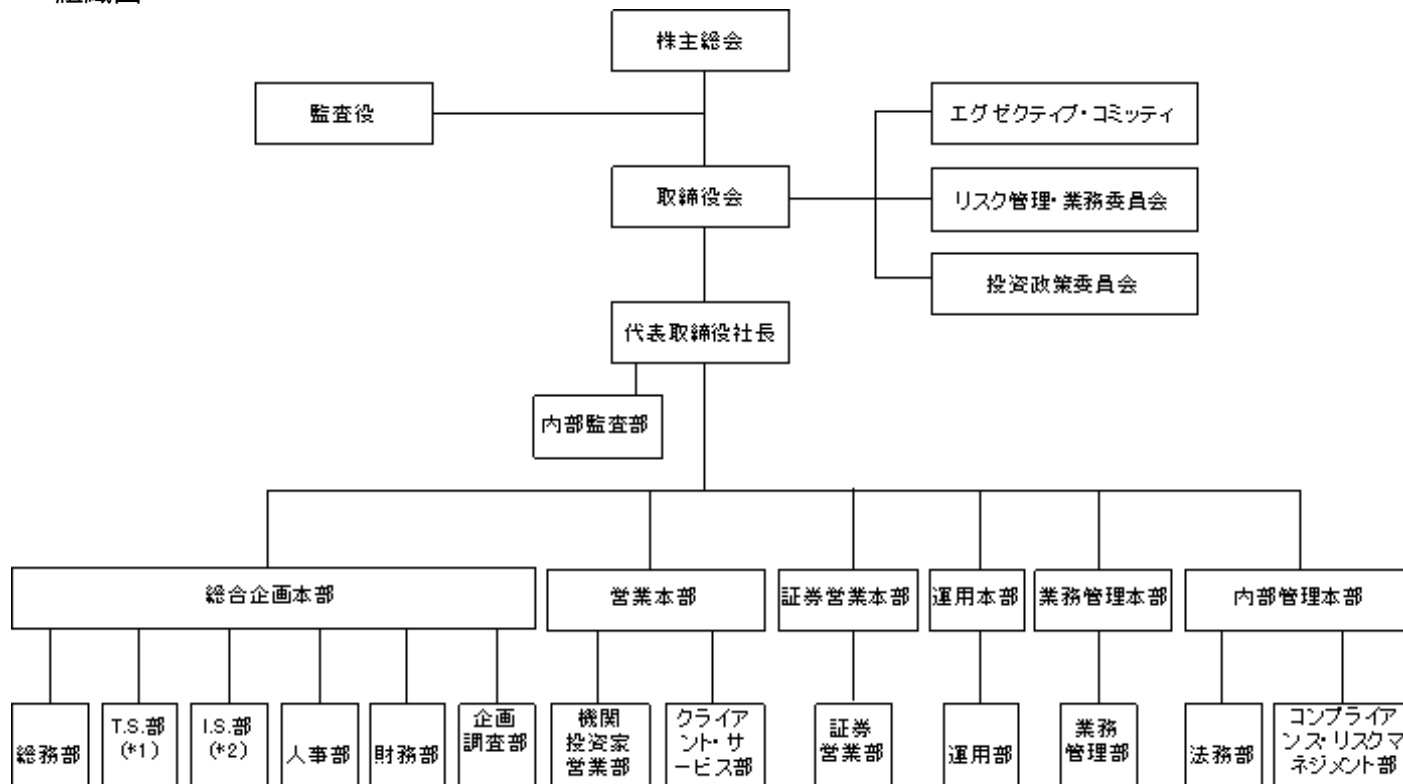
委託会社の発行済株式総数は6,200株です(平成24年9月28日現在)。

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。

(2) 委託会社の機構

組織図



内部管理本部の代表者は内部管理統括責任者の職を担う。

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

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

各部の業務分掌体制は以下の通りとなっています。

部署名	業務内容
-----	------

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

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

業を行っています。

平成24年9月28日現在、委託会社の運用する証券投資信託は、合計119本であり、その純資産総額は906,695百万円です(親投資信託を除く、公募投資信託および私募投資信託の合計値です。)

3【委託会社等の経理状況】（下記の内容に更新されます。）

1. 委託会社であるステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社（以下「委託会社」といいます）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」といいます）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

1. 財務諸表

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

退職給付引当金		84,094			69,969	
長期リース債務		-			6,448	
固定負債計		84,094	1.1		76,417	0.9
負債合計		720,050	9.0		642,146	7.9
(純資産の部)			%			%
株主資本		7,257,874	91.0		7,446,321	92.1
資本金	310,000			310,000		
利益剰余金						
利益準備金	77,500			77,500		
その他利益剰余金						
別途積立金	31,620			31,620		
繰越利益剰余金	6,838,754			7,027,201		
純資産合計		7,257,874	91.0		7,446,321	92.1
負債・純資産合計		7,977,925	100.0		8,088,468	100.0

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

期 別	前事業年度		当事業年度	
	自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日		自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日	
科 目	金 額	構 成 比	金 額	構 成 比
営業収益		%		%
委託者報酬	3,343,307		1,938,693	
投資顧問収入	1,785,199		1,324,526	
その他営業収益	18,337		248,693	
営業収益計	5,146,844	100.0	3,511,914	100.0
営業費用				
支払手数料	1,355,270		491,137	
広告宣伝費	17,530		14,465	
公告費	2,400		1,755	
調査費	493,033		379,325	
調査費	248,560		206,637	
委託調査費	242,832		171,141	
図書費	1,640		1,546	
委託計算費	171,824		155,279	
営業雑経費	40,718		37,603	
通信費	7,033		6,683	
印刷費	8,341		10,572	
協会費	13,797		11,049	
諸会費	2,901		3,633	
その他	8,644		5,663	
営業費用計	2,080,777	40.4	1,079,565	30.7
一般管理費				
給料	1,254,505		1,338,902	
役員報酬	305,535		413,892	
給料・手当	761,648		766,394	
賞与	132,528		116,894	
賞与引当金繰入額	54,792		41,721	
退職金	2,846		-	
交際費	2,992		5,974	
旅費交通費	26,905		30,537	
租税公課	14,439		16,034	
不動産賃借料	135,683		125,330	
役員退職慰労引当金繰入額	9,188		-	
退職給付費用	60,658		62,909	
固定資産減価償却費	31,299		22,921	
福利厚生費	87,865		101,047	
事務手数料	749,844		55,825	
諸経費	118,910		117,938	

一般管理費計		2,495,141	48.5		1,877,421	53.5
営業利益		570,925	11.1		554,927	15.8
営業外収益						
受取利息		-			-	
有価証券売却益		-			-	
雑収入		572			7,304	
営業外収益計		572	0.0		7,304	0.2
営業外費用						
支払利息		-			70	
為替差損		1,144			1,769	
有価証券売却損		1,620			942	
雑損失		425			932	
営業外費用計		3,190	0.0		3,715	0.1
経常利益		568,306	16.2		558,516	15.9
特別損失						
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		20,630			-	
役員退職慰労金制度終了損		6,662			-	
事業再構築費用		-			36,057	
事務処理損失		7,866			3,089	
特別損失計		35,159	0.7		39,147	1.1
税引前当期純利益		533,147	10.4		519,369	14.8
法人税、住民税及び事業税		275,975	5.4		338,282	9.6
法人税等調整額		25,770	0.5		7,359	0.2
当期純利益		231,401	4.5		188,446	5.4

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	310,000	310,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	310,000	310,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	77,500	77,500
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	77,500	77,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	31,620	31,620
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	31,620	31,620
繰越利益剰余金		
当期首残高	6,607,353	6,838,754
当期変動額		
当期純利益	231,401	188,446
当期変動額合計	231,401	188,446
当期末残高	6,838,754	7,027,201
利益剰余金合計		
当期首残高	6,716,473	6,947,874
当期変動額		

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

[重要な会計方針]

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

4.引当金の計上基準	<p>(1)賞与引当金 従業員等に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額のうち当期に負担すべき金額を計上しております。</p> <p>(2)退職給付引当金 退職給付引当金は、従業員等の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、必要額を計上しております。また、過去勤務債務及び数理計算上の差異の費用処理方法は以下のとおりであります。</p> <p>過去勤務債務 その発生年度の従業員等の平均残存勤務期間内の一定の年数（11年）による定額法により費用処理</p> <p>数理計算上の差異 発生翌事業年度に一括費用処理</p>
5.その他 財務諸表作成のための重要な事項	(1)消費税等の処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

[追加情報]

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

注 記 事 項

（貸借対照表関係）

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

（損益計算書関係）

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

<p>1. 移転価格の取扱いに係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>1. 移転価格の取扱いに係る注記 当社とステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーはグループ間移転価格調整の方針に従って調整額を精算することに致しました。当会計期間には、ステート・ストリート・バンク アンド トラスト カンパニーから当社に支払われた調整額228,767千円が、損益計算書のその他営業収益に含まれております。</p>
<p>関係会社に係る注記 該当事項はありません。</p>	<p>関係会社に係る注記 同左</p>

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月 31日）

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

当事業年度（自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日）

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

(リース取引関係)

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

<p>リース物件の所有権が借主に移転すると認められるものの以外のファイナンス・リース取引 (リース取引開始日が平成20年3月31日以前のもの)</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>未経過リース料期末残高相当額</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額</p> <table border="0"> <tr> <td>支払リース料</td> <td>2,473千円</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td>2,250千円</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td>60千円</td> </tr> </table> <p>減価償却費相当額の算定方法 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</p> <p>利息相当額の算定方法 リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</p>	支払リース料	2,473千円	減価償却費相当額	2,250千円	支払利息相当額	60千円	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引</p> <p>リース資産の内容 社用車両であります。</p> <p>リース資産の減価償却の方法 重要な会計方針「2.固定資産の減価償却方法」に記載の通りであります。</p>
支払リース料	2,473千円						
減価償却費相当額	2,250千円						
支払利息相当額	60千円						

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りであります。

平成23年3月31日 現在

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	6,661,535	6,661,535	
(2)未収委託者報酬	349,939	349,939	
(3)未収入金	361,818	361,818	
(4)その他未払金	314,580	314,580	

平成24年3月31日 現在

(単位：千円)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法に関する事項

(1) 現金及び預金

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

(2) 未収委託者報酬、(3)未収入金及び(4)その他未払金

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

(注2) 金銭債権の決算日後の償還予定額

償還予定までの期間が1年を超えるものはありません。

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

記載すべき事項はありません。

(有価証券関係)

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

(デリバティブ取引関係)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当社は、設立時より適格退職年金制度を設けておりましたが、退職給付制度の改定を実施し、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当社は、平成23年3月31日に適格退職年金制度を廃止し、平成23年4月1日より確定給付企業年金制度（キャッシュ・バランス・プラン）へ移行するとともに、確定拠出年金制度を導入いたしました。また、平成12年9月29日より退職給付信託を設定しております。

2．退職給付債務及びその内訳

(単位：千円)

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

3．退職給付費用の内訳

(単位：千円)

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

4．退職給付債務等の計算基礎に関する事項

	前事業年度 (平成23年3月 31日現在)	当事業年度 (平成24年3月 31日現在)
(1)割引率	1.0%	1.0%
(2)期待運用収益率	0.75%	0.75%
(3)退職給付見込額の期間配分方法	期間定額基準	期間定額基準
(4)過去勤務債務の処理年数	発生時より 11年	発生時より 11年
(5)数理計算上の差異の処理年数	1年	1年

(税効果会計関係)

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異の原因となった主要な項目別内訳
法定実効税率 40.7% 交際費等永久に損金に 算入されない項目 15.8% その他 0.0% 税効果会計適用後の 法人税等の負担率 56.5% =====	法定実効税率 40.7% 交際費等永久に損金に 算入されない項目 21.4% 税率変更による 期末繰延税金資産の減額修正 1.6% その他 0.0% 税効果会計適用後の 法人税等の負担率 63.7% =====

(企業結合関係等)

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

(資産除去債務関係)

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は59,837千円であります。また資産除去債務の総額は、データセンターの賃貸借契約期間満了が近づいたことに伴う見積りの見直しの実施等を主な理由とし、当期中において12,509千円減少しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

(1) 資産除去債務の概要

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

(2) 資産除去債務の金額の算定方法

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

(3) 当事業年度における資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、長期差入保証金の回収が最終的に見込めないと認められる金額として算定した金額は63,661千円であります。資産除去債務の総額は当事業年度において、データセンターの賃貸借契約期間が満了したこと、また、資産除却費用の見積額を更新したことから、3,824千円増加しております。

(セグメント情報)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業の単一セグメントのため、記載を省略しております。

2. セグメント関連情報

1. 商品及びサービスに関する情報

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

2. 地域に関する情報

営業収益

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

有形固定資産

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

3. 主要な顧客に関する情報

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

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

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報)

該当事項はありません。

(報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報)

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

該当事項はありません。

(2) 同一の親会社を持つ会社

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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

ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ 兼職社員の人件費支払等	投資信託計理業務委託 事務所賃借料の支払 人件費等の支払	37,966 8,694 103,543	前払金 未払金	4,358 3,658
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国ロンドン	62百万ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	20,022 11,711	未収入金	477
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国ルクセンブルク市	12.5万ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役役に就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	44,053		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポールシンガポール市	136万シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	121	未収収益	63
タッカーマン・グループ	米国ニューヨーク州ニューヨーク市	1百万ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	5,934	未払金	3,121
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ, LLC	米国マサチューセッツ州ボストン市	237百万米ドル	証券業	なし	なし	ETF商品の紹介	紹介料の受取	13,973	未収収益	6,701
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・オーストラリア	オーストラリアシドニー	8百万オーストラリアドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の受取	3,018		

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

当事業年度 自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月 31日											
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有(被所有)割合	関連当事者との関係		取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
同一の親会社を持つ会社	ステート・ストリート・バンク・アント・トラストカンパニー	米国マサチューセッツ州ボストン市	29百万米ドル	銀行、投資顧問、投資信託委託業務、及びそれらの関連業務	なし	なし	なし	助言などの投資顧問サービスの提供並びに受入れ	173,013	未収入金	59,214
								ソフトウェア使用料の支払	135,004	未払費用	14,977
								ソフトウェアの使用契約	147,278	未収収益	9,050
								投資顧問料の支払	252,817		
								人件費等及び事務手数料の支払	228,767		
ステート・ストリート信託銀行株式会社	東京都港区	25億円	銀行業	なし	なし	なし	投資信託計理の事務サービスの受入れ	36,711	前払金	24,411	
							兼職社員の人件費支払等	4,890	未払金	12,010	
							事務所賃借料の支払	111,504			

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・ユナイテッド・キングダム	英国 ロンドン	62百万 ポンド	投資顧問、投資信託委託業務	なし	なし	投資顧問サービスの提供並びに受入れ	投資顧問料の受取 投資顧問料の支払	770 6,849	未収入金	63
ステート・ストリート・マネジメント・S.A	ルクセンブルク大公国 ルクセンブルク市	12.5万 ユーロ	サービス業	なし	あり 当社代表取締役が非常勤取締役役に就任	投資顧問サービスの提供	投資顧問料の受取	39,445		
ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・シンガポール	シンガポール シンガポール市	136万 シンガポールドル	投資顧問業	なし	なし	投資顧問サービスの提供及びETF商品の紹介	紹介料の受取	183	未収収益	94
タッカーマン・グループ	米国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	1百万 ドル	不動産投資顧問業務	なし	なし	投資顧問サービスの受入	投資顧問料の支払	1		
ステート・ストリート・グローバル・マーケットツ,LLC	米国 マサチューセッツ州 ボストン市	237百万 米ドル	証券業	なし	なし	ETF商品の紹介	紹介料の受取	15,885	未収収益	8,956

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ステート・ストリート・コーポレーション
(ニューヨーク証券取引所に上場)

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ・インク
（非上場）

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

（２）重要な関連会社の要約財務情報

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

前事業年度		当事業年度	
自	平成22年4月 1日	自	平成23年4月 1日
至	平成23年3月 31日	至	平成24年3月 31日
1株当たり純資産	1,170,624円94銭	1株当たり純資産	1,201,019円51銭
1株当たり当期純利益	37,322円82銭	1株当たり当期純利益	30,394円51銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。	

注） 1株当たり当期純利益の算定基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度	当事業年度
	自 平成22年4月 1日	自 平成23年4月 1日
	至 平成23年3月 31日	至 平成24年3月 31日
当期純利益（千円）	231,401	188,446
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式にかかる当期純利益（千円）	231,401	188,446
期中平均株式数（株）	6,200	6,200

（重要な後発事象）

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

第2【その他の関係法人の概況】(以下の内容に更新されます。)

1. 受託会社

名 称

三井住友信託銀行株式会社

(再信託受託銀行:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

資本金の額(平成24年4月1日現在)

342,037百万円

(51,000百万円)

事業の内容

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

2. 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
三井住友信託銀行株式会社	342,037百万円 (平成24年4月1日現在)	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。

(略)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年10月3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24年2月21日から平成24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・ストリート日本株マーケット・ニュートラル・オープンの平成24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24年2月21日から平成24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。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月28日

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 丘本 正彦 印

業務執行社員

指定有限責任社員

公認会計士 湯原 尚 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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