

【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12月14日

【発行者名】 ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 山本 幸次

【本店の所在の場所】 東京都港区赤坂九丁目7番1号

【事務連絡者氏名】 太田 裕之

【電話番号】 03 - 4530 - 7093

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン

【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 当初自己設定（平成23年3月15日）
100万円とします。
継続募集額
1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

【有価証券届出書の訂正理由】

平成23年2月25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】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示します。

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】

<訂正前>

当ファンドは、確定拠出年金法に基づいて加入者が拠出した資金を運用するためのファンドであり、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）に投資することにより、中長期的にシティグループ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果の獲得をめざして運用を行います。

シティグループ世界国債指数（除く日本、円ベース）とは、世界主要先進国の日本を除く22ヶ国（2011年1月末現在）を投資対象国として、シティグループ社が開発した世界国債指数です。なお、この投資対象国に関しては定期的な見直しにより変更されることがあります。

（略）

<訂正後>

当ファンドは、確定拠出年金法に基づいて加入者が拠出した資金を運用するためのファンドであり、日本を除く世界主要国の国債、政府機関債等を主要投資対象とした「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）に投資することにより、中長期的にシティグループ世界国債指数（除く日本、円ベース）に連動した投資成果の獲得をめざして運用を行います。

シティグループ世界国債指数（除く日本、円ベース）とは、世界主要先進国の日本を除く22ヶ国（平成23年9月末現在）を投資対象国として、シティグループ社が開発した世界国債指数です。なお、この投資対象国に関しては定期的な見直しにより変更されることがあります。

（略）

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成23年3月15日 投資信託契約締結、設定、運用開始（予定）

<訂正後>

平成23年3月15日 投資信託契約締結、設定、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行い、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等に投資します。「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの収益はすべてベビーファンドに還元されます。

（略）

ファンドの関係法人

（略）

2) 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1月31日現在）

(略)

3) 大株主の状況

(平成22年1月31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・リンク	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>

当ファンドは、「ファミリーファンド方式」により運用を行い、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除く世界主要先進国の国債、政府機関債等に投資します。「ファミリーファンド方式」とは、投資家からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金をマザーファンドの受益証券に投資して、その実質的な運用を行う仕組みです。また、マザーファンドの損益はすべてベビーファンドに還元されます。

(略)

ファンドの関係法人

(略)

2) 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

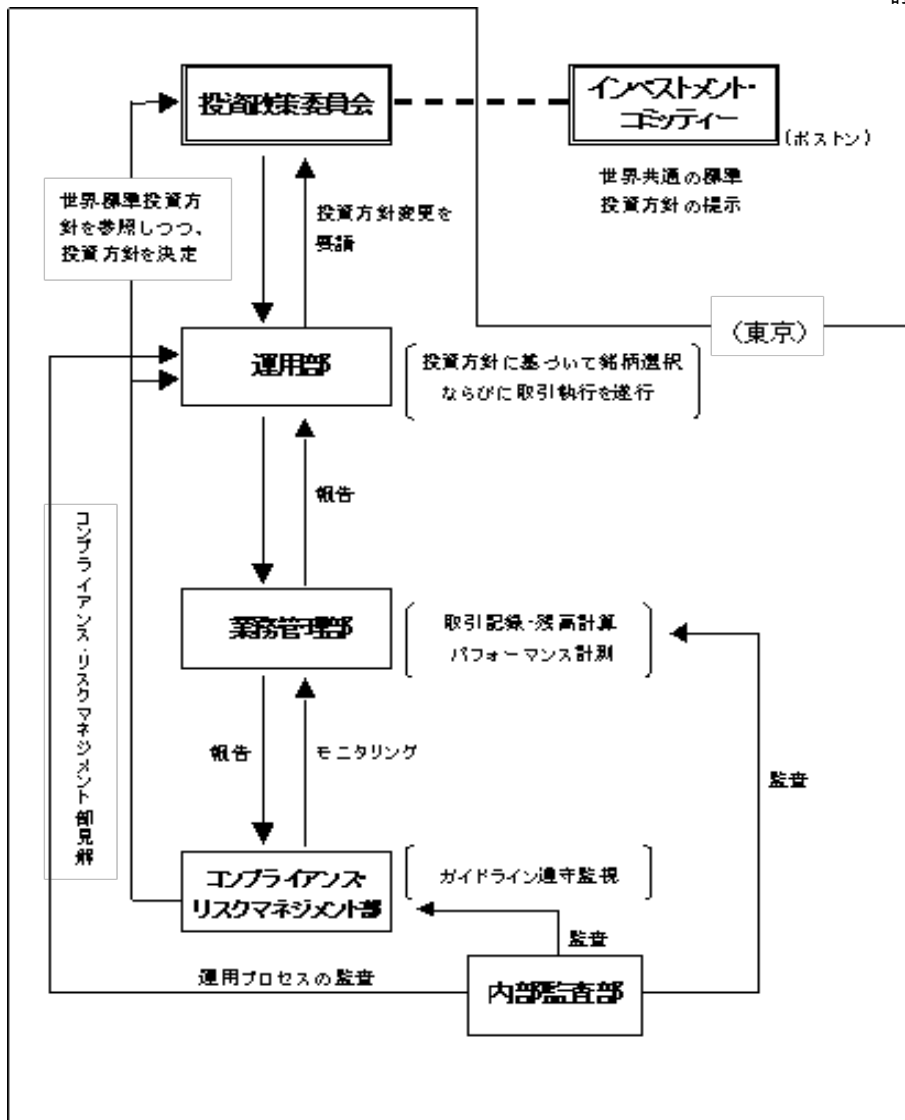
(平成23年9月30日現在)

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・リンク	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】

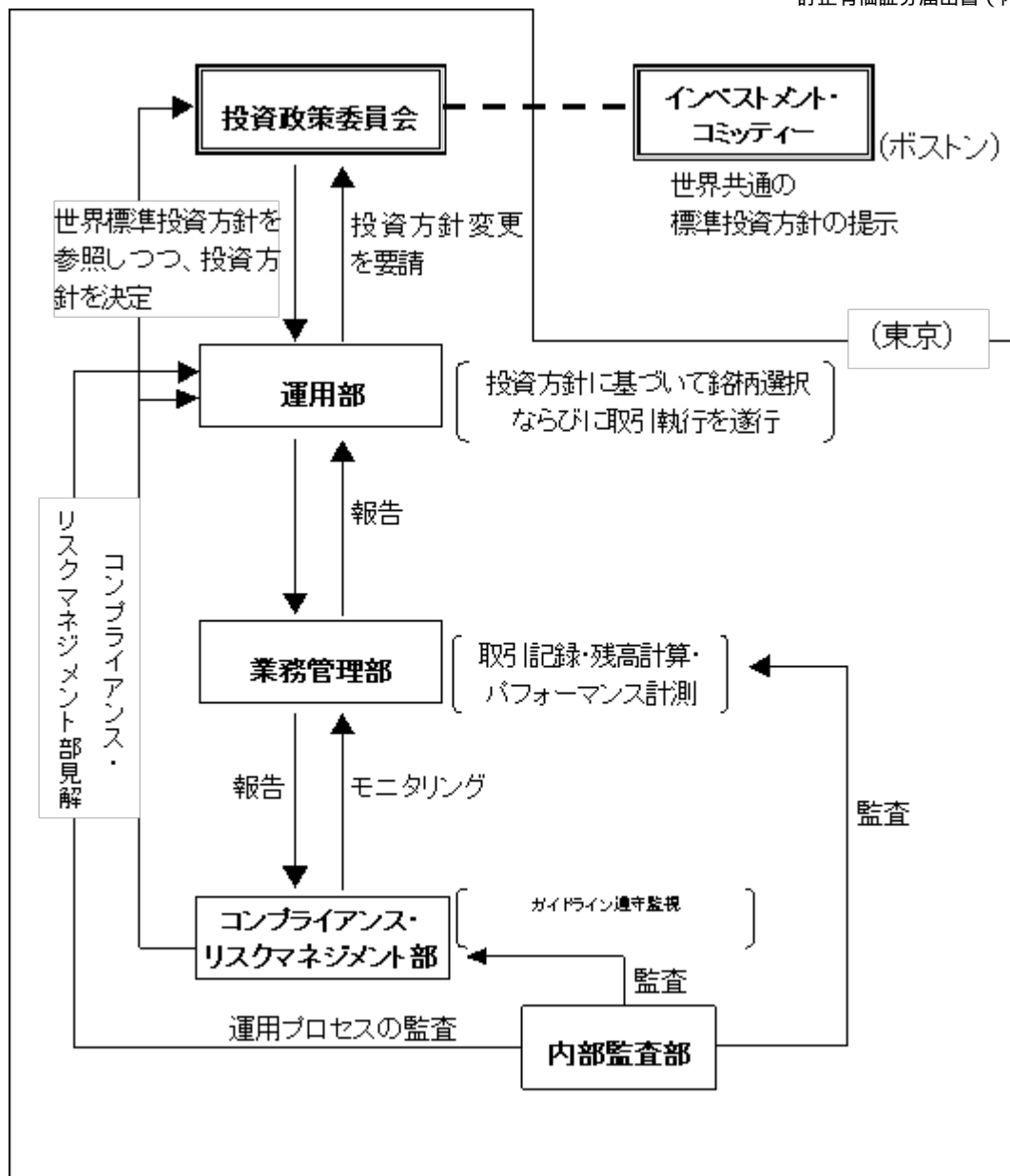
<訂正前>



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル/プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該戦略に関わる運用担当者と意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、委託会社の投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、運用部長、各運用戦略責任者、業務管理部の運用評価グループ責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、全ファンドの毎月末のポートフォリオ構成、パフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略の受託資産間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。運用担当者は、投資戦略別に毎月の投資行動を報告した上で、ガイドラインからの乖離やパフォーマンスの格差、発注取引先の集中等が生じている場合には、その理由及び顧客への説明状況について報告します。

< 訂正後 >



委託会社において、運用部の各ファンド担当者がそのポートフォリオ管理、運用モデル/プロセスの改善の任に就いていますが、常にボストン本社を中心とした海外拠点の当該ストラテジーに関わる運用担当者との意見・情報交換を行いながら、モデルの問題点・改善点、パフォーマンス、市場・運用情報などにつきコミュニケーションを保っています。

運用の報告は、委託会社の投資政策委員会に対してなされます。投資政策委員会は、チーフ・インベストメント・オフィサー、各運用戦略責任者、業務管理部責任者、コンプライアンス責任者等により構成されています。なお、投資政策委員会においては、各ファンドのパフォーマンス、取引先別の売買高、売買手数料などを確認し、ガイドラインからの乖離や、同一戦略のファンド間でのパフォーマンスの乖離状況等の報告を受けます。

(4) 【配分方針】

< 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。
- ・投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部又は全部が、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が、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が、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)

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	4,911,276	100.00
コール・ローン、その他資産(負債控除後)		48	0.00
純資産総額		4,911,228	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（ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド）

（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（%）
国債証券	アメリカ	92,170,549,561	39.79
	フランス	22,931,621,586	9.90
	ドイツ	22,135,762,373	9.56
	イタリア	20,804,290,558	8.98
	イギリス	18,660,115,424	8.06
	スペイン	9,645,929,330	4.16
	カナダ	6,621,019,110	2.86
	ベルギー	6,252,366,280	2.70
	オランダ	5,947,757,307	2.57
	オーストリア	4,069,285,662	1.76
	オーストラリア	2,879,248,757	1.24
	デンマーク	2,054,438,473	0.89
	メキシコ	1,895,861,984	0.82
	ポーランド	1,698,701,534	0.73
	アイルランド	1,673,435,819	0.72
	スウェーデン	1,550,885,990	0.67
	フィンランド	1,537,884,289	0.66
	ポルトガル	1,485,324,874	0.64
	マレーシア	1,126,282,292	0.49
	スイス	1,061,041,358	0.46
シンガポール	895,215,782	0.39	
ノルウェー	677,837,562	0.29	
	小計	227,774,855,905	98.34
コール・ローン、その他資産（負債控除後）		3,854,372,460	1.66
純資産総額		231,629,228,365	100.00

（注）投資比率は、純資産総額に対する当該資産の時価合計の比率です。

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

（平成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	ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド		3,470,376	1.4482	5,025,842	1.4152	4,911,276	100.00
									投資比率：合計	100.00

（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		100.00
合計		100.00

（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（ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド）

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	利率 (%)	償還日	数量 (額面)	簿価 単価 (円)	簿価金額 (円)	評価 単価 (円)	評価金額 (円)	投資比 率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	30,000,000	8,314	2,494,058,395	8,305	2,491,365,681	1.08
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2013/06/30	26,800,000	7,660	2,052,936,112	7,681	2,058,554,404	0.89
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2012/12/15	25,500,000	7,721	1,968,776,941	7,750	1,976,182,826	0.85
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	24,500,000	7,722	1,892,009,437	7,868	1,927,659,965	0.83
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	21,800,000	8,479	1,848,510,562	8,840	1,927,228,288	0.83
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	21,000,000	8,398	1,763,572,781	8,713	1,829,719,738	0.79
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2012/11/15	22,000,000	8,105	1,782,999,187	7,992	1,758,165,047	0.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	19,750,000	8,508	1,680,391,811	8,884	1,754,513,441	0.76
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	21,000,000	8,272	1,737,134,280	8,233	1,728,863,898	0.75
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	21,200,000	7,627	1,616,855,100	8,019	1,700,008,371	0.73
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/08/15	20,000,000	7,107	1,421,306,923	8,190	1,637,915,454	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.625	2014/07/15	20,700,000	7,736	1,601,281,976	7,712	1,596,444,661	0.69
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2012/08/31	20,000,000	8,080	1,615,938,366	7,943	1,588,571,250	0.69
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11.250	2015/02/15	15,095,000	10,464	1,579,579,745	10,418	1,572,569,287	0.68
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	2039/11/15	15,000,000	7,270	1,090,430,181	9,714	1,457,128,764	0.63
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2039/05/15	15,200,000	7,127	1,083,342,647	9,512	1,445,792,045	0.62
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.125	2015/05/15	16,500,000	8,359	1,379,182,612	8,635	1,424,791,125	0.62
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2020/11/15	17,000,000	7,256	1,233,602,236	8,175	1,389,783,614	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	2013/05/15	17,000,000	8,132	1,382,455,260	8,079	1,373,495,489	0.59
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2020/05/15	15,500,000	7,682	1,190,688,765	8,758	1,357,470,733	0.59
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2017/11/15	15,000,000	8,325	1,248,772,448	9,035	1,355,267,812	0.59
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.500	2018/02/15	15,500,000	8,004	1,240,685,043	8,701	1,348,650,464	0.58
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2038/05/15	13,300,000	7,461	992,366,501	9,851	1,310,145,858	0.57
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8.750	2017/05/15	12,000,000	10,339	1,240,651,994	10,874	1,304,822,759	0.56
25	イギリス	国債証券	UK GILT BOND	4.750	2038/12/07	9,000,000	12,497	1,124,712,162	14,442	1,299,750,747	0.56
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.750	2017/08/15	14,000,000	8,553	1,197,472,290	9,224	1,291,409,317	0.56
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2014/04/30	16,000,000	7,779	1,244,700,185	7,957	1,273,156,500	0.55
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.625	2018/04/30	15,300,000	7,771	1,188,979,230	8,283	1,267,297,565	0.55
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/10/31	15,000,000	7,859	1,178,852,472	8,115	1,217,297,812	0.53
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.375	2014/08/31	15,000,000	7,888	1,183,170,598	8,096	1,214,423,437	0.52

(注1) 評価金額の上位30銘柄について記載しています。

(注2) 投資比率は、純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

(注3) 平成23年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

種類別及び業種別投資比率

種類	業種	投資比率(%)
国債証券		98.34
合計		98.34

(注1) 投資比率は、純資産総額に対する当該種類の評価金額の比率です。

(注2) 平成23年9月30日のわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

投資不動産物件

該当する事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当する事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

平成23年9月30日及び設定来における各月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)
平成23年 3月末日	1,017,576	1.0176
4月末日	1,036,042	1.0360
5月末日	1,669,621	1.0212
6月末日	2,362,106	1.0172
7月末日	3,592,375	0.9843
8月末日	4,368,302	1.0059
9月末日	4,911,228	0.9752

【分配の推移】

該当する事項はありません。

【収益率の推移】

計算期間	収益率
自平成23年 3月15日 至平成23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。

(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)
自平成23年 3月15日 至平成23年 9月30日	5,036,032	0	5,036,032

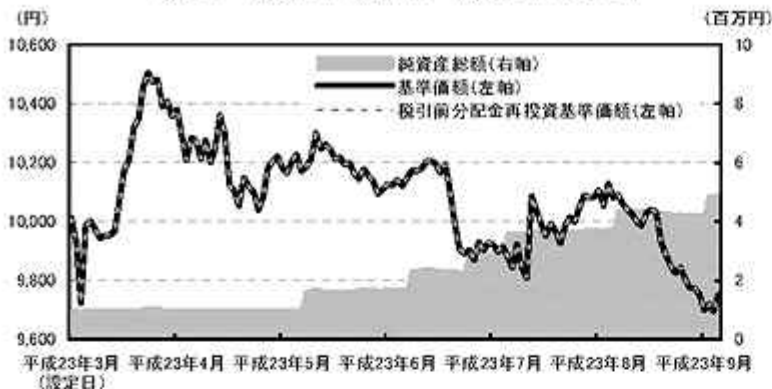
(注1) 日本国外における設定、解約はありません。

(注2) 設定口数は、当初募集期間の設定口数を含みます。

<参考情報> 運用実績

基準価額・純資産の推移

設定日 平成23年3月15日～平成23年9月30日



※基準価額の計算において信託報酬は控除しています。

(平成23年9月30日現在)

分配の推移

該当する事項はありません。

主要な資産の状況

<銘柄別投資比率>

国/地域名	種類	銘柄名	利率 (%)	償還日	投資比率 (%)	
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/11/15	1.06
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	0.375	2013/06/30	0.89
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.125	2012/12/15	0.85
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.500	2013/12/31	0.83
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2015/11/15	0.83
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2015/08/15	0.79
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.000	2012/11/15	0.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.500	2016/02/15	0.76
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.250	2013/08/15	0.75
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	2015/06/30	0.73

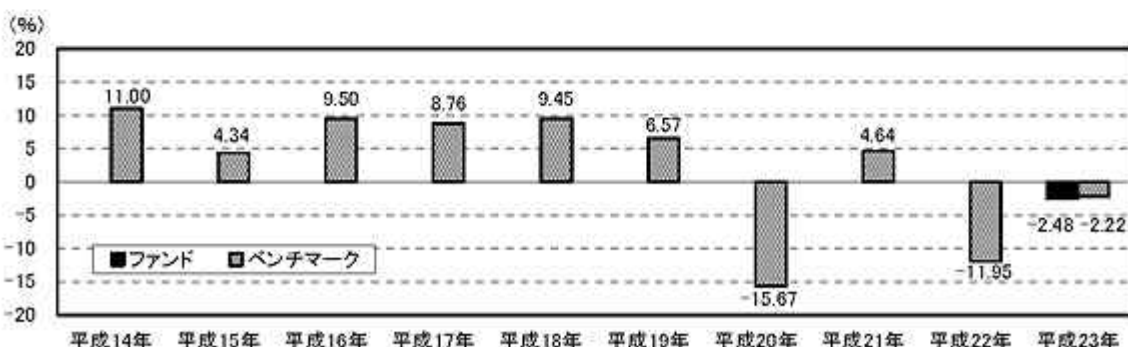
※投資比率は、マザーファンド純資産総額に対する各評価金額の比率で、上位10銘柄について記載しています。

<国/地域別投資比率>

国/地域名	種類	投資比率 (%)	
1	アメリカ	国債証券	39.79
2	フランス	国債証券	9.90
3	ドイツ	国債証券	9.56
4	イタリア	国債証券	8.98
5	イギリス	国債証券	8.06
6	スペイン	国債証券	4.16
7	カナダ	国債証券	2.86
8	ベルギー	国債証券	2.70
9	オランダ	国債証券	2.57
10	オーストリア	国債証券	1.76

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

年間収益率の推移(暦年ベース)



※平成23年のファンドとベンチマークの収益率は設定時から9月末までで算出しております。

※年間収益率の推移は、税引前分配金を再投資したものと算出しています。

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

第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、「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23年3月15日から平成23年9月14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せん。

中間財務諸表

ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 (平成23年9月14日現在)
資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	4,276,781
未収入金	3,000
流動資産合計	4,279,781
資産合計	4,279,781
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	443
未払委託者報酬	2,069
その他未払費用	64
流動負債合計	2,576
負債合計	2,576
純資産の部	
元本等	
元本	¹ 4,342,478
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	³ 65,273
元本等合計	4,277,205
純資産合計	4,277,205
負債純資産合計	4,279,781

(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23年3月15日 至平成23年9月14日
営業収益	
有価証券売買等損益	76,426
営業収益合計	76,426
営業費用	
受託者報酬	443
委託者報酬	2,069
その他費用	64
営業費用合計	2,576
営業損失()	79,002
経常損失()	79,002
中間純損失()	79,002
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,729
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	13,729
中間剰余金又は中間欠損金()	65,273

(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	当中間計算期間 自 平成23年 3月15日 至 平成23年 9月14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。

(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23年 9月14日現在)
1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	3,342,478円
期中一部解約元本額	円
2 中間計算期間末日における受益権の総数	4,342,478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65,273円です。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間（自 平成23年3月15日 至 平成23年9月14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 9月14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 「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。

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)

当中間計算期間末（平成23年9月14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)

当中間計算期間末（平成23年9月14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)

	当中間計算期間末 (平成23年 9月14日現在)
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9850円 (9,850円)

[次へ](#)

<参考>

当ファンドは「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

なお、同親投資信託の状況は次の通りであります。

「ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

区 分	注記 番号	(平成23年 9月14日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
預金		243,591,943
コール・ローン		95,244,581
国債証券		228,307,902,975
派生商品評価勘定		1,416,990
未収入金		505,344,650
未収利息		2,700,558,181
前払費用		187,921,986
流動資産合計		232,041,981,306
資産合計		232,041,981,306
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		442,000
未払解約金		741,016,501
流動負債合計		741,458,501
負債合計		741,458,501
純資産の部		
元本等		
元本	1	161,845,236,259
剰余金		
剰余金又は欠損金()		69,455,286,546
元本等合計		231,300,522,805
純資産合計		231,300,522,805
負債純資産合計		232,041,981,306

(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23年 3月15日 至 平成23年 9月14日
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p>

2 デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	（平成23年 9月14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	180,093,021,439円
同期中における追加設定元本額	7,473,677,073円
同期中における一部解約元本額	25,721,462,253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DC外国債券インデックス・オープン	4,381,215,571円
ステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープン	2,992,640円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド	1,335,480,123円
ステート・ストリート海外国債インデックス・ファンド 適格機関投資家限定	1,707,423,975円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド/為替ヘッジ付き（年金1）＜適格機関投資家限定＞	3,222,015,876円
ステート・ストリート外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	31,818,283,543円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30A＜適格機関投資家限定＞	139,873,420円
ステート・ストリート・バランスファンドVA30B＜適格機関投資家限定＞	11,859,641,308円
ステート・ストリート・バランスファンドVA40A＜適格機関投資家限定＞	9,969,117円

ステート・ストリート・バランスファン ドVA40B<適格機関投資家限定>	100,563,006円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50A<適格機関投資家限定>	18,185,258円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50B<適格機関投資家限定>	19,024,213,992円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンドVA1<適格機関投資家限定 >	3,107,361,838円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50C<適格機関投資家限定>	91,036,437円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA25A<適格機関投資家限定>	12,121,917,145円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA37.5A<適格機関投資家限定>	3,229,840,468円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA75A<適格機関投資家限定>	105,027,483円
ステート・ストリート4資産バランス20VA <適格機関投資家限定>	3,415,622,968円
ステート・ストリート4資産バランス40VA <適格機関投資家限定>	9,303,629,974円
ステート・ストリート4資産バランス30VA <適格機関投資家限定>	3,364,616,283円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA35A<適格機関投資家限定>	9,602,254,803円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA40C<適格機関投資家限定>	1,597,733,694円
ステート・ストリート世界4資産 balan スVA45<適格機関投資家限定>	2,359,931,695円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンド（年金）<適格機関投資 家限定>	5,755,891,224円
ステート・ストリート世界4資産 balan スVA20<適格機関投資家限定>	210,839,446円
ステート・ストリート・グローバル4資 産30VA<適格機関投資家限定>	228,249,174円
ステート・ストリート・グローバル4資 産45VA<適格機関投資家限定>	157,583,898円
ステート・ストリート外国債券インデッ クス・ファンドVA2<適格機関投資家 限定>	124,349,254円
ステート・ストリート4資産バランス3 0VA2<適格機関投資家限定>	181,278,867円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA25B<適格機関投資家限定>	1,738,696,250円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA20A<適格機関投資家限定>	17,502,816円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA35B<適格機関投資家限定>	12,965,261円
ステート・ストリート・バランスファン ドVA50D<適格機関投資家限定>	102,937円

ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドV A 3 <適格機関投資家限定>	22,783,984,565円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドA <適格機関投資家限定>	812,909,146円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 2 0 <適格機関投資家限定>	2,456,887,858円
ステート・ストリート世界分散ファンドV A 2 5 A <適格機関投資家限定>	4,401,018,295円
ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンドA / 為替ヘッジ付き <適格機関投資家限定>	1,043,791,677円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 3 0 <適格機関投資家限定>	191,687円
ステート・ストリート4資産インデックスバランスV A 4 0 <適格機関投資家限定>	163,287円
計	161,845,236,259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	161,845,236,259口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	（平成23年 9月14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	<p>(1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2)有価証券 売買目的有価証券 「注記表（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」に記載してあります。</p> <p>(3)デリバティブ取引 「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」に記載してあります。</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る場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>「注記表（デリバティブ取引等関係に関する注記）」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>
---------------------------	---

（有価証券関係に関する注記）
（平成23年9月14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）
取引の時価等に関する事項
通貨関連

（単位：円）

区分	種類	（平成23年 9月14日現在）			
		契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建				
	アメリカ・ドル	329,541,800		328,491,100	1,050,700
	イギリス・ポンド	69,626,190		69,260,700	365,490
	シンガポール・ドル	6,217,100		6,217,000	100
	ユーロ	310,429,700		310,871,000	441,300
合計	715,814,790		714,839,800	974,990	

（注）1．時価の算定方法

(1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- 2．換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
- 4．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	（平成23年 9月14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)	1.4291円 (14,291円)
--	----------------------

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

(平成23年9月30日現在)

資産総額	4,911,764円
負債総額	536円
純資産総額（ - ）	4,911,228円
発行済口数	5,036,032口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	0.9752円 (9,752円)

<参考情報>

親投資信託受益証券（ステート・ストリート外国債券インデックス・マザー・ファンド）

(平成23年9月30日現在)

資産総額	232,449,189,157円
負債総額	819,960,792円
純資産総額（ - ）	231,629,228,365円
発行済口数	163,667,219,135口
1口当たり純資産額（ / ） （1万口当たりの純資産の額）	1.4152円 (14,152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]
内部管理本部	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）
	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
-------	--

(略)

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. 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3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
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円 (平成23年3月現在)	金融商品取引法に基づく第1種金融商品取引業を営んでいます。

(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 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているステート・ストリートDCグローバル債券インデックス・オープンの平成23年3月15日から平成23年9月14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DCグローバル債券インデックス・オープンの平成23年9月14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3月15日から平成23年9月14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。