【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年12月22日
【発行者名】	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役　土岐 大介
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木六丁目10番１号 六本木ヒルズ森タワー
【事務連絡者氏名】	法務部　山﨑 誠吾
【電話番号】	03－6437－6000
【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】	ダ・ヴィンチ ライト
【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】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

１【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成22年６月25日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項に変更が生じ、また、本日、半期報告書を提出いたしましたので、原届出書の関係事項を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

２【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下のとおり訂正または更新します。
※下線部＿＿が訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

（12）その他

＜訂正前＞

＜中略＞

（ご参考）ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

2010年	7月 5日	独立記念日(翌日)(ニューヨーク)
	8月30日	一般公休日(ロンドン)
	9月 6日	労働者の日(ニューヨーク)
	10月11日	コロンブス記念日(ニューヨーク)
	11月11日	退役軍人の日(ニューヨーク)
	11月25日	感謝祭(ニューヨーク)
	12月24日	クリスマス(前日)(ニューヨーク)
	12月27日	クリスマス(翌々日)(ロンドン)
	12月28日	ボクシング・デー(翌々日)(ロンドン)

2010年6月25日現在、委託会社が認識し得る2010年12月末までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。
(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

＜訂正後＞

＜中略＞

（ご参考）ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

2010年	12月24日	クリスマス(前日)(ニューヨーク)
	12月27日	クリスマス(翌々日)(ロンドン)
	12月28日	ボクシング・デー(翌々日) (ロンドン)
2011年	1月1日	ニュー・イヤーズ・デー(ニューヨーク)
	1月3日	ニュー・イヤーズ・デー(翌々日)(ロンドン)
	1月17日	キング牧師誕生記念日(ニューヨーク)
	2月21日	ワシントン誕生記念日(ニューヨーク)
	4月22日	復活祭(聖金曜日)(ロンドン、ニューヨーク)
	4月25日	復活祭(月曜日)(ロンドン)
	5月2日	メーデー(ロンドン)
	5月30日	一般公休日(ロンドン)、戦没者記念日(ニューヨーク)

2010年12月22日現在、委託会社が認識し得る2011年6月末までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

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

＜訂正前＞

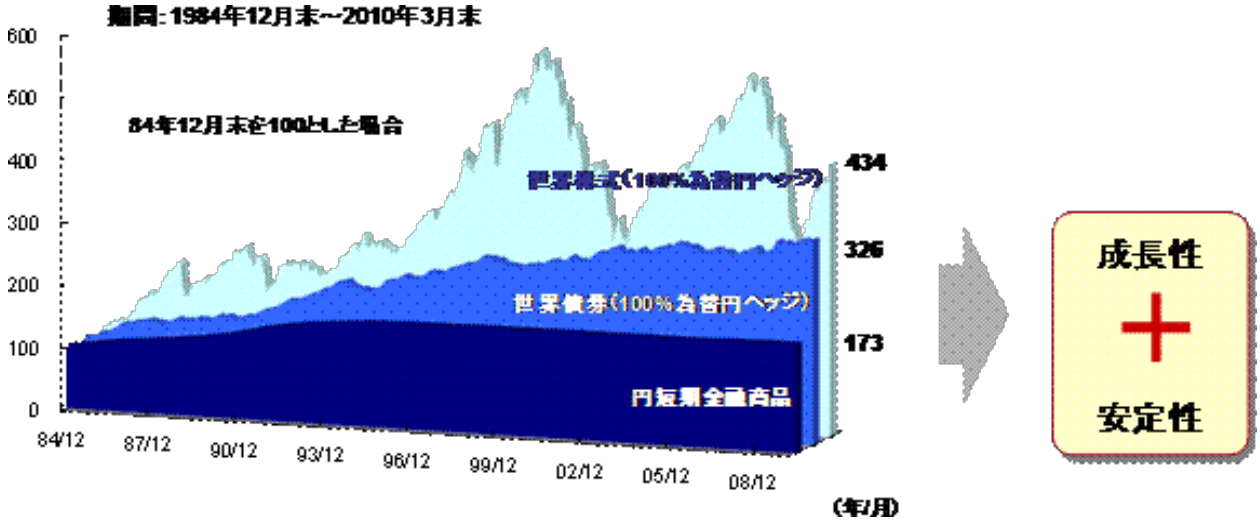
（１）ファンドの目的及び基本的性格

＜中略＞

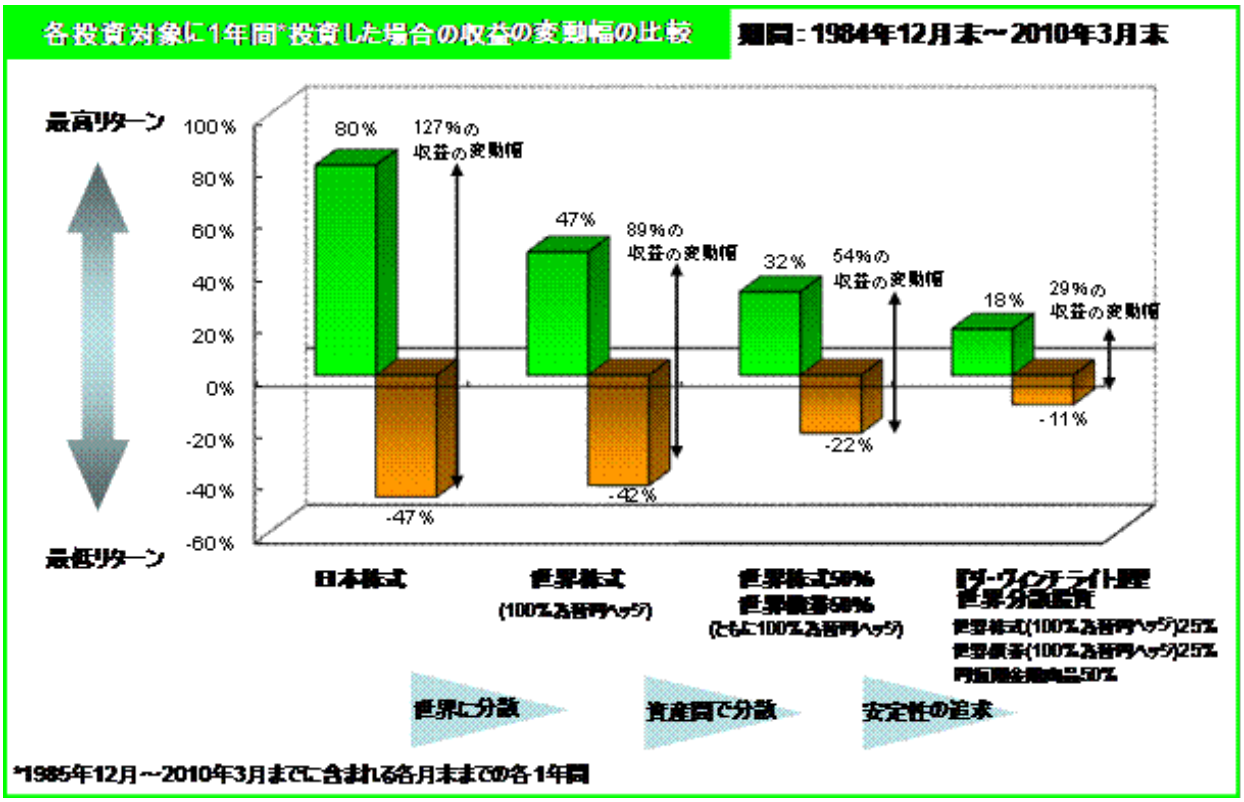
「ダ・ヴィンチ ライト」の特徴２

＜中略＞

■ベンチマーク構成資産の値動きの推移



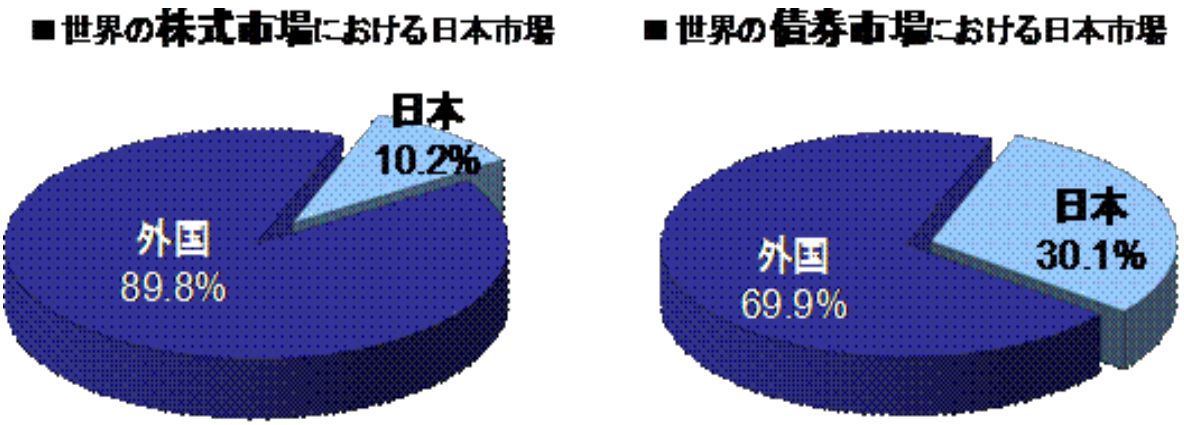
＜中略＞



＜中略＞

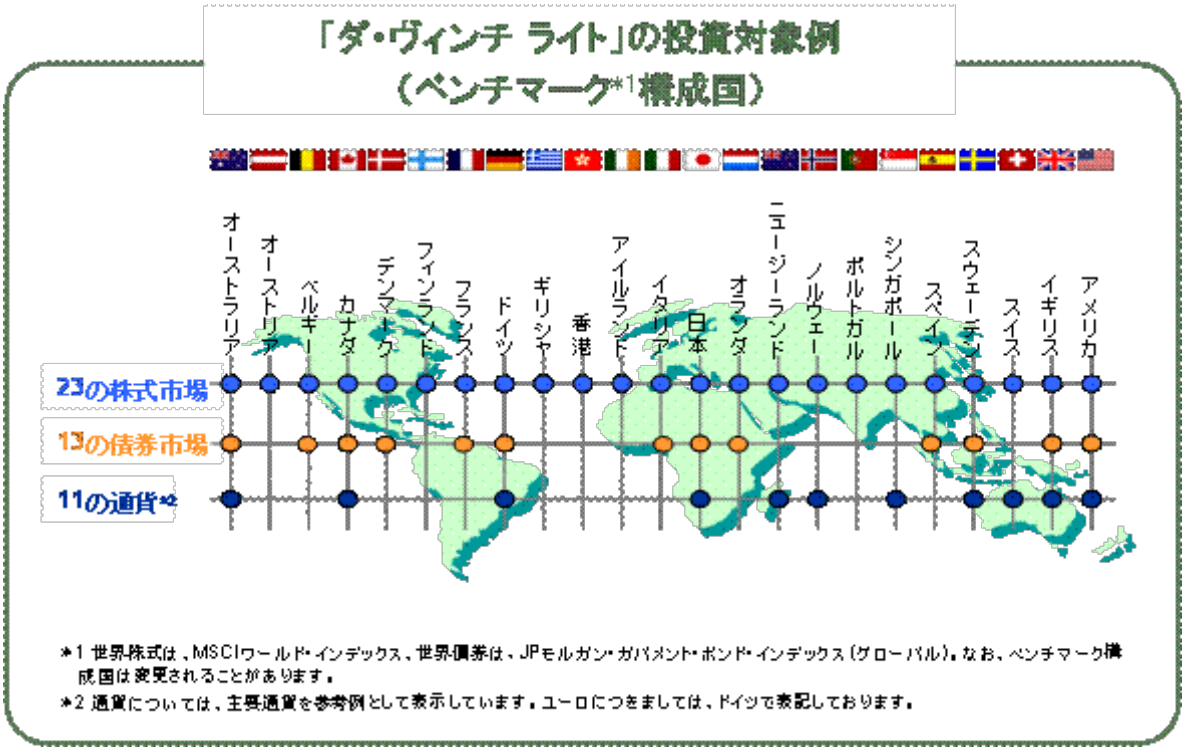
「ダ・ヴィンチ ライト」の特徴３

＜中略＞



2010年3月末現在

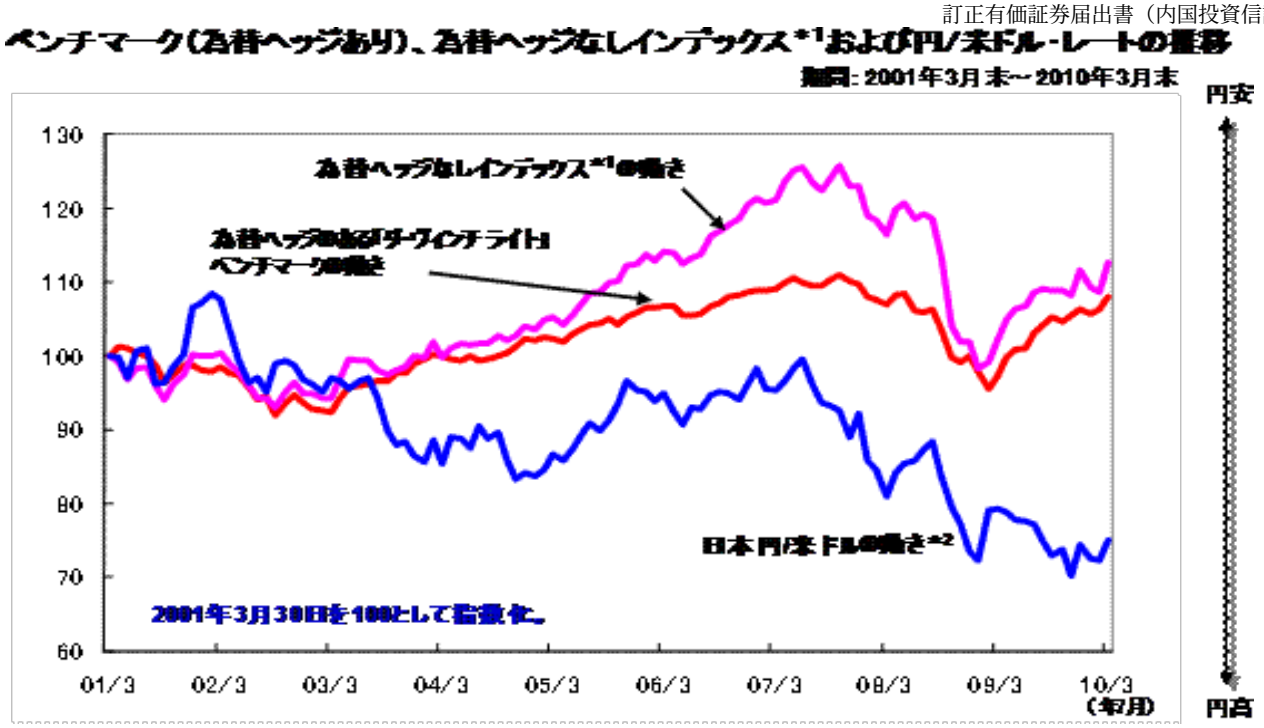
＜中略＞



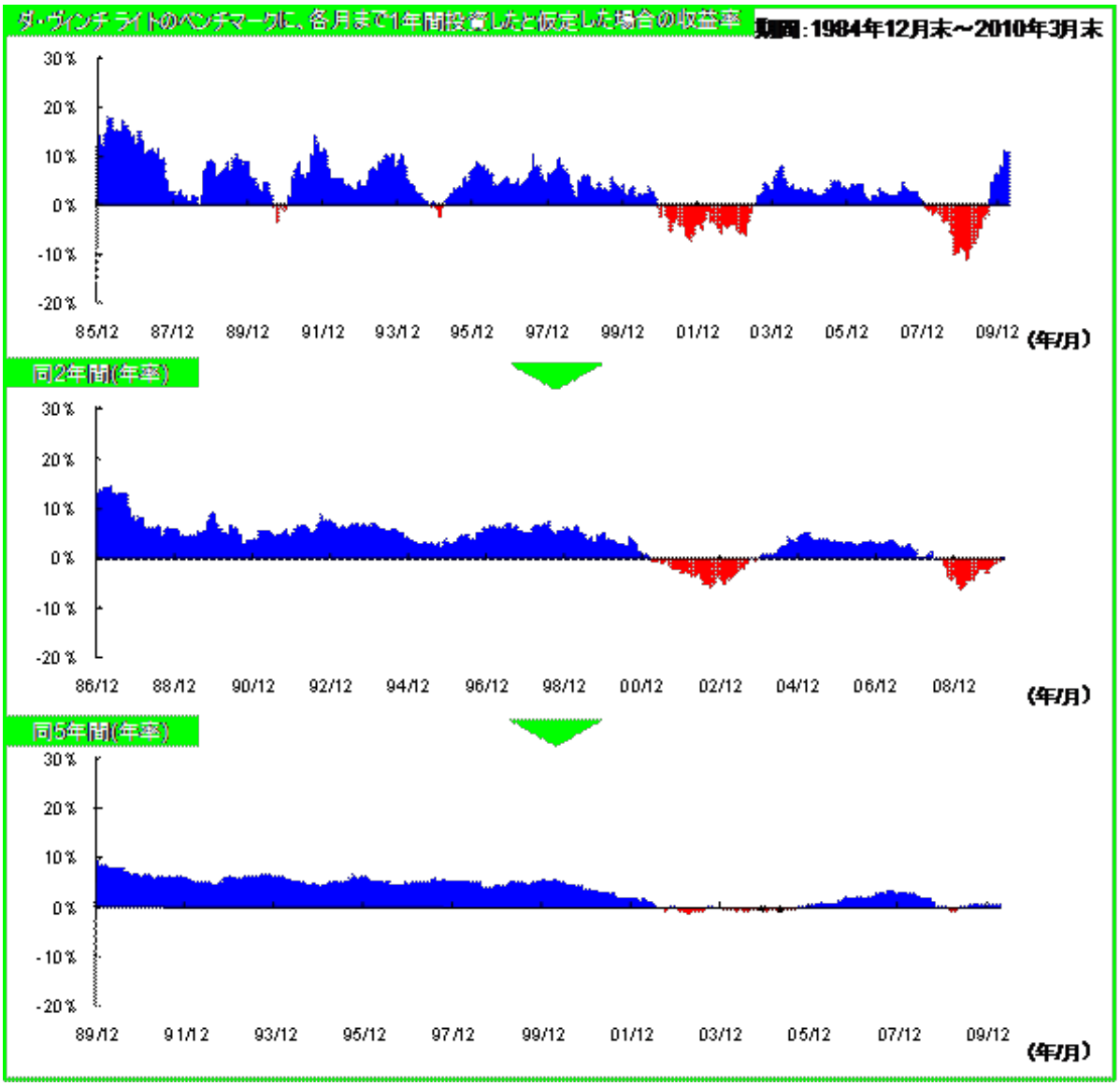
2010年３月末現在

「ダ・ヴィンチ ライト」の特徴４

＜中略＞



＜中略＞



＜中略＞

2．ファンドの関係法人

① 委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

＜中略＞

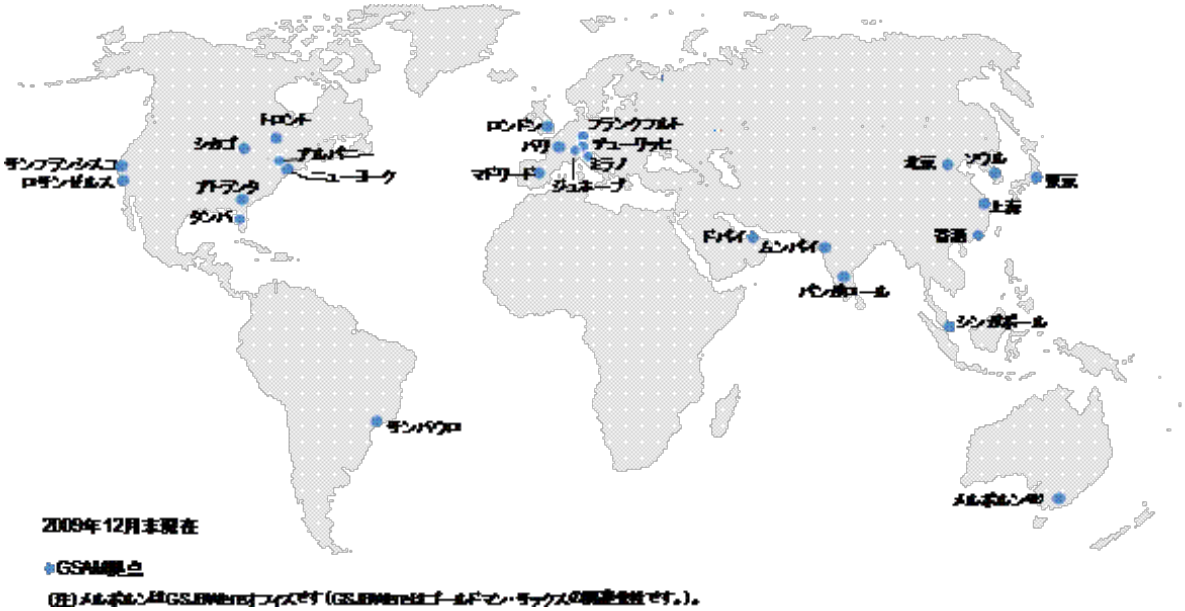
＜ご参考＞ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（ＧＳＡＭ）とは

ゴールドマン・サックスは、1869年（明治2年）創立の世界有数の金融グループのひとつであり、世界の主要都市に拠点を有し、世界中の政府機関・企業・金融機関等に対して、投資銀行業務・証券売買業務・為替商品取引・資産運用業務など、多岐にわたる金融サービスを提供しています。

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（ＧＳＡＭ）は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2009年12月末現在、グループ全体で7,534億米ドル（約69.4兆円*）の資産を運用しています。

＊米ドルの円貨換算は便宜上、2009年12月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝92.1円）により、計算しております。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントの東京拠点です。



＜後略＞

＜訂正後＞

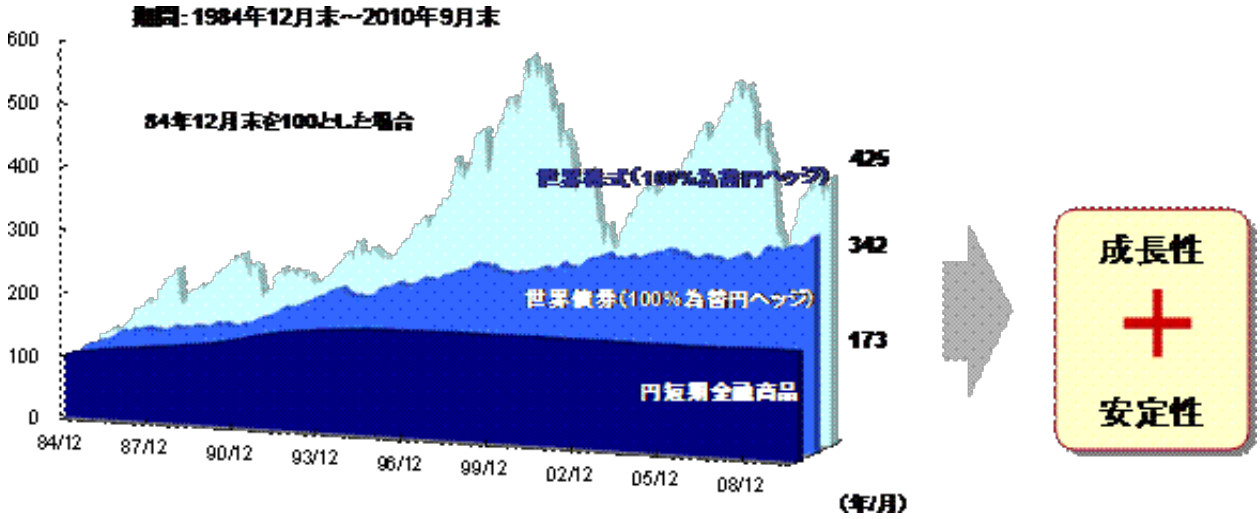
（１）ファンドの目的及び基本的性格

＜中略＞

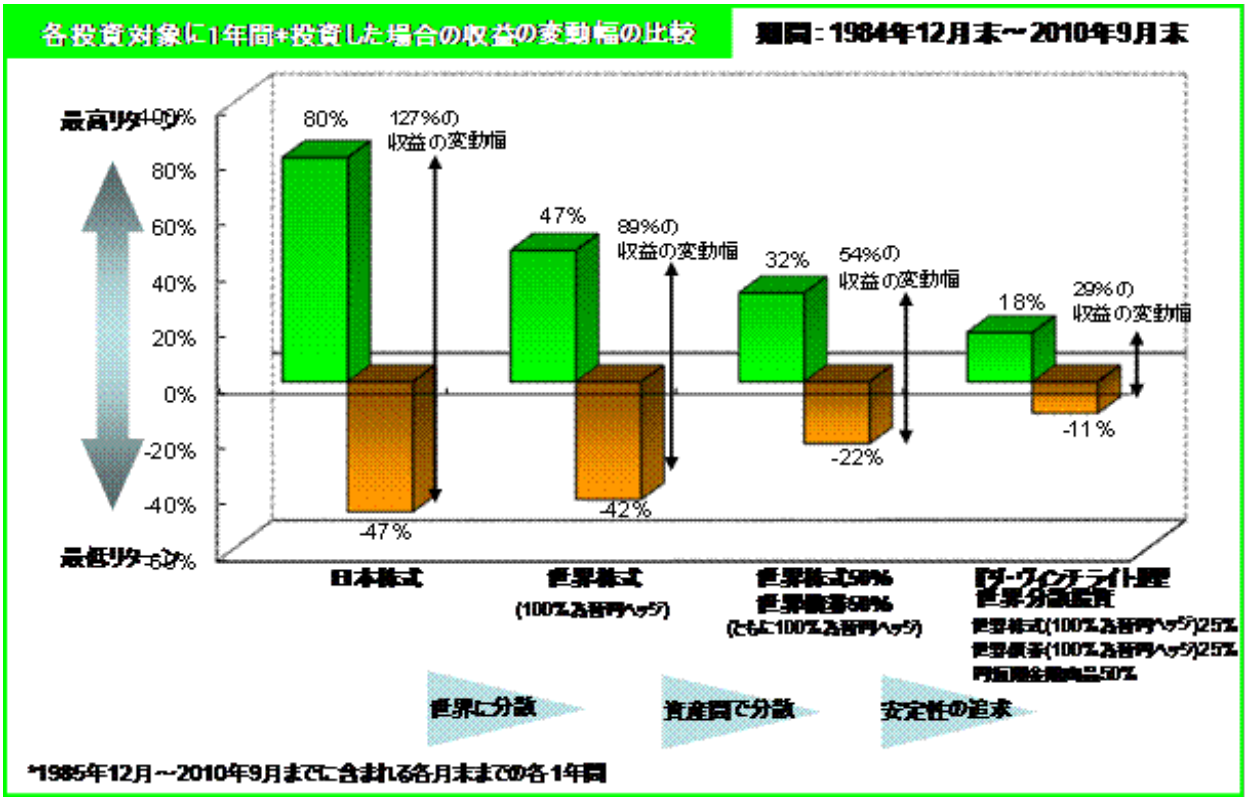
「ダ・ヴィンチ　ライト」の特徴２

＜中略＞

■ベンチマーク構成資産の値動きの推移



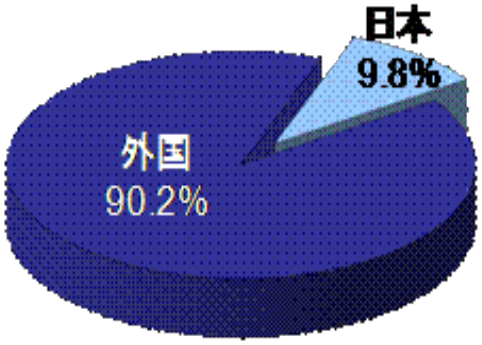
＜中略＞

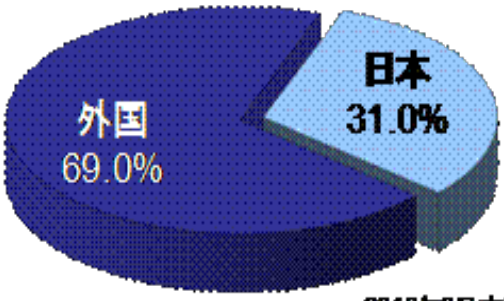


＜中略＞

「ダ・ヴィンチ ライト」の特徴３

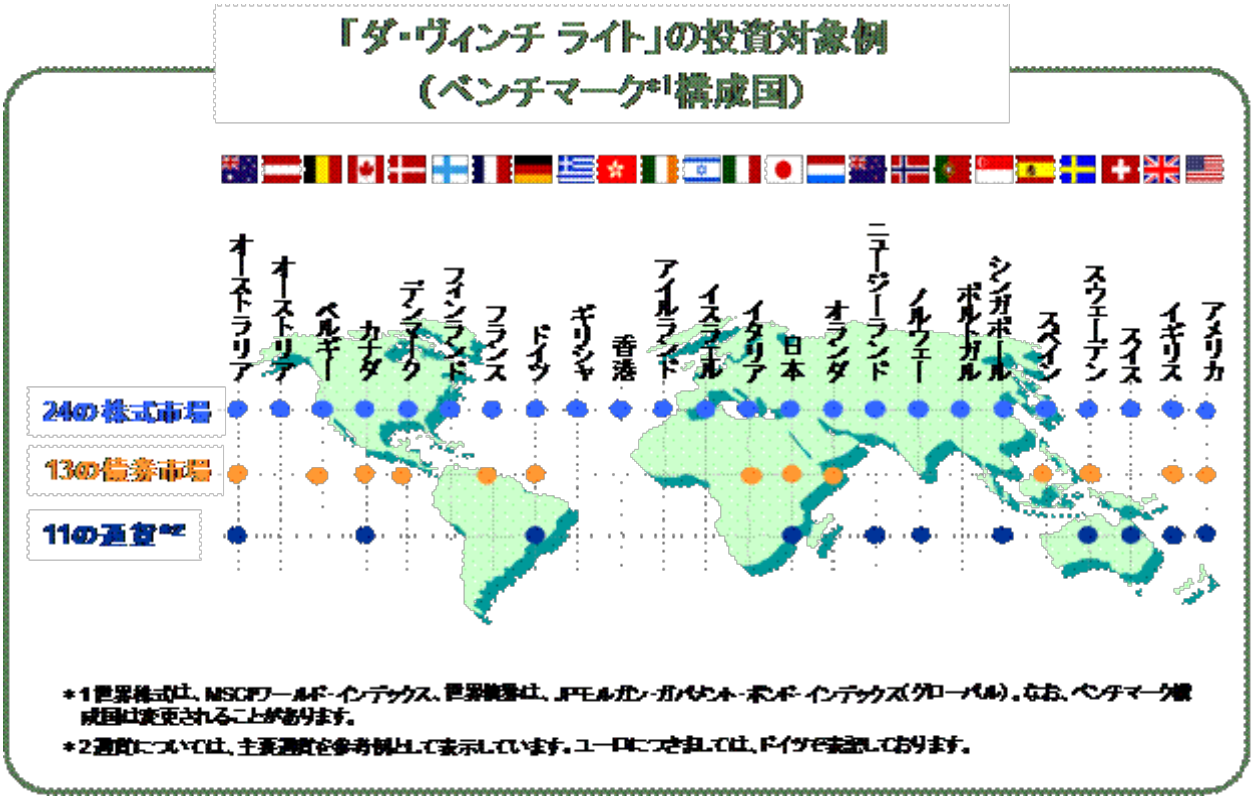
＜中略＞





2010年9月末現在

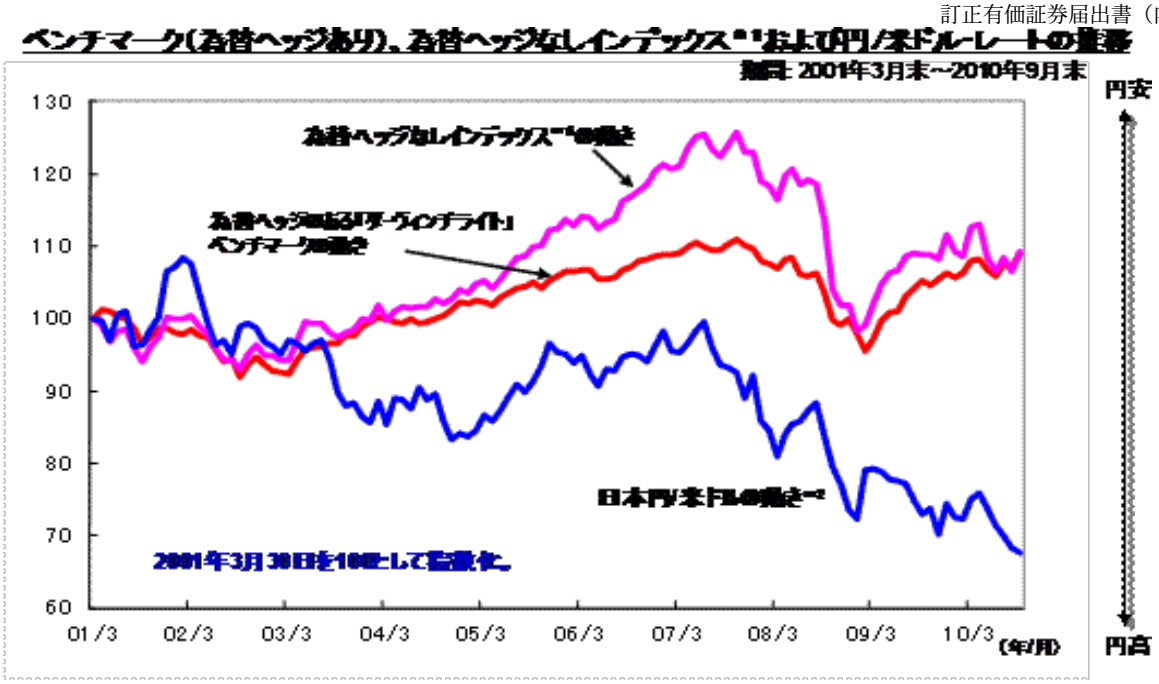
＜中略＞



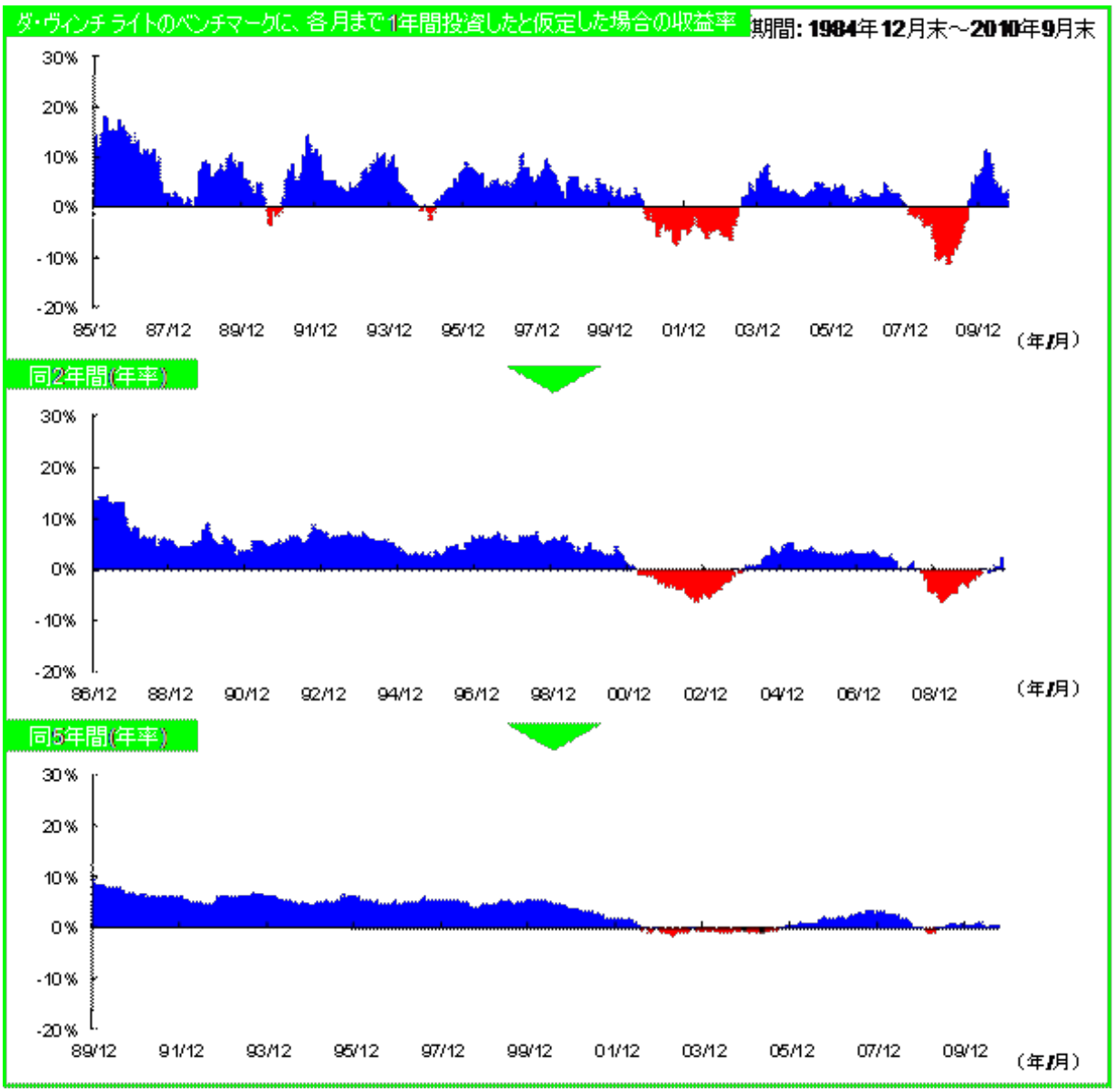
2010年９月末現在

「ダ・ヴィンチ ライト」の特徴４

＜中略＞



＜中略＞



＜中略＞

2．ファンドの関係法人

① 委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

＜中略＞

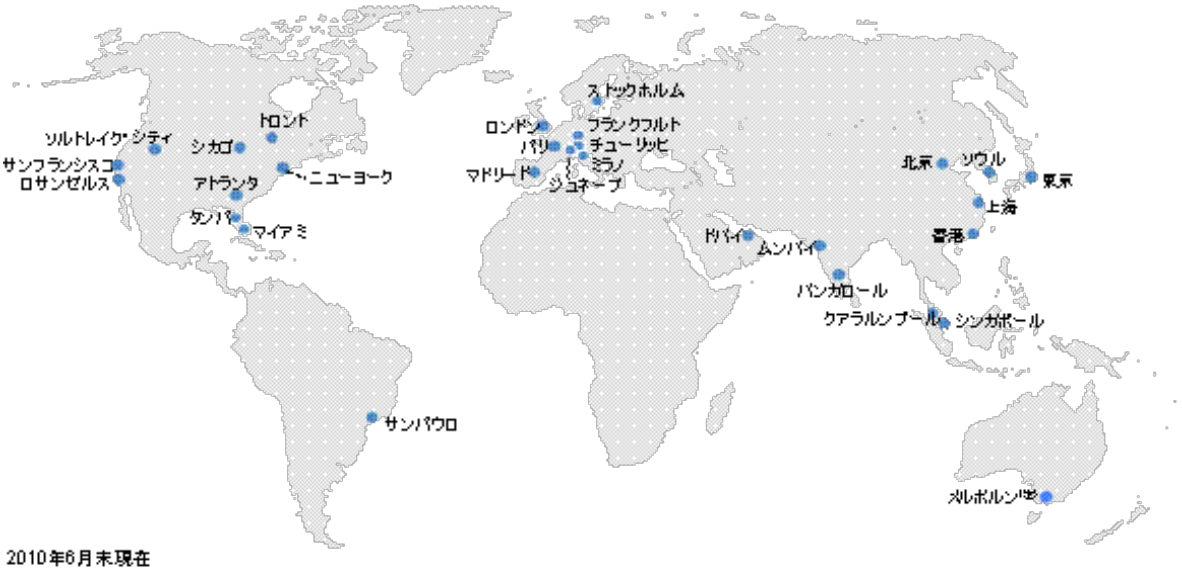
＜ご参考＞ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（ＧＳＡＭ）とは

ゴールドマン・サックスは、1869年（明治2年）創立の世界有数の金融グループのひとつであり、世界の主要都市に拠点を有し、世界中の政府機関・企業・金融機関等に対して、投資銀行業務・証券売買業務・為替商品取引・資産運用業務など、多岐にわたる金融サービスを提供しています。

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント（ＧＳＡＭ）は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2010年６月末現在、グループ全体で6,770億米ドル（約59.9兆円*）の資産を運用しています。

＊米ドルの円貨換算は便宜上、2010年６月30日現在の株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝88.48円）により、計算しております。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントの東京拠点です。



2010年6月末現在
● GSAM拠点
(注) メルボルンはGoldman Sachs & Partners Australia Pty Ltdオフィスです。

＜後略＞

2 投資方針

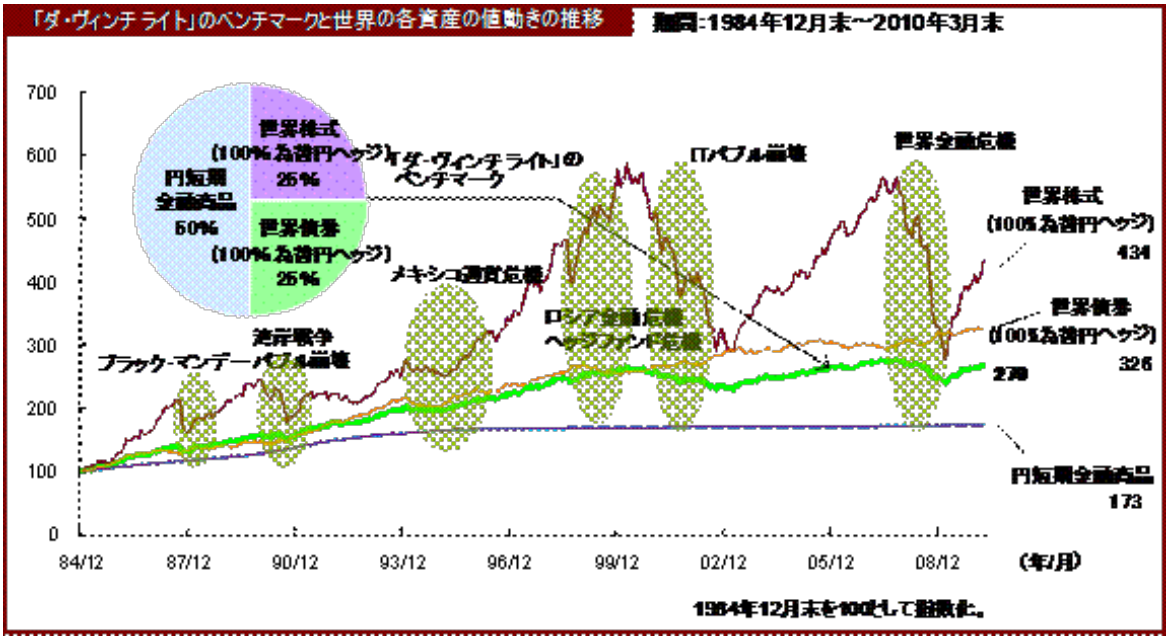
＜訂正前＞

（1）投資方針

＜中略＞

e．「ダ・ヴィンチ ライト」 の投資対象の値動きの特徴

＜中略＞

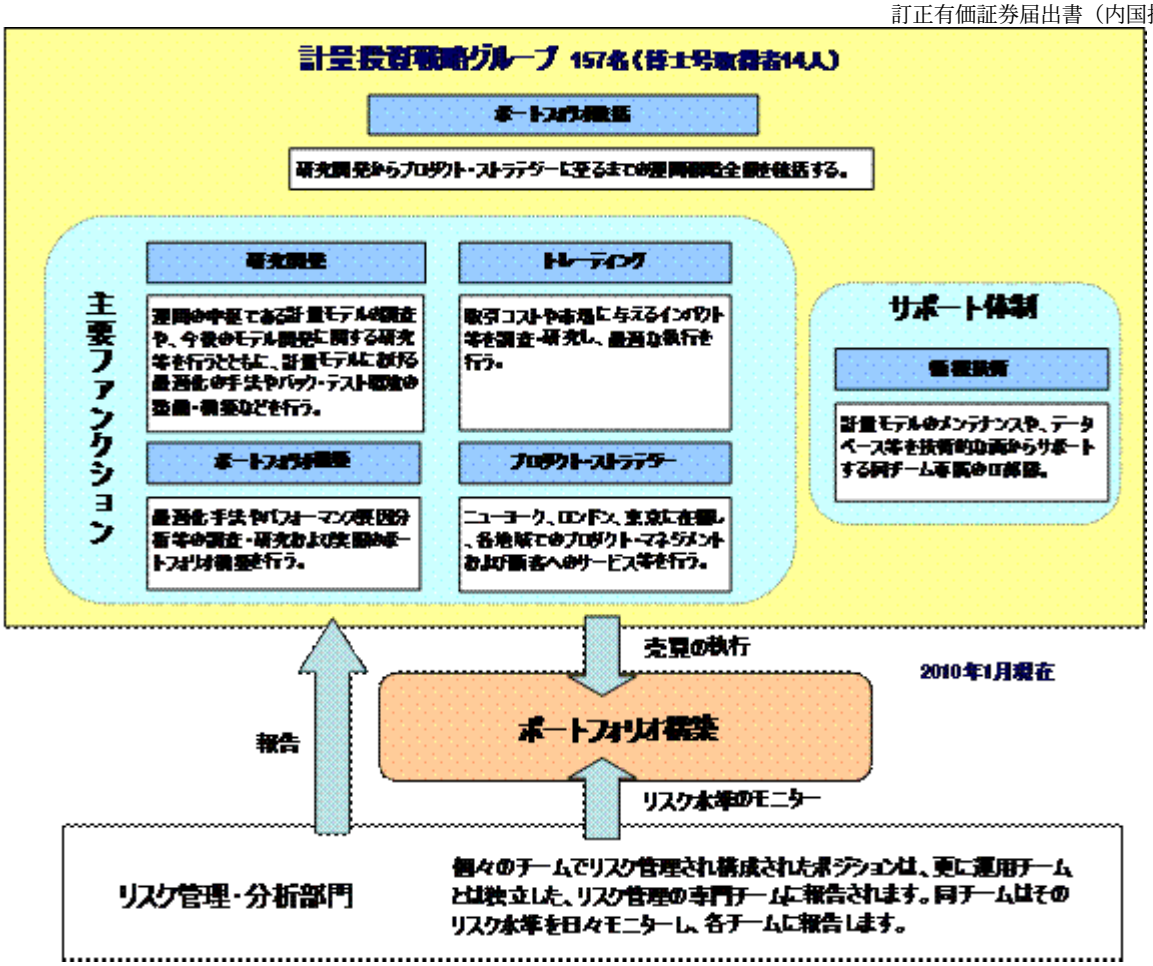


＜中略＞

（3）運用体制

a．組織

本ファンドの運用は、ＧＳＡＭニューヨークの計量投資戦略グループが主として担当します。同グループの組織体制の特徴としては、経験・知識を共有化するチーム運用体制、豊富な実務経験と学識経験の融合といったことが挙げられます。また、運用チームとは独立した「リスク管理・分析部門」がファンドのリスク管理を行います。



＜中略＞

c．内部管理体制

委託会社は、リスク検討委員会を設置しています。リスク検討委員会は、委託会社の運用に関する業務において、適用法令、協会規則、投資信託約款、顧客との運用ガイドラインを遵守するとともに、善良なる管理者としての注意義務および忠実義務の観点から委託者としての責任を遵守するという目的のため、必要な報告聴取、調査、検討、決定等を行うことができます。

（４）分配方針

＜中略＞

※収益分配金の受取りをご希望の方は、販売会社によっては再投資を中止することを申出ることができます。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

（５）投資制限

＜後略＞

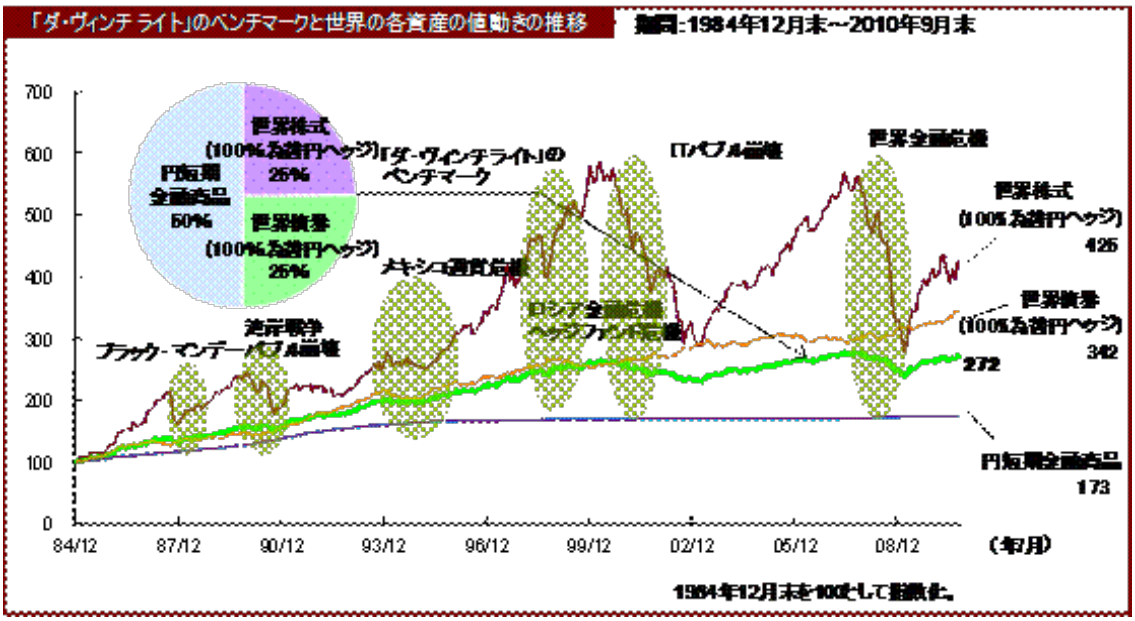
＜訂正後＞

（1）投資方針

＜中略＞

e．「ダ・ヴィンチ ライト」 の投資対象の値動きの特徴

＜中略＞

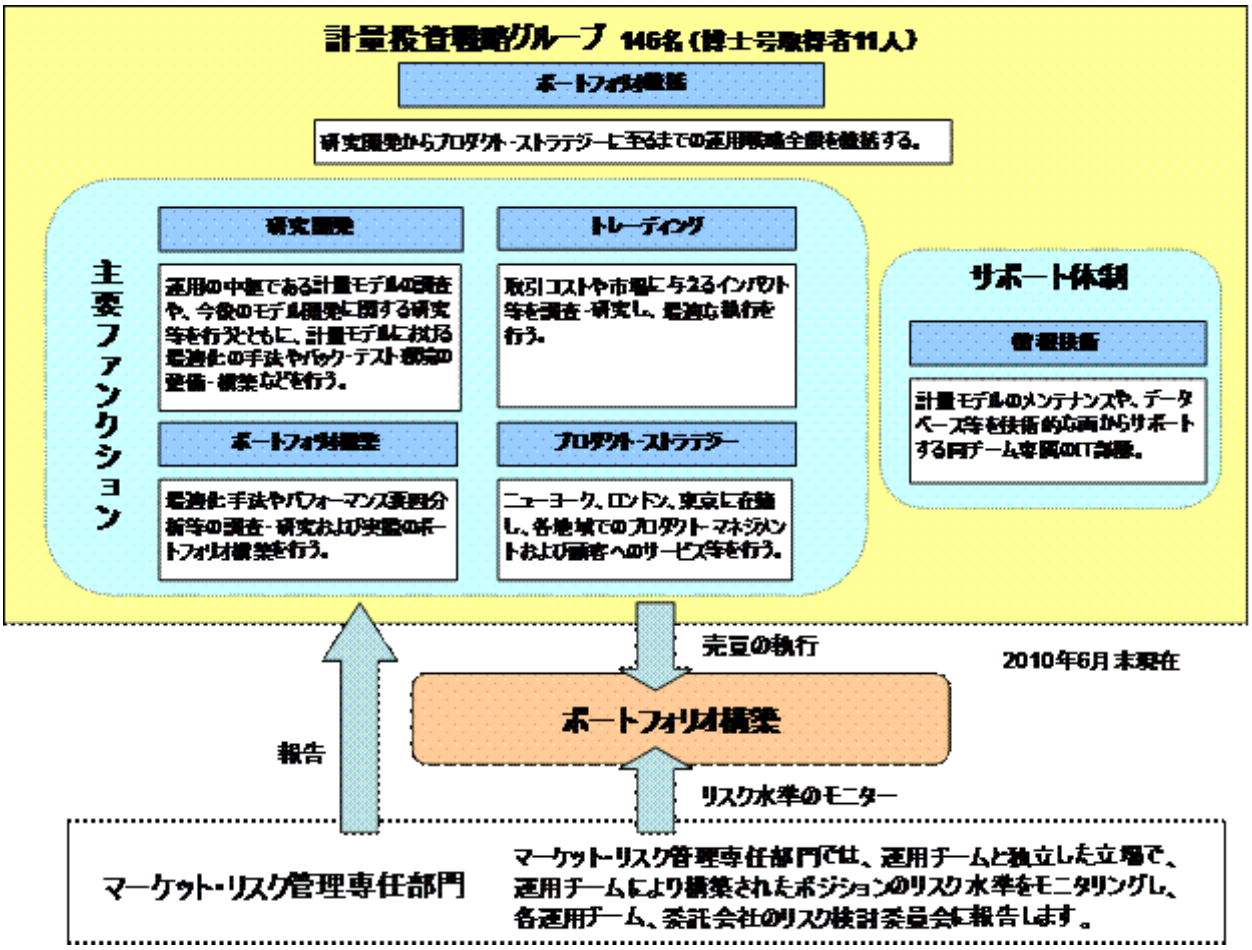


＜中略＞

（3）運用体制

a．組織

本ファンドの運用は、ＧＳＡＭニューヨークの計量投資戦略グループが主として担当します。同グループの組織体制の特徴としては、経験・知識を共有化するチーム運用体制、豊富な実務経験と学識経験の融合といったことが挙げられます。また、運用チームとは独立した「マーケット・リスク管理専任部門」がファンドのリスク管理を行います。



＜中略＞

ｃ．内部管理体制

委託会社は、リスク検討委員会を設置しています。リスク検討委員会は、法務部、コンプライアンス部を含む各部署の代表から構成されており、マーケット・リスク管理専任部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、検討、決定等を月次で行います。

（４）分配方針

＜中略＞

※収益分配金の受取りをご希望の方は、販売会社によっては再投資を中止することを申出ることができます。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

＜収益分配金に関わる留意点＞

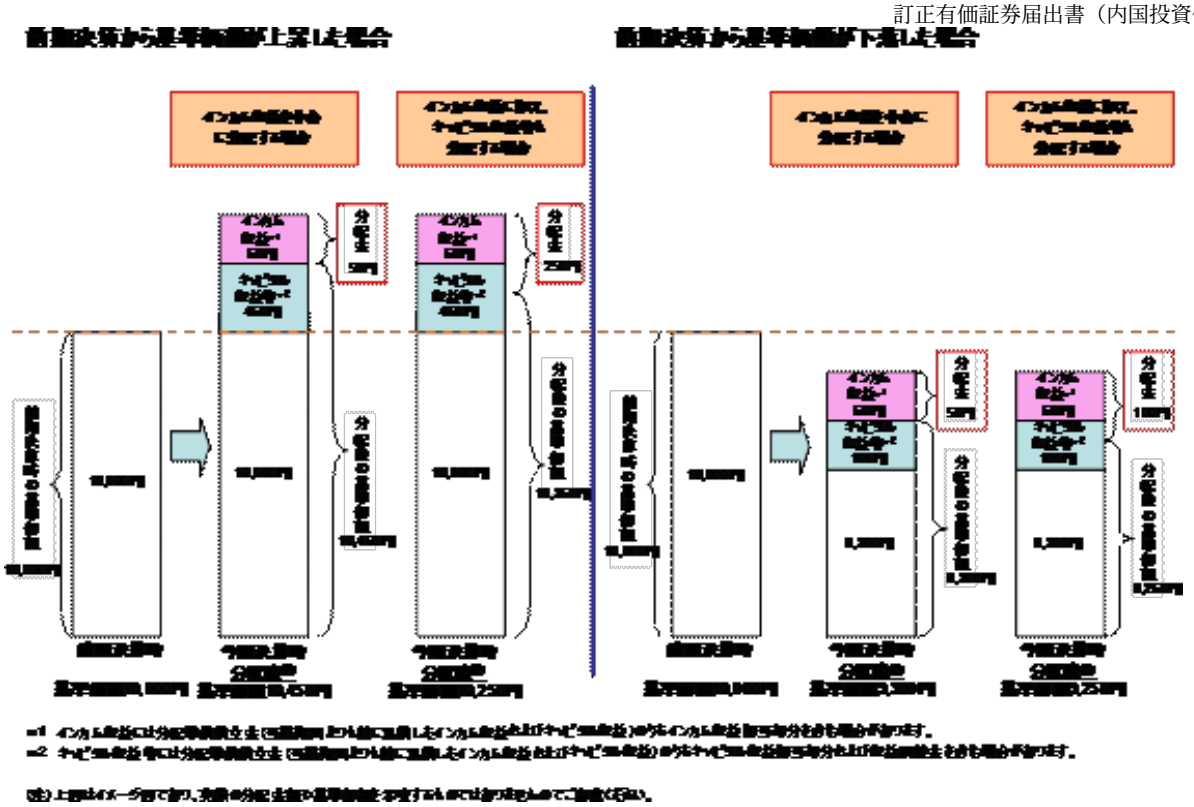
本ファンドは以下の分配原資を分配対象とすることができます。

１．経費控除後の利子・配当等収益（インカム収益）
２．経費控除後の売買益（キャピタル収益）
３．経費控除後の評価益（キャピタル収益）
４．分配準備積立金（当該計算期間よりも前に累積したインカム収益およびキャピタル収益）
５．収益調整金（信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分）

毎決算時に、基準価額水準、市場動向等を勘案して収益を分配します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本（１万口＝１万円）を下回る場合においても分配を行うことがあります。収益分配は、これを行わない場合と比較すると、その金額相当分、基準価額が低くなり、その影響により、換金時・償還時において元本割れとなる可能性があるほか、信託財産の成長性に影響する可能性があります。本ファンドがキャピタル収益から収益分配金を支払う場合には、かかる影響の程度がより大きくなる傾向があります。

本ファンドは、当該計算期間におけるインカム収益を超えて収益分配金を支払う場合があります。また、過去に累積した上記分配原資から分配を行う場合、個別の投資家のお買付の時期により実質的な投資元本の払い戻しとなる場合があります。分配対象に相当するファンド資産は、通常、他の信託財産と同様に運用がなされており、収益分配金の支払いのために現金化あるいはポートフォリオ再構築を行うための追加的な取引が生じることによって、取引コスト等が発生することにご留意ください。

また、本ファンドが支払う分配金額の水準と、かかる分配金の支払いにより本ファンドの基準価額が減価すること、またその影響（複利効果の逸失）につき十分ご考慮ください。特に、元本の保全性を重視される投資家の場合には、上記のような分配金の払い出しは、そのご意向に合致しない場合があります。



（５）投資制限

＜後略＞

3 投資リスク

＜訂正前＞

(1) 投資リスク

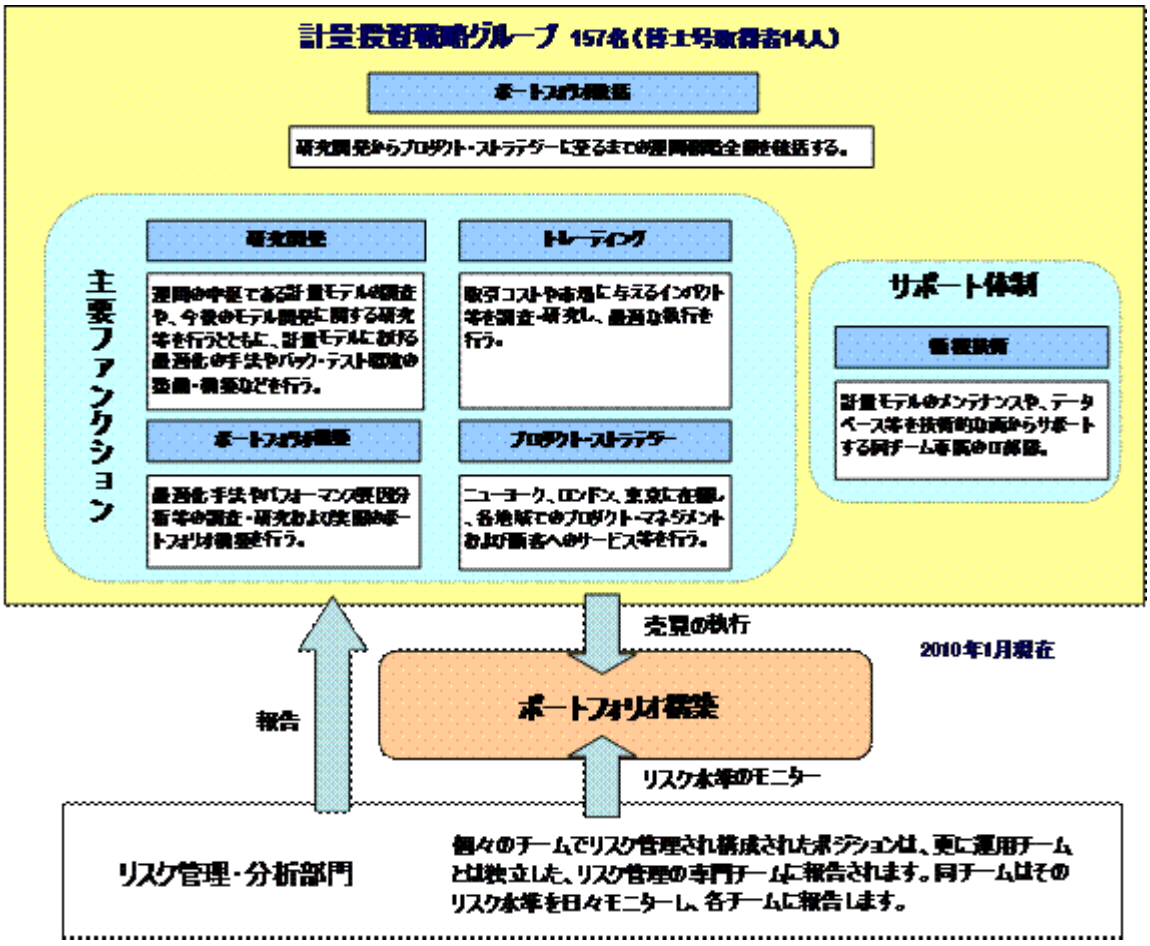
＜中略＞

(k) その他の留意点

収益分配金・一部解約金・償還金の支払はすべて販売会社を通じて行われます。それぞれの場合においてその金額が販売会社に対して支払われた後は、委託会社は受益者への支払についての責任を負いません。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用について、販売会社は販売（お買付代金の預り等を含みます。）について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。

(2) 投資リスクに対する管理体制



＜後略＞

＜訂正後＞

(1) 投資リスク

＜中略＞

(k) その他の留意点

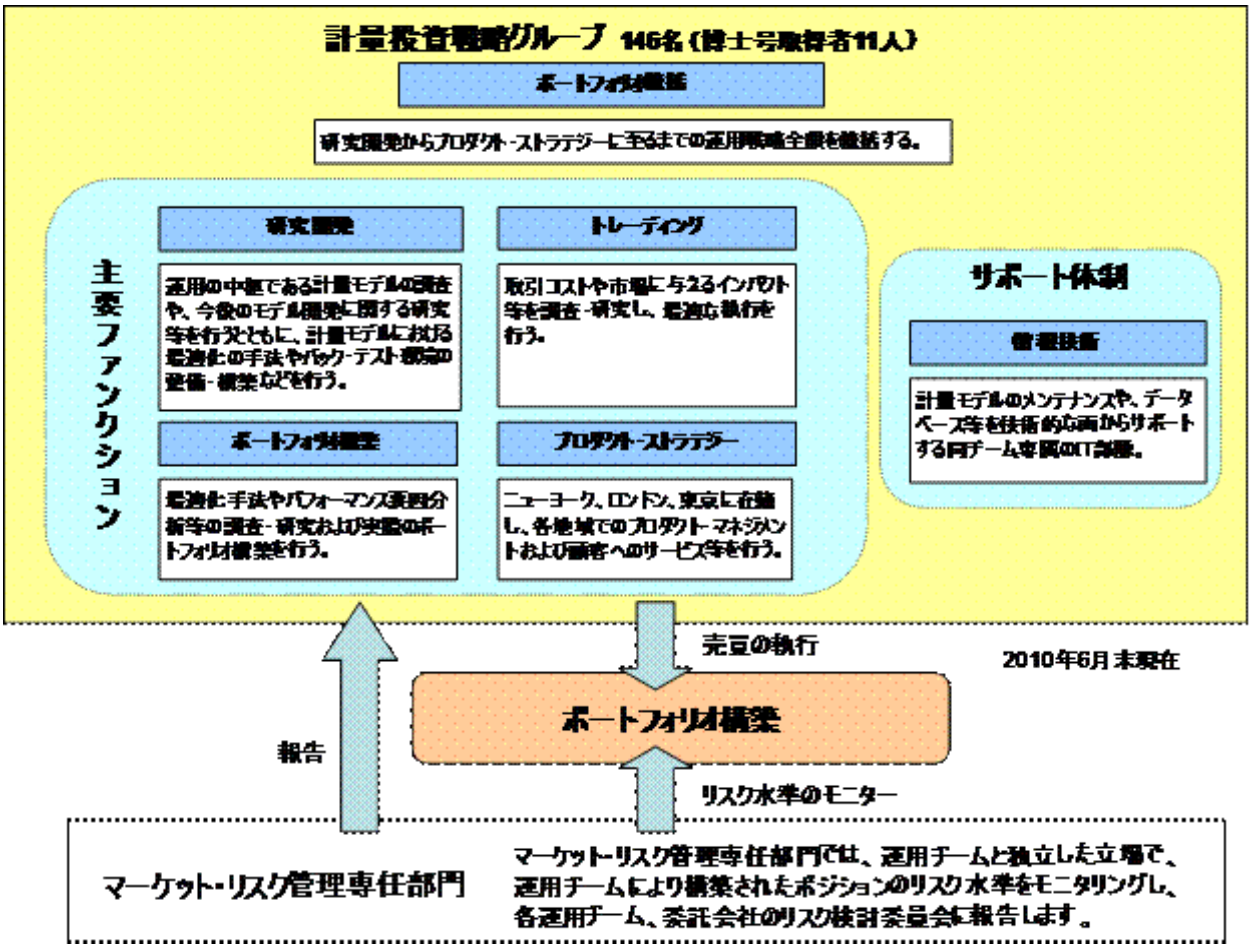
収益分配金・一部解約金・償還金の支払はすべて販売会社を通じて行われます。それぞれの場合においてその金額が販売会社に対して支払われた後は、委託会社は受益者への支払についての責任を負いません。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用について、販売会社は販売（お買付代金の預り等を含みます。）について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。

(l) 繰上償還に関わる留意点

委託会社は、受益権の総口数が100億口を下回ることとなった場合等には、受託銀行と協議のうえ、必要な手続を経て、この信託を終了させることができます。また、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託銀行と合意のうえ、必要な手続を経て、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。繰上償還された場合には、申込手数料は返還されません。

(2) 投資リスクに対する管理体制



＜後略＞

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」については、下記の内容に更新されます。

＜訂正・更新後＞

（１）投資状況

（2010年９月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	アメリカ	1,173,339,182	62.92
親投資信託受益証券	―	179,772,682	9.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	511,731,930	27.44
合計（純資産総額）	―	1,864,843,794	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

参考情報

＜ＧＳ ＧＴＡＡ戦略マザーファンド＞

（2010年９月30日現在）

資産の種類	国名	時価合計（円）	投資比率（％）
特殊債券	アメリカ	2,438,869,300	72.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	932,923,895	27.67
合計（純資産総額）	―	3,371,793,195	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

（2010年９月30日現在）

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量(券面総額／口数)	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	特殊債券	FHLB DISCOUNT NT 0%	14,000,000	8,378.18	1,172,946,066	8,380.99	1,173,339,182	－	2010/11/5	62.92
2	日本	親投資信託受益証券	ＧＳ ＧＴＡＡ戦略マザーファンド	112,147,650	1.4543	163,099,027	1.6030	179,772,682			9.64

種類別及び業種別投資比率

（2010年９月30日現在）

種類	投資比率（%）
特殊債券	62.92
親投資信託受益証券	9.64
合計	72.56

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

② 投資不動産物件

（2010年９月30日現在）

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

有価証券先物取引等

（2010年９月30日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	その他	Nasdaq Omx Europe	OMXS30	買建	7	スウェーデンクローナ	754,663	760,200	9,479,694	0.51
	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物	買建	6	日本円	49,496,250	49,590,000	49,590,000	2.66
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	50	米ドル	2,744,212.5	2,852,250	239,075,597	12.82
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	2	カナダドル	280,668.22	285,240	23,155,783	1.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX DTB	買建	1	ユーロ	157,076.65	156,450	17,872,848	0.96
	イタリア	イタリア証券取引所	S&P/MIB	買建	1	ユーロ	103,979.5	101,435	11,587,934	0.62
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	買建	2	オーストラリアドル	232,207	233,650	19,030,792	1.02
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	7	英ポンド	386,766.9	388,255	51,509,790	2.76
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS MKT	買建	4	スイスフラン	258,970	252,520	21,673,791	1.16
	香港	香港先物取引所	HANG SENG	買建	1	香港ドル	1,103,946.88	1,117,350	12,067,380	0.65
	シンガポール	シンガポール取引所	MSCI SING	買建	1	シンガポールドル	73,433.55	73,420	4,671,714	0.25
	オランダ	アムステルダム取引所	AEX	買建	1	ユーロ	66,893.5	67,200	7,676,928	0.41
	スペイン	スペイン金融先物取引所（マドリード）	IBEX 35	買建	1	ユーロ	107,467.75	104,475	11,935,224	0.64
	その他	Marche des Options Negociables de Paris	CAC40	買建	6	ユーロ	226,826.4	224,220	25,614,892	1.37
債券先物取引	日本	東京証券取引所	東証長期国債標準物先物	買建	100,000,000	日本円	141,520,400	143,420,000	143,420,000	7.69
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1012	買建	12	米ドル	1,502,139.72	1,513,875	126,893,002	6.80
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1012	買建	1	カナダドル	125,684	126,430	10,263,587	0.55
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1012	買建	8	ユーロ	1,048,978.98	1,054,480	120,463,795	6.46
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1012	買建	2	英ポンド	248,724.7	249,420	33,090,551	1.77

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率をいいます。

（注２）評価額は、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

参考情報

＜ＧＳ ＧＴＡＡ戦略マザーファンド＞

① 投資有価証券の主要銘柄

（2010年９月30日現在）

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量(券面総額)	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	特殊債券	FHLB DISCOUNT NT 0%	29,100,000	8,378.21	2,438,059,222	8,380.99	2,438,869,300	－	2010/11/5	72.33

種類別及び業種別投資比率

（2010年９月30日現在）

種類	投資比率（%）
特殊債券	72.33
合計	72.33

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

② 投資不動産物件（2010年９月30日現在）

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

有価証券先物取引等

（2010年９月30日現在）

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	その他	Nasdaq Omx Europe	OMXS30	売建	108	スウェーデンクローナ	11,618,193.79	11,728,800	146,258,136	△4.34
	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物	買建	74	日本円	620,930,762	611,610,000	611,610,000	18.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	DJIA MINI	売建	248	米ドル	12,970,511	13,367,200	1,120,438,704	△33.23
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	209	米ドル	11,470,808.25	11,922,405	999,335,987	29.64
	アメリカ	シカゴ商業取引所	NSDQ100 MINI	買建	306	米ドル	11,526,025.5	12,295,080	1,030,573,605	30.56
	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	RUSSELL MINI	売建	104	米ドル	6,619,183.8	7,026,240	588,939,436	△17.47
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	売建	97	カナダドル	13,625,998	13,834,140	1,123,055,485	△33.31
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX DTB	買建	33	ユーロ	5,178,709.98	5,162,850	589,803,984	17.49
	イタリア	イタリア証券取引所	S&P/MIB	買建	9	ユーロ	935,815.5	912,915	104,291,409	3.09
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	売建	164	オーストラリアドル	19,043,576.83	19,159,300	1,560,524,985	△46.28
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	226	英ポンド	12,487,045.68	12,535,090	1,663,030,390	49.32
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS MKT	売建	188	スイスフラン	12,153,417.93	11,868,440	1,018,668,205	△30.21
	香港	香港先物取引所	HANG SENG	買建	35	香港ドル	38,893,910.01	39,107,250	422,358,300	12.53
	シンガポール	シンガポール取引所	MSCI SING	買建	172	シンガポールドル	12,566,736.05	12,628,240	803,534,911	23.83
	オランダ	アムステルダム取引所	AEX	買建	282	ユーロ	18,885,217	18,950,400	2,164,893,697	64.21
	スペイン	スペイン金融先物取引所（マドリード）	IBEX 35	売建	90	ユーロ	9,662,252.5	9,402,750	1,074,170,160	△31.86
	その他	Marche des Options Negociables de Paris	CAC40	売建	87	ユーロ	3,284,954.7	3,251,190	371,415,945	△11.02
債券先物取引	日本	東京証券取引所	東証長期国債標準物先物	買建	7,000,000,000	日本円	9,893,768,000	10,039,400,000	10,039,400,000	297.75
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1012	買建	107	米ドル	13,293,255.21	13,498,718.75	1,131,462,605	33.56
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1012	売建	217	カナダドル	27,190,944.95	27,435,310	2,227,198,465	△66.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1012	買建	83	ユーロ	10,883,156.87	10,940,230	1,249,811,875	37.07
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1012	売建	330	オーストラリアドル	35,375,719.79	35,384,266.5	2,882,048,507	△85.48
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1012	売建	114	英ポンド	14,157,128.52	14,216,940	1,886,161,429	△55.94

（注１）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率をいいます。

（注２）評価額は、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

（３）運用実績

① 純資産の推移

2010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末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額（百万円）（分配落）	純資産総額（百万円）（分配付）	１口当たり純資産額（円）（分配落）	１口当たり純資産額（円）（分配付）
１期	(2002年３月25日)	12,192	12,218	0.9722	0.9742
２期	(2003年３月25日)	10,487	10,509	0.9356	0.9376
３期	(2004年３月25日)	6,272	6,363	1.0300	1.0450
４期	(2005年３月25日)	4,725	4,748	1.0163	1.0213
５期	(2006年３月27日)	3,767	3,820	1.0743	1.0893
６期	(2007年３月26日)	3,024	3,038	1.0522	1.0572
７期	(2008年３月25日)	2,381	2,391	0.9774	0.9814
８期	(2009年３月25日)	1,953	1,958	0.8739	0.8759
９期	(2010年３月25日)	1,966	1,969	0.9615	0.9630
	2009年９月末日	2,048	－	0.9397	－
	2009年10月末日	2,012	－	0.9411	－
	2009年11月末日	2,004	－	0.9396	－
	2009年12月末日	2,005	－	0.9574	－
	2010年１月末日	1,974	－	0.9489	－
	2010年２月末日	1,964	－	0.9518	－
	2010年３月末日	1,972	－	0.9631	－
	2010年４月末日	1,951	－	0.9664	－
	2010年５月末日	1,863	－	0.9448	－
	2010年６月末日	1,842	－	0.9394	－
	2010年７月末日	1,853	－	0.9546	－
	2010年８月末日	1,826	－	0.9495	－
	2010年９月末日	1,864	－	0.9764	－

（注）表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

② 分配の推移

期	計算期間	１口当たりの分配金（円）
第１期	自 2001年３月26日 至 2002年３月25日	0.0020
第２期	自 2002年３月26日 至 2003年３月25日	0.0020
第３期	自 2003年３月26日 至 2004年３月25日	0.0150
第４期	自 2004年３月26日 至 2005年３月25日	0.0050
第５期	自 2005年３月26日 至 2006年３月27日	0.0150
第６期	自 2006年３月28日 至 2007年３月26日	0.0050
第７期	自 2007年３月27日 至 2008年３月25日	0.0040
第８期	自 2008年３月26日 至 2009年３月25日	0.0020
第９期	自 2009年３月26日 至 2010年３月25日	0.0015

③ 収益率の推移

期	計算期間	収益率（％）
第１期	自 2001年３月26日 至 2002年３月25日	△2.6
第２期	自 2002年３月26日 至 2003年３月25日	△3.6
第３期	自 2003年３月26日 至 2004年３月25日	11.7
第４期	自 2004年３月26日 至 2005年３月25日	△0.8
第５期	自 2005年３月26日 至 2006年３月27日	7.2
第６期	自 2006年３月28日 至 2007年３月26日	△1.6
第７期	自 2007年３月27日 至 2008年３月25日	△6.7
第８期	自 2008年３月26日 至 2009年３月25日	△10.4
第９期	自 2009年３月26日 至 2010年３月25日	10.2
第10期 （中間期）	自 2010年３月26日 至 2010年９月25日	1.0

第２【財務ハイライト情報】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第２ 財務ハイライト情報」については、下記事項のうち当中間計算期間に係わる事項のみ追加されます。

＜追加＞

中間財務諸表

【ダ・ヴィンチ ライト】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	18,164,448	17,947,372
コール・ローン	412,775,397	436,744,731
特殊債券	1,271,406,254	1,182,807,171
親投資信託受益証券	198,791,687	176,778,340
派生商品評価勘定	71,840,685	25,983,272
未収利息	1,445	1,294
差入委託証拠金	82,158,946	36,969,670
流動資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850
資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,257,390	2,309,674
未払解約金	965,789	11,219,776
未払受託者報酬	744,729	692,956
未払委託者報酬	9,575,018	8,909,391
その他未払費用	506,351	471,145
流動負債合計	13,049,277	23,602,942
負債合計	13,049,277	23,602,942
純資産の部		
元本等		
元本	2,180,582,523	1,908,524,795
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△138,492,938	△54,895,887
（分配準備積立金）	229,938,290	191,804,327
元本等合計	2,042,089,585	1,853,628,908
純資産合計	2,042,089,585	1,853,628,908
負債純資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 自 2009年３月26日 至 2009年９月25日	第10期中間計算期間 自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
営業収益		
受取利息	1,590,614	1,220,069
有価証券売買等損益	16,813,889	13,677,836
派生商品取引等損益	135,827,476	17,337,634
為替差損益	△5,238,898	△4,076,370
その他収益	740,766	635,625
営業収益合計	149,733,847	28,794,794
営業費用		
受託者報酬	744,729	692,956
委託者報酬	9,575,018	8,909,391
その他費用	620,008	1,586,360
営業費用合計	10,939,755	11,188,707
営業利益	138,794,092	17,606,087
経常利益	138,794,092	17,606,087
中間純利益	138,794,092	17,606,087
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,914,961	△1,309,321
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△281,823,811	△78,720,163
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,238,439	7,128,440
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,238,439	7,128,440
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,786,697	2,219,572
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,786,697	2,219,572
分配金	―	―
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△138,492,938	△54,895,887

次へ

(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	第９期中間計算期間 自 2009年３月26日 至 2009年９月25日	第10期中間計算期間 自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 特殊債券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 (2) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	(1) 特殊債券 同左 (2) 親投資信託受益証券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。	外貨建取引等の処理基準 同左

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
１．元本の推移		
期首元本額	2,235,633,665円	2,045,390,638円
期中追加設定元本額	58,193,357円	48,008,319円
期中一部解約元本額	113,244,499円	184,874,162円
２．中間計算期間末日における受益権の総数	2,180,582,523口	1,908,524,795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138,492,938円であります。	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54,895,887円であります。

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（1）株式関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引								
	買建	502,558,953	－	506,555,645	3,996,692	495,469,687	－	499,429,728	3,960,041
合計		502,558,953	－	506,555,645	3,996,692	495,469,687	－	499,429,728	3,960,041

（2）債券関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引								
	買建	433,601,201	－	434,704,204	1,103,003	429,625,306	－	431,600,863	1,975,557
合計		433,601,201	－	434,704,204	1,103,003	429,625,306	－	431,600,863	1,975,557

(3) 通貨関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,336,543,600	－	1,271,060,000	65,483,600	1,200,038,000	－	1,182,300,000	17,738,000
合計		1,336,543,600	－	1,271,060,000	65,483,600	1,200,038,000	－	1,182,300,000	17,738,000

(注) 時価の算定方法

・先物取引

１．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

２．中間計算期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

１．中間計算期間末日に対顧客先物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。

(1) 中間計算期間末日において予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 中間計算期間末日において当該日の対顧客先物相場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。

① 中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

② 中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

２．中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値により評価しております。

(１口当たり情報)

区分	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
１口当たり純資産額	0.9365円	0.9712円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GS GTAA 戦略マザーファンド」受益証券を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、すべて同投資信託の受益証券です。

なお、同投資信託の状況は以下の通りです。

「GS GTAA 戦略マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記番号	(2009年９月25日現在)	(2010年９月25日現在)
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		32,347,680	31,346,043
コール・ローン		396,826,078	758,702,381
特殊債券	※１	3,015,049,117	2,458,549,191
派生商品評価勘定		358,975,304	582,263,115
未収利息		1,388	2,248
差入委託証拠金		264,117,039	―
流動資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978
資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		140,781,453	195,297,128
前受金		―	171,364,324
未払解約金		26,000,000	101,027,965
流動負債合計		166,781,453	467,689,417
負債合計		166,781,453	467,689,417
純資産の部			
元本等			
元本		2,864,930,748	2,133,576,547
剰余金			
剰余金		1,035,604,405	1,229,597,014
剰余金合計		1,035,604,405	1,229,597,014
元本等合計		3,900,535,153	3,363,173,561
純資産合計		3,900,535,153	3,363,173,561
負債・純資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978

(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 2009年３月26日 至 2009年９月25日	自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	特殊債券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

<table>
<tr><th>区分</th><th>(2009年９月25日現在)</th><th>(2010年９月25日現在)</th></tr>
<tr><td>１．元本の推移</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>期首元本額</td><td>3,149,971,232円</td><td>2,452,926,081円</td></tr>
<tr><td>期中追加設定元本額</td><td>244,291,631円</td><td>218,468,844円</td></tr>
<tr><td>期中一部解約元本額</td><td>529,332,115円</td><td>537,818,378円</td></tr>
<tr><td>元本の内訳</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>ダ・ヴィンチ ライト</td><td>146,009,319円</td><td>112,147,650円</td></tr>
<tr><td>GS GTAA(アグレッシブ L/S)</td><td>152,046,592円</td><td>57,821,690円</td></tr>
<tr><td>グローバル L/S M</td><td>116,917,989円</td><td>61,846,746円</td></tr>
<tr><td>グローバル L/S M(適格機関投資家用)</td><td>1,247,011,543円</td><td>1,086,243,041円</td></tr>
<tr><td>GS GT L/S ファンド(適格機関投資家用)</td><td>188,405,403円</td><td>167,377,866円</td></tr>
<tr><td>ゴールドマン・サックス GTAAファンド
(適格機関投資家専用)</td><td>1,014,539,902円</td><td>648,139,554円</td></tr>
<tr><td>合計</td><td>2,864,930,748円</td><td>2,133,576,547円</td></tr>
<tr><td>２．差入委託証拠金代用有価証券(※１)</td><td>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下のとおり差入を行なっております。
<table><tr><th>担保資産</th><th>金額</th></tr><tr><td>特殊債券</td><td>1,307,732,147円</td></tr><tr><td>合計</td><td>1,307,732,147円</td></tr></table></td><td>先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下のとおり差入を行なっております。
<table><tr><th>担保資産</th><th>金額</th></tr><tr><td>特殊債券</td><td>1,605,238,303円</td></tr><tr><td>合計</td><td>1,605,238,303円</td></tr></table></td></tr>
<tr><td>３．計算期間末日における受益権の総数</td><td>2,864,930,748口</td><td>2,133,576,547口</td></tr>
</table>

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（1）株式関連

区分	種類	（2009年９月25日現在）				（2010年９月25日現在）			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引								
	買建	8,070,535,490	―	8,158,093,332	87,557,842	8,196,321,365	―	8,280,866,254	84,544,889
	売建	6,853,100,949	―	6,921,052,315	△67,951,366	6,933,618,700	―	6,892,996,251	40,622,449
合計		14,923,636,439	―	15,079,145,647	19,606,476	15,129,940,065	―	15,173,862,505	125,167,338

（2）債券関連

区分	種類	（2009年９月25日現在）				（2010年９月25日現在）			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引								
	買建	8,230,484,442	―	8,220,702,941	△9,781,501	12,241,020,730	―	12,363,541,625	122,520,895
	売建	12,797,148,896	―	12,818,485,475	△21,336,579	6,930,748,810	―	6,924,487,171	6,261,639
合計		21,027,633,338	―	21,039,188,416	△31,118,080	19,171,769,540	―	19,288,028,796	128,782,534

(3) 通貨関連

区分	種類	(2009年９月25日現在)				(2010年９月25日現在)			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	米ドル	—	—	—	—	393,357,300	—	388,286,000	△5,071,300
	カナダドル	119,424,984	—	116,382,000	△3,042,984	651,240,000	—	659,826,000	8,586,000
	ユーロ	67,187,300	—	66,360,000	△827,300	402,451,000	—	421,237,500	18,786,500
	英ポンド	37,172,682	—	36,135,000	△1,037,682	1,688,840,250	—	1,710,337,500	21,497,250
	スイスフラン	55,523,262	—	55,018,750	△504,512	53,119,375	—	53,500,000	380,625
	スウェーデンクローナ	26,655,800	—	26,120,000	△535,800	2,842,920,000	—	2,996,280,000	153,360,000
	ノルウェークローネ	703,278,360	—	712,540,000	9,261,640	81,013,800	—	84,540,000	3,526,200
	オーストラリアドル	826,683,400	—	823,514,000	△3,169,400	39,989,500	—	39,615,000	△374,500
	ニュージーランドドル	2,600,884,660	—	2,615,789,000	14,904,340	368,815,500	—	366,420,000	△2,395,500
	シンガポールドル	2,313,180,000	—	2,313,542,000	362,000	—	—	—	—
	売建								
	米ドル	3,169,517,680	—	3,014,228,000	155,289,680	3,189,676,940	—	3,158,098,000	31,578,940
	カナダドル	2,067,408,000	—	2,036,685,000	30,723,000	374,024,500	—	366,570,000	7,454,500
	ユーロ	1,110,818,125	—	1,111,530,000	△711,875	13,991,750	—	14,041,250	△49,500
	英ポンド	720,100,000	—	686,565,000	33,535,000	57,938,125	—	57,837,500	100,625
	スイスフラン	996,632,000	—	1,001,341,250	△4,709,250	1,533,246,875	—	1,572,900,000	△39,653,125
	スウェーデンクローナ	337,740,000	—	339,560,000	△1,820,000	97,808,800	—	97,440,000	368,800
	ノルウェークローネ	31,032,500	—	30,980,000	52,500	475,061,600	—	479,060,000	△3,998,400
	オーストラリアドル	47,202,948	—	46,614,000	588,948	1,049,313,000	—	1,093,374,000	△44,061,000
	ニュージーランドドル	148,062,500	—	147,821,000	241,500	886,816,000	—	903,836,000	△17,020,000
	シンガポールドル	135,316,650	—	134,211,000	1,105,650	—	—	—	—
合計		15,513,820,851	—	15,314,936,000	229,705,455	14,199,624,315	—	14,463,198,750	133,016,115

(注) 時価の算定方法

・先物取引

１．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

２．計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

１．計算期間末日に対顧客先物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。

(1) 計算期間末日において予約為替の受渡し日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場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。

① 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

② 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

２．計算期間末日に対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

（１口当たり情報）

区分	(2009年９月25日現在)	(2010年９月25日現在)
１口当たり純資産額	1.3615円	1.5763円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

第三部【ファンドの詳細情報】

第４【ファンドの経理状況】

１ 財務諸表

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第４ ファンドの経理状況 １ 財務諸表」については、下記事項のうち当中間計算期間に関わる事項のみ追加されます。

＜追加＞

(1) 本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及び第57条の２の規定により、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、中間財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 本ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第９期中間計算期間（2009年３月26日から2009年９月25日まで）及び第10期中間計算期間（2010年３月26日から2010年９月25日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【ダ・ヴィンチ ライト】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	18,164,448	17,947,372
コール・ローン	412,775,397	436,744,731
特殊債券	1,271,406,254	1,182,807,171
親投資信託受益証券	198,791,687	176,778,340
派生商品評価勘定	71,840,685	25,983,272
未収利息	1,445	1,294
差入委託証拠金	82,158,946	36,969,670
流動資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850
資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,257,390	2,309,674
未払解約金	965,789	11,219,776
未払受託者報酬	744,729	692,956
未払委託者報酬	9,575,018	8,909,391
その他未払費用	506,351	471,145
流動負債合計	13,049,277	23,602,942
負債合計	13,049,277	23,602,942
純資産の部		
元本等		
元本	2,180,582,523	1,908,524,795
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△138,492,938	△54,895,887
（分配準備積立金）	229,938,290	191,804,327
元本等合計	2,042,089,585	1,853,628,908
純資産合計	2,042,089,585	1,853,628,908
負債純資産合計	2,055,138,862	1,877,231,850

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第９期中間計算期間 自 2009年３月26日 至 2009年９月25日	第10期中間計算期間 自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
営業収益		
受取利息	1,590,614	1,220,069
有価証券売買等損益	16,813,889	13,677,836
派生商品取引等損益	135,827,476	17,337,634
為替差損益	△5,238,898	△4,076,370
その他収益	740,766	635,625
営業収益合計	149,733,847	28,794,794
営業費用		
受託者報酬	744,729	692,956
委託者報酬	9,575,018	8,909,391
その他費用	620,008	1,586,360
営業費用合計	10,939,755	11,188,707
営業利益	138,794,092	17,606,087
経常利益	138,794,092	17,606,087
中間純利益	138,794,092	17,606,087
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	3,914,961	△1,309,321
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△281,823,811	△78,720,163
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,238,439	7,128,440
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,238,439	7,128,440
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,786,697	2,219,572
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,786,697	2,219,572
分配金	―	―
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△138,492,938	△54,895,887

次へ

(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	第９期中間計算期間 自 2009年３月26日 至 2009年９月25日	第10期中間計算期間 自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 特殊債券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。 (2) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	(1) 特殊債券 同左 (2) 親投資信託受益証券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における中間計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。	外貨建取引等の処理基準 同左

（中間貸借対照表に関する注記）

区分	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
１．元本の推移		
期首元本額	2,235,633,665円	2,045,390,638円
期中追加設定元本額	58,193,357円	48,008,319円
期中一部解約元本額	113,244,499円	184,874,162円
２．中間計算期間末日における受益権の総数	2,180,582,523口	1,908,524,795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138,492,938円であります。	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54,895,887円であります。

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（1）株式関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引								
	買建	502,558,953	－	506,555,645	3,996,692	495,469,687	－	499,429,728	3,960,041
合計		502,558,953	－	506,555,645	3,996,692	495,469,687	－	499,429,728	3,960,041

（2）債券関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	債券先物取引								
	買建	433,601,201	－	434,704,204	1,103,003	429,625,306	－	431,600,863	1,975,557
合計		433,601,201	－	434,704,204	1,103,003	429,625,306	－	431,600,863	1,975,557

(3) 通貨関連

区分	種類	第９期中間計算期間（2009年９月25日現在）				第10期中間計算期間（2010年９月25日現在）			
		契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)	うち１年超(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,336,543,600	－	1,271,060,000	65,483,600	1,200,038,000	－	1,182,300,000	17,738,000
合計		1,336,543,600	－	1,271,060,000	65,483,600	1,200,038,000	－	1,182,300,000	17,738,000

(注) 時価の算定方法

・先物取引

１．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

２．中間計算期間末日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

１．中間計算期間末日に対顧客先物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。

(1) 中間計算期間末日において予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 中間計算期間末日において当該日の対顧客先物相場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。

① 中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

② 中間計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

２．中間計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、中間計算期間末日の対顧客相場の仲値により評価しております。

(１口当たり情報)

区分	第９期中間計算期間 (2009年９月25日現在)	第10期中間計算期間 (2010年９月25日現在)
１口当たり純資産額	0.9365円	0.9712円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GS GTAA 戦略マザーファンド」受益証券を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、すべて同投資信託の受益証券です。

なお、同投資信託の状況は以下の通りです。

「GS GTAA 戦略マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記番号	(2009年９月25日現在)	(2010年９月25日現在)
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		32,347,680	31,346,043
コール・ローン		396,826,078	758,702,381
特殊債券	※１	3,015,049,117	2,458,549,191
派生商品評価勘定		358,975,304	582,263,115
未収利息		1,388	2,248
差入委託証拠金		264,117,039	―
流動資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978
資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		140,781,453	195,297,128
前受金		―	171,364,324
未払解約金		26,000,000	101,027,965
流動負債合計		166,781,453	467,689,417
負債合計		166,781,453	467,689,417
純資産の部			
元本等			
元本		2,864,930,748	2,133,576,547
剰余金			
剰余金		1,035,604,405	1,229,597,014
剰余金合計		1,035,604,405	1,229,597,014
元本等合計		3,900,535,153	3,363,173,561
純資産合計		3,900,535,153	3,363,173,561
負債・純資産合計		4,067,316,606	3,830,862,978

(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 2009年３月26日 至 2009年９月25日	自 2010年３月26日 至 2010年９月25日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	特殊債券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	特殊債券 同左
２．デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
３．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 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。	外貨建取引等の処理基準 同左

（貸借対照表に関する注記）

区分	(2009年９月25日現在)	(2010年９月25日現在)
１．元本の推移		
期首元本額	3,149,971,232円	2,452,926,081円
期中追加設定元本額	244,291,631円	218,468,844円
期中一部解約元本額	529,332,115円	537,818,378円
元本の内訳		
ダ・ヴィンチ ライト	146,009,319円	112,147,650円
GS GTAA(アグレッシブ L/S)	152,046,592円	57,821,690円
グローバル L/S M	116,917,989円	61,846,746円
グローバル L/S M(適格機関投資家用)	1,247,011,543円	1,086,243,041円
GS GT L/S ファンド(適格機関投資家用)	188,405,403円	167,377,866円
ゴールドマン・サックス GTAAファンド(適格機関投資家専用)	1,014,539,902円	648,139,554円
合計	2,864,930,748円	2,133,576,547円
２．差入委託証拠金代用有価証券(※１)	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下のとおり差入を行なっております。 担保資産：特殊債券 金額：1,307,732,147円 合計：1,307,732,147円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として、以下のとおり差入を行なっております。 担保資産：特殊債券 金額：1,605,238,303円 合計：1,605,238,303円
３．計算期間末日における受益権の総数	2,864,930,748口	2,133,576,547口

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

（1）株式関連

区分	種類	（2009年９月25日現在）				（2010年９月25日現在）			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引								
	買建	8,070,535,490	―	8,158,093,332	87,557,842	8,196,321,365	―	8,280,866,254	84,544,889
	売建	6,853,100,949	―	6,921,052,315	△67,951,366	6,933,618,700	―	6,892,996,251	40,622,449
合計		14,923,636,439	―	15,079,145,647	19,606,476	15,129,940,065	―	15,173,862,505	125,167,338

（2）債券関連

区分	種類	（2009年９月25日現在）				（2010年９月25日現在）			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	債券先物取引								
	買建	8,230,484,442	―	8,220,702,941	△9,781,501	12,241,020,730	―	12,363,541,625	122,520,895
	売建	12,797,148,896	―	12,818,485,475	△21,336,579	6,930,748,810	―	6,924,487,171	6,261,639
合計		21,027,633,338	―	21,039,188,416	△31,118,080	19,171,769,540	―	19,288,028,796	128,782,534

(3) 通貨関連

区分	種類	(2009年９月25日現在)				(2010年９月25日現在)			
		契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち１年超（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引	為替予約取引								
	買建								
	米ドル	—	—	—	—	393,357,300	—	388,286,000	△5,071,300
	カナダドル	119,424,984	—	116,382,000	△3,042,984	651,240,000	—	659,826,000	8,586,000
	ユーロ	67,187,300	—	66,360,000	△827,300	402,451,000	—	421,237,500	18,786,500
	英ポンド	37,172,682	—	36,135,000	△1,037,682	1,688,840,250	—	1,710,337,500	21,497,250
	スイスフラン	55,523,262	—	55,018,750	△504,512	53,119,375	—	53,500,000	380,625
	スウェーデンクローナ	26,655,800	—	26,120,000	△535,800	2,842,920,000	—	2,996,280,000	153,360,000
	ノルウェークローネ	703,278,360	—	712,540,000	9,261,640	81,013,800	—	84,540,000	3,526,200
	オーストラリアドル	826,683,400	—	823,514,000	△3,169,400	39,989,500	—	39,615,000	△374,500
	ニュージーランドドル	2,600,884,660	—	2,615,789,000	14,904,340	368,815,500	—	366,420,000	△2,395,500
	シンガポールドル	2,313,180,000	—	2,313,542,000	362,000	—	—	—	—
	売建								
	米ドル	3,169,517,680	—	3,014,228,000	155,289,680	3,189,676,940	—	3,158,098,000	31,578,940
	カナダドル	2,067,408,000	—	2,036,685,000	30,723,000	374,024,500	—	366,570,000	7,454,500
	ユーロ	1,110,818,125	—	1,111,530,000	△711,875	13,991,750	—	14,041,250	△49,500
	英ポンド	720,100,000	—	686,565,000	33,535,000	57,938,125	—	57,837,500	100,625
	スイスフラン	996,632,000	—	1,001,341,250	△4,709,250	1,533,246,875	—	1,572,900,000	△39,653,125
	スウェーデンクローナ	337,740,000	—	339,560,000	△1,820,000	97,808,800	—	97,440,000	368,800
	ノルウェークローネ	31,032,500	—	30,980,000	52,500	475,061,600	—	479,060,000	△3,998,400
	オーストラリアドル	47,202,948	—	46,614,000	588,948	1,049,313,000	—	1,093,374,000	△44,061,000
	ニュージーランドドル	148,062,500	—	147,821,000	241,500	886,816,000	—	903,836,000	△17,020,000
	シンガポールドル	135,316,650	—	134,211,000	1,105,650	—	—	—	—
合計		15,513,820,851	—	15,314,936,000	229,705,455	14,199,624,315	—	14,463,198,750	133,016,115

(注) 時価の算定方法

・先物取引

１．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

２．計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。２つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

・為替予約取引

１．計算期間末日に対顧客先物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。

(1) 計算期間末日において予約為替の受渡し日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。

(2) 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場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。

① 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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対顧客先物相場の仲値をもとに算出したレートにより評価しております。

② 計算期間末日に当該日を超える対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

２．計算期間末日に対顧客先物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相場の仲値により評価しております。

（１口当たり情報）

区分	(2009年９月25日現在)	(2010年９月25日現在)
１口当たり純資産額	1.3615円	1.5763円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

２ ファンドの現況

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第４ ファンドの経理状況 ２ ファンドの現況」については、以下の内容に更新されます。

＜訂正・更新後＞

純資産額計算書

（2010年９月30日現在）

Ⅰ 資産総額	1,867,360,667円
Ⅱ 負債総額	2,516,873円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,864,843,794円
Ⅳ 発行済口数	1,909,845,045口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9764円

参考情報

＜ＧＳ ＧＴＡＡ戦略マザーファンド＞

純資産額計算書

（2010年９月30日現在）

Ⅰ 資産総額	3,665,433,651円
Ⅱ 負債総額	293,640,456円
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,371,793,195円
Ⅳ 発行済口数	2,103,476,787口
Ⅴ １口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6030円

第５【設定及び解約の実績】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第５ 設定及び解約の実績」については、以下の内容に更新されます。

＜訂正・更新後＞

下記計算期間中の設定及び解約の実績ならびに当該計算期末の発行済み口数は次の通りです。

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第１期	自 2001年３月26日 至 2002年３月25日	18,894,811,658 (0)	6,353,550,961 (0)	12,541,260,697 (0)
第２期	自 2002年３月26日 至 2003年３月25日	1,727,394,909 (0)	3,059,134,334 (0)	11,209,521,272 (0)
第３期	自 2003年３月26日 至 2004年３月25日	599,502,169 (0)	5,719,684,452 (0)	6,089,338,989 (0)
第４期	自 2004年３月26日 至 2005年３月25日	448,346,586 (0)	1,888,496,571 (0)	4,649,189,004 (0)
第５期	自 2005年３月26日 至 2006年３月27日	465,798,639 (0)	1,607,813,845 (0)	3,507,173,798 (0)
第６期	自 2006年３月28日 至 2007年３月26日	289,542,538 (0)	922,497,726 (0)	2,874,218,610 (0)
第７期	自 2007年３月27日 至 2008年３月25日	170,020,234 (0)	607,819,987 (0)	2,436,418,857 (0)
第８期	自 2008年３月26日 至 2009年３月25日	144,373,754 (0)	345,158,946 (0)	2,235,633,665 (0)
第９期	自 2009年３月26日 至 2010年３月25日	107,986,067 (0)	298,229,094 (0)	2,045,390,638 (0)
第10期 （中間期）	自 2010年３月26日 至 2010年９月25日	48,008,319 (0)	184,874,162 (0)	1,908,524,795 (0)

（注１）（ ）内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。
（注２）設定口数には当初募集期間中の設定口数を含みます。

第四部【特別情報】

第１【委託会社等の概況】

２ 事業の内容及び営業の概況

原届出書の「第四部 特別情報 第１ 委託会社等の概況 ２ 事業の内容及び営業の概況」については、下記の内容に更新されます。

＜訂正・更新後＞

① 事業の内容

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会社は、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投資運用業務および投資助言業務を行っています。また、金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務を行っています。

② 委託会社の運用するファンド

2010年10月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（親投資信託を除きます。）。

種類	本数	純資産総額（円）
追加型株式投資信託	97	1,359,721,323,421
合計	97	1,359,721,323,421

次へ

３ 委託会社等の経理状況

原届出書の「第四部 特別情報 第１ 委託会社等の概況 ３ 委託会社等の経理状況」については、下記の内容に更新されます。

＜訂正・更新後＞

１．財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「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」という。）並びに同規則第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年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

２．監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第14期事業年度（平成20年４月１日から平成21年３月31日まで）及び第15期事業年度（平成21年４月１日から平成22年３月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

（１）貸借対照表

期別		第14期 （平成21年３月31日現在）			第15期 （平成22年３月31日現在）		
資産の部							
科目	注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動資産							
現金・預金			10,011,133			18,045,296	
有価証券			5,000,000			―	
支払委託金			25			25	
収益分配金		25			25		
前払費用			63,907			23,056	
前払金			178,141			―	
未収委託者報酬			1,238,764			1,299,989	
未収運用受託報酬			602,757			1,029,794	
未収収益	＊１		90,537			216,482	
未収還付法人税等			1,166,190			―	
未収消費税等			144,192			―	
立替金	＊１		177,919			119,660	
繰延税金資産			209,183			628,311	
流動資産計			18,882,753	87.7		21,362,618	88.8
固定資産							
無形固定資産			191,869			133,885	
ソフトウェア		191,175			133,190		
その他の無形固定資産		694			694		
投資その他の資産			2,445,678			2,549,148	
投資有価証券		1,184,859			1,080,100		
繰延税金資産		1,254,574			1,457,997		
その他の投資等		6,245			11,050		
固定資産計			2,637,548	12.3		2,683,034	11.2
資産合計			21,520,301	100.0		24,045,652	100.0

期別		第14期 （平成21年３月31日現在）			第15期 （平成22年３月31日現在）		
負債の部							
科目	注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動負債							
預り金			2,843			376	
未払金			480,304			543,981	
未払収益分配金		73			99		
未払償還金		72			72		
未払手数料		480,159			543,810		
未払費用	＊１		1,526,624			2,117,352	
前受収益			958			－	
役員賞与引当金			15,617			18,623	
未払法人税等			－			889,617	
未払消費税等			－			64,891	
流動負債計			2,026,349	9.4		3,634,842	15.1
固定負債							
長期未払費用	＊１		2,269,841			3,004,509	
役員退職慰労引当金			774,132			875,845	
その他固定負債			650			6,843	
固定負債計			3,044,624	14.2		3,887,197	16.2
特別法上の準備金							
金融商品取引責任準備金			0			0	
特別法上の準備金計			0	0.0		0	0.0
負債合計			5,070,974	23.6		7,522,041	31.3

期別		第14期 （平成21年３月31日現在）			第15期 （平成22年３月31日現在）		
純資産の部							
科目	注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
株主資本							
資本金			490,000			490,000	
資本剰余金			390,000			390,000	
資本準備金		390,000			390,000		
利益剰余金			15,550,494			15,600,864	
その他利益剰余金		15,550,494			15,600,864		
繰越利益剰余金		15,550,494			15,600,864		
株主資本合計			16,430,494	76.3		16,480,864	68.5
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		18,832			42,747		
評価・換算差額等合計			18,832	0.1		42,747	0.2
純資産合計			16,449,327	76.4		16,523,611	68.7
負債・純資産合計			21,520,301	100.0		24,045,652	100.0

（２）損益計算書

期別				第14期 自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日			第15期 自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日		
科目			注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
経常損益の部	営業損益の部	営業収益		千円	千円	%	千円	千円	%
		委託者報酬			13,274,586			11,932,945	
		運用受託報酬	＊２		4,433,223			5,861,079	
		その他営業収益	＊２		1,221,154			2,767,961	
		営業収益計			18,928,964	100.0		20,561,986	100.0
		営業費用							
		支払手数料			6,269,299			5,839,252	
		広告宣伝費			201,682			48,305	
		調査費			1,550,486			3,125,052	
		調査費		1			2		
		委託調査費	＊２	1,550,484			3,125,049		
		委託計算費			262,581			234,639	
		営業雑経費			667,778			454,971	
		通信費		264,744			194,331		
		印刷費		368,837			235,354		
		協会費		34,196			25,285		
		営業費用計			8,951,829	47.3		9,702,221	47.2
		一般管理費							
		給料			4,654,254			7,513,406	
		役員報酬		18,004			321,315		
		給料・手当		2,666,694			2,324,836		
		賞与		317,205			1,453,569		
		株式従業員報酬	＊1,2	334,490			807,365		
		その他の報酬		1,317,859			2,606,320		
		交際費			34,974			37,321	
		寄付金			21,140			11,957	
		旅費交通費			175,670			169,402	
		租税公課			37,041			45,811	
		不動産賃借料			476,823			429,868	
		退職給付費用			107,546			895,133	
		役員退職慰労引当金繰入額			－			111,599	
		役員賞与引当金繰入額			－			92,128	
		固定資産減価償却費			58,959			58,772	
		事務委託費			379,680			305,372	
		諸経費			570,468			425,057	
		一般管理費計			6,516,558	34.4		10,095,832	49.1
	営業利益				3,460,576	18.3		763,933	3.7

期別				第14期 自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日			第15期 自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日		
科目			注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
経常損益の部	営業外損益の部	営業外収益							
		為替差益			―			29,994	
		受取利息			74,722			38,635	
		投資有価証券売却益			―			60,336	
		株式従業員報酬	＊1,2		758,109			―	
		役員退職慰労引当金戻入益			107,770			―	
		役員賞与引当金戻入益			630			―	
		雑益			100			500	
		営業外収益計			941,333	5.0		129,466	0.6
		営業外費用							
		支払利息	＊２		35,664			70	
		株式従業員報酬	＊1,2		―			558,478	
		為替差損			85,114			―	
		投資有価証券売却損			406,355			―	
		雑損			2			7	
		営業外費用計			527,136	2.8		558,555	2.7
経常利益					3,874,773	20.5		334,843	1.6

期別			第14期 自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日			第15期 自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日		
科目		注記番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
特別損益の部	特別利益							
	過年度株式従業員報酬修正益			―			112,791	
	特別利益計			―	0.0		112,791	0.5
	特別損失							
	投資有価証券評価減			189,050			―	
	金融商品取引責任準備金繰入額			0			―	
	特別損失計			189,051	1.0		―	0.0
税引前当期純利益				3,685,721	19.5		447,635	2.2
法人税、住民税及び事業税				356,586	1.9		1,036,224	5.0
法人税等調整額				1,025,538	5.4		△638,958	△3.1
当期純利益				2,303,596	12.2		50,369	0.2

（３）株主資本等変動計算書

第14期
（自平成20年４月１日 至平成21年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
				繰越利益剰余金					
平成20年３月31日残高	490,000	390,000	390,000	13,246,898	13,246,898	14,126,898	△54,814	△54,814	14,072,083
事業年度中の変動額									
当期純利益				2,303,596	2,303,596	2,303,596			2,303,596
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）						－	73,646	73,646	73,646
事業年度中の変動額合計	－	－	－	2,303,596	2,303,596	2,303,596	73,646	73,646	2,377,243
平成21年３月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,550,494	15,550,494	16,430,494	18,832	18,832	16,449,327

第15期
（自平成21年４月１日 至平成22年３月31日）

（単位：千円）

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金	利益剰余金合計				
				繰越利益剰余金					
平成21年３月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,550,494	15,550,494	16,430,494	18,832	18,832	16,449,327
事業年度中の変動額									
当期純利益				50,369	50,369	50,369			50,369
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）						－	23,915	23,915	23,915
事業年度中の変動額合計	－	－	－	50,369	50,369	50,369	23,915	23,915	74,284
平成22年３月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,600,864	15,600,864	16,480,864	42,747	42,747	16,523,611

重要な会計方針

区分	第14期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
１．有価証券の評価基準及び評価方法	その他有価証券 時価のあるもの 時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。 時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。	その他有価証券 同左
２．固定資産の減価償却の方法	無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（５年）に基づく定額法により償却しております。	無形固定資産 同左
３．引当金の計上基準	(1) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。 (3) 貸倒引当金 貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (4) 金融商品取引責任準備金 金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の５第１項に基づく責任準備金を計上しております。	(1) 役員賞与引当金 同左 (2) 役員退職慰労引当金 同左 (3) 貸倒引当金 同左 (4) 金融商品取引責任準備金 同左

区分	第14期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第８号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。 (2) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。	(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 同左 (2) 消費税等の会計処理 同左

注記事項

（貸借対照表関係）

第14期 （平成21年３月31日現在）	第15期 （平成22年３月31日現在）
＊１　関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には次のものがあります。 流動資産 未収収益　98,024千円 立替金　77,798千円 流動負債 未払費用　217,717千円 固定負債 長期未払費用　86,468千円	＊１　関係会社項目 同左 流動資産 未収収益　156,637千円 立替金　86,046千円 流動負債 未払費用　84,101千円 固定負債 長期未払費用　241,783千円

（損益計算書関係）

第14期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
＊１ 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。	＊１ 株式従業員報酬 同左
＊２ 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。	＊２ 関係会社項目 同左
営業収益 運用受託報酬 1,147,752千円 その他営業収益 1,221,154千円 営業費用 委託調査費 1,550,484千円 株式従業員報酬 10,698千円 営業外収益 株式従業員報酬 221,263千円 営業外費用 支払利息 35,664千円	営業収益 運用受託報酬 275,256千円 その他営業収益 2,755,632千円 営業費用 委託調査費 3,125,049千円 株式従業員報酬 108,229千円 営業外費用 株式従業員報酬 175,228千円

（株主資本等変動計算書関係）

第14期（自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）

１ 発行済株式に関する事項

株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,400	－	－	6,400

第15期（自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）

１ 発行済株式に関する事項

株式の種類	前事業年度末	増加	減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,400	－	－	6,400

（リース取引関係）

第14期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（金融商品に関する注記）

第15期
（自 平成21年４月１日
至 平成22年３月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

① 金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を含む金融商品取引法により金融商品取引業者が行うことができる業務、及びこれに付帯関連する業務を行っております。これらの業務に関連し、当社は、主に現金・預金及び未収委託者報酬といった金融資産を保有しております。なお、当社は、資金運用については短期的な預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定する方針です。

② 金融商品に係るリスク及びその管理体制

金融商品に係るリスクは、信用リスク、市場リスク、流動性リスク等であります。当社は、効率的なリスク管理が極めて重要であると考えており、職務の分掌と経営陣による監督は、当社リスク管理手続の重要な要素であります。

信用リスク

信用リスクとしては主に、当社が保有する預金に係る銀行の信用リスク、及び当社が運用を委託される投資信託から受領する委託者報酬を見越計上することにより発生する未収委託者報酬に関して、運用資産が悪化した場合に回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

当社は、預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時、およびその後継続的に銀行の信用力を評価し、また各銀行に預け入れる金額に上限を設けることにより、預金に係る信用リスクを管理しております。

また、未収委託者報酬に関しては、当社が運用する投資信託から受取る報酬金額を回収できなかったケースは無く、リスクは非常に低いものと考えております。

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の額が予め社内で設定した水準を越える場合、当該通貨の売買を行い、為替リスクを削減しております。

流動性および資金調達リスク

当社は総資産の75%が預金であり、また預金残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成22年３月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	18,045,296	18,045,296	－
未収委託者報酬	1,299,989	1,299,989	－

金融商品の時価の算定方法

上記金融資産については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

金銭債権の償還予定額

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ２年以内	２年超 ３年以内	３年超 ４年以内	４年超 ５年以内	５年超
現金・預金	18,045,296	－	－	－	－	－
未収委託者報酬	1,299,989	－	－	－	－	－

（有価証券関係）

第14期
（自 平成20年４月１日
至 平成21年３月31日）

１．その他有価証券で時価のあるもの

区分	種類	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	1,008,026	1,039,779	31,752
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託受益証券	145,079	145,079	－
合計		1,153,105	1,184,859	31,752

（注）当事業年度において、投資有価証券について、189,050千円減損処理を行っております。

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
1,942,487	10,044	416,399

３．時価評価されていない主な有価証券の内容

	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券	
コマーシャル・ペーパー	5,000,000

４．その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の今後の償還予定額

	１年以内（千円）	１年超５年以内（千円）	５年超10年以内（千円）	10年超（千円）
コマーシャル・ペーパー	5,000,000	－	－	－

第15期
（自 平成21年４月１日
至 平成22年３月31日）

１．その他有価証券で時価のあるもの

区分	種類	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	1,008,026	1,080,100	72,073

２．当事業年度中に売却したその他有価証券

売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
205,415	60,336	－

（デリバティブ取引関係）

第14期（自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期（自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第14期 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）	第15期 （自　平成21年４月１日 至　平成22年３月31日）
１　採用している退職給付制度の概要 当社は、退職給付制度を採用しておりません。 ２　退職給付費用に関する事項 損益計算書上、出向者負担金等に含まれる退職給付費用負担金相当額を、退職給付費用として計上しております。	１　採用している退職給付制度の概要 同左 ２　退職給付費用に関する事項 同左

（税効果会計関係）

第14期 （自 平成20年４月１日 至 平成21年３月31日）	第15期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）
1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳
繰延税金資産（流動資産）	繰延税金資産（流動資産）
未払費用 240,294千円	未払費用 542,061千円
その他 50,980	未払事業税 69,035
小計 291,274	その他 17,214
繰延税金負債（流動負債）	小計 628,311
未収事業税 △82,091	繰延税金負債（流動負債）
小計 △82,091	小計 －
繰延税金資産の純額 209,183	繰延税金資産の純額 628,311
繰延税金資産（固定資産）	繰延税金資産（固定資産）
長期未払費用 827,893	長期未払費用 1,106,725
役員退職慰労引当金 315,022	役員退職慰労引当金 356,410
投資有価証券評価減 76,931	その他 24,188
その他 47,648	小計 1,487,324
小計 1,267,494	繰延税金負債（固定負債）
繰延税金負債（固定負債）	その他有価証券評価差額金 △29,326
その他有価証券評価差額金 △12,920	小計 △29,326
小計 △12,920	繰延税金資産の純額 1,457,997千円
繰延税金資産の純額 1,254,574	
1,463,757千円	
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に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	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に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 40.69 %	法定実効税率 40.69 %
（調整）	（調整）
役員賞与等永久に損金に算入されない項目 △3.12	役員賞与等永久に損金に算入されない項目 49.38
その他 △0.06	その他 △1.33
税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.49 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率 88.75 %
3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 該当事項はありません。	3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 該当事項はありません。
4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響 該当事項はありません。	4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響 該当事項はありません。

（関連当事者との取引）

第14期
（自 平成20年４月１日
至 平成21年３月31日）

親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	アメリカ合衆国ニューヨーク市	25,762百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	―	株式従業員報酬の配賦 資金の援助	営業費用及び一般管理費（注１） 株式従業員報酬（注１） 資金の借入の償還（注２） 利息の支払（注２）	10,698 221,263 5,000,000 35,664	未払費用 長期未払費用 立替金	217,717 86,468 77,798
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国ニューヨーク市	255百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	―	投資助言	運用受託報酬（注３） その他営業収益（注３） 委託調査費の支払（注３）	1,147,752 1,221,154 1,550,484	未収収益	98,024

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）持株会社の株価及び付与された株数に基づき、算出し配賦されております。

（注２）親会社からの資金の借入れについては、市場金利を勘案して決定しており、返済条件は期間２年としておりましたが、2009年１月に期限前返済を行いました。
なお担保は差し入れておりませんでした。

（注３）運用受託報酬、その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき、決定しております。

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第14期
（自 平成20年４月１日
至 平成21年３月31日）

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関係内容		取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616百万円	金融商品取引業	－	－	業務委託 有価証券の購入	支払手数料 兼務従業員の人件費等の支払（注１） 受取利息	282,509 1,201,322 32,240	未払手数料 未払費用 有価証券 前受収益	28,275 73,184 5,000,000 958
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社	東京都港区	100,000千円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託	－	－	従業員出向受入等	出向者に関する人件費等の負担金（注２） 営業費用及び一般管理費 株式従業員報酬	5,125,065 492,472	未払費用 長期未払費用	379,583 2,351,758
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・ＵＳＡ	アメリカ合衆国ユタ州	2百万ドル	銀行業	－	－	現金の預入	受取利息	41,779	現金・預金 未収収益	513,452 305
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・Ⅱリミテッド	ケイマン諸島	10百万ドル	ゴールドマン・サックス・グループ人事業務受託	－	－	従業員出向受入	出向者に関する人件費等の負担金（注２） 営業費用及び一般管理費 株式従業員報酬	△83,053 42,982	未払費用 長期未払費用	239,372 32,982

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）兼務従業員の人件費等の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき、決定しております。

（注２）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社（以下ＧＳＪＨ）または、ゴールドマン・サックス・グローバル・サービスⅡ・リミテッド（以下ＧＳ２Ｌ）より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌより行われております。
但し、これらの費用はＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌに対する債務として処理しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）

第15期
（自 平成21年４月１日
至 平成22年３月31日）

親会社及び法人主要株主等

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	議決権等の所有（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）
親会社	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	アメリカ合衆国ニューヨーク市	6,965百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	株式従業員報酬の配賦	営業費用及び一般管理費（注１）	108,229	未払費用	84,101
									長期未払費用	241,783
							株式従業員報酬（注１）	175,228	立替金	86,046
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国ニューヨーク市	206百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	運用受託報酬（注２）	275,256	未収収益	156,637
							その他営業収益（注２）	2,755,632		
							委託調査費の支払（注２）	3,125,049		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）持株会社の株価及び付与された株数に基づき、算出し配賦されております。

（注２）運用受託報酬、その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第15期
（自 平成21年４月１日
至 平成22年３月31日）

兄弟会社等

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	議決権等の所有（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）
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616百万円	金融商品取引業	－	業務委託役員の兼任	支払手数料	198,634	未払手数料	23,069
							兼務従業員の人件費等の支払（注１）	2,511,001	未払費用	362,141
							有価証券の償還	5,000,000		
							受取利息	958	立替金	1,398
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社	東京都港区	100,000千円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託	－	従業員出向受入等役員の兼任	出向者に関する人件費等の負担金（注２）		未払費用	1,121,537
							営業費用及び一般管理費	6,525,884	立替金	30,417
							株式従業員報酬	361,419	長期未払費用	2,899,556
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・ＵＳＡ	アメリカ合衆国ユタ州	2百万ドル	銀行業	－	現金の預入	受取利息	958	現金・預金	876,973
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・インベストメント・ストラテジー・ＬＬＣ	アメリカ合衆国ニューヨーク州	69百万ドル	投資顧問業	－	投資助言	運用受託報酬（注３）	2,031,894	未収収益	59,844
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・Ⅱリミテッド	ケイマン諸島	21百万ドル	ゴールドマン・サックス・グループ人事業務受託	－	従業員出向受入	出向者に関する人件費等の負担金（注２）		未払費用	136,305
							営業費用及び一般管理費	100,709	長期未払費用	3,202
							株式従業員報酬	19,604		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注１）兼務従業員の人件費等の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき、決定しております。

（注２）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社（以下ＧＳＪＨ）または、ゴールドマン・サックス・グローバル・サービスⅡ・リミテッド（以下ＧＳ２Ｌ）より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌより行われております。
但し、これらの費用はＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはＧＳＪＨ、ＧＳ２Ｌに対する債務として処理しております。

（注３）運用受託報酬に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク（ニューヨーク証券取引所に上場）

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）

（１株当たり情報）

第14期 （自　平成20年４月１日 至　平成21年３月31日）		第15期 （自　平成21年４月１日 至　平成22年３月31日）	
１株当たり純資産額	2,570,207円43銭	１株当たり純資産額	2,581,814円32銭
１株当たり当期純利益金額	359,937円01銭	１株当たり当期純利益金額	7,870円26銭
損益計算書上の当期純利益	2,303,596千円	損益計算書上の当期純利益	50,369千円
１株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	2,303,596千円	１株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	50,369千円
差額	－	差額	－
期中平均株式数		期中平均株式数	
普通株式	6,400株	普通株式	6,400株
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、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載しておりません。		同左	

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成21年10月27日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　大畑 茂

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」に掲げられているダ・ヴィンチ ライトの平成21年３月26日から平成21年９月25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に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、ダ・ヴィンチ ライトの平成21年９月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成21年３月26日から平成21年９月25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。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント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

（注１）上記は、当社が、中間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、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）中間財務諸表の範囲にはＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

次へ

独立監査人の監査報告書

平成21年５月27日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　大畑 茂

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」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成20年４月１日から平成21年３月31日までの第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、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成21年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成22年11月２日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　大畑 茂

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」に掲げられているダ・ヴィンチ ライトの平成22年３月26日から平成22年９月25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に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、ダ・ヴィンチ ライトの平成22年９月25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３月26日から平成22年９月25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。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント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

（注１）上記は、当社が、中間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、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）中間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５月26日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員
業務執行社員　公認会計士　大畑 茂

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」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成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、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成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。

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、その原本は当社が別途保管しております。