

【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28年3月4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 桐谷 重毅

【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 山崎 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】 ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）

【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】 それぞれ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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成27年9月4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

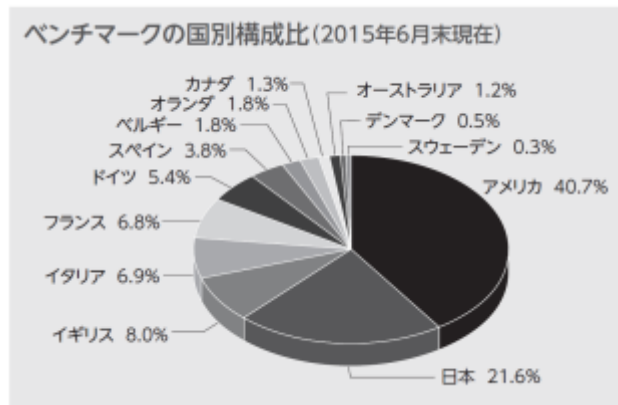
<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドのベンチマーク>

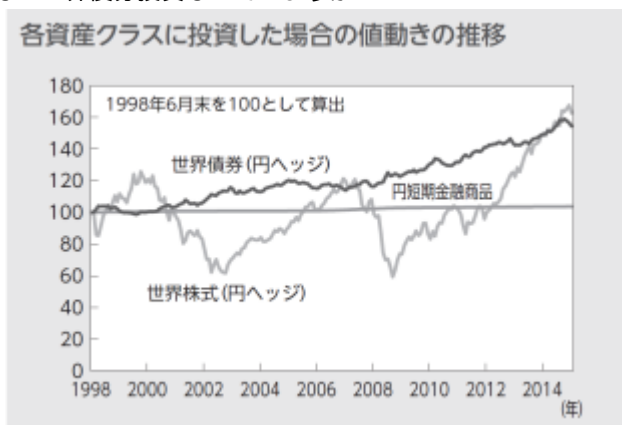
(中略)



(中略)

(中略)

<なぜ世界債券投資なのでしょう？>



(中略)

債券への投資は、短期金融商品（預貯金等）を上回る収益を追求することができます。一方で、値下がりリスクがあり、その価格変動幅は、一般に短期金融商品より大きくなりますが株式への投資と比べ小さくなります。

期間：1998年6月末～2015年6月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガン、MSCI Inc.

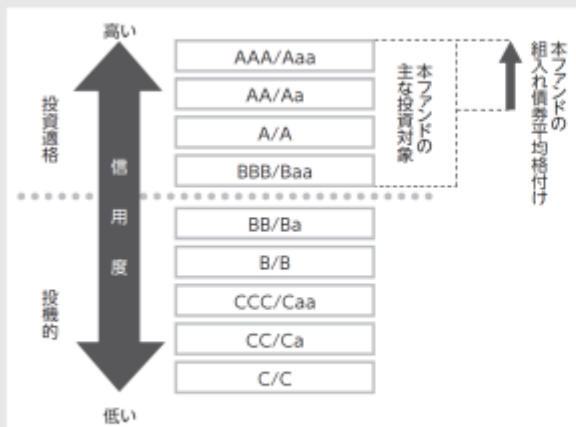
世界株式：MSCIワールド・インデックス（円ヘッジ）

世界債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル、円ヘッジ）

円短期金融商品：1ヵ月円LIBOR

< 高格付け債券への投資 >

投資対象債券の信用格付けの位置付け



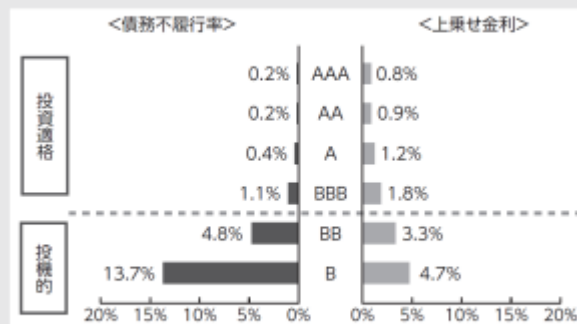
※格付けが公表されていない債券の場合は、委託会社が発行体の財務内容等を分析して適切と判断した格付けとします。

投資する債券の信用格付けについては組入れ時においてトリプルB格(トリプルBマイナス格も含まれます。)相当以上とします。また、原則として、ポートフォリオの平均格付けはダブルA格(ダブルAマイナス格も含まれます。)相当以上に維持するように運用します。投資対象債券の信用格付けを投資適格に限定することで、リターン安定化を目指します。

ポイント

- 債務不履行の可能性を第三者が評価したものが格付けです。債券を購入するにあたって、債券を発行した企業等の元本・利息の支払能力を知る上で重要な情報の一つといえます。
- 格付けは英字の記号で表されます。左図の例では、トリプルAが最も信用度が高い、つまり債務不履行が生じる可能性が最も低いことを表しています。

米国社債の格付け別債務不履行率と利回り格差



※上記は過去のデータであり、将来の債務履行の確実性、将来の利回り水準や米国債との利回り格差(スプレッド)を保証するものではありません。

社債市場では、信用力の高い(格付けが高い)銘柄は、国債に対する上乗せ金利が低くなっていますが、債務不履行が生じる可能性が低く、比較的安定したリターンが期待できます。

< 債務不履行率 >

期間：1981年～2014年

出所：スタンダード＆プアーズ

1981年～2014年の期間について、債務不履行を起こした米国社債の割合を格付け別に算出。なお、該当社債の格付けは、債務不履行時の3年前(各年1月1日時点)の格付けを参照。(2014年12月末現在)

< 上乗せ金利 >

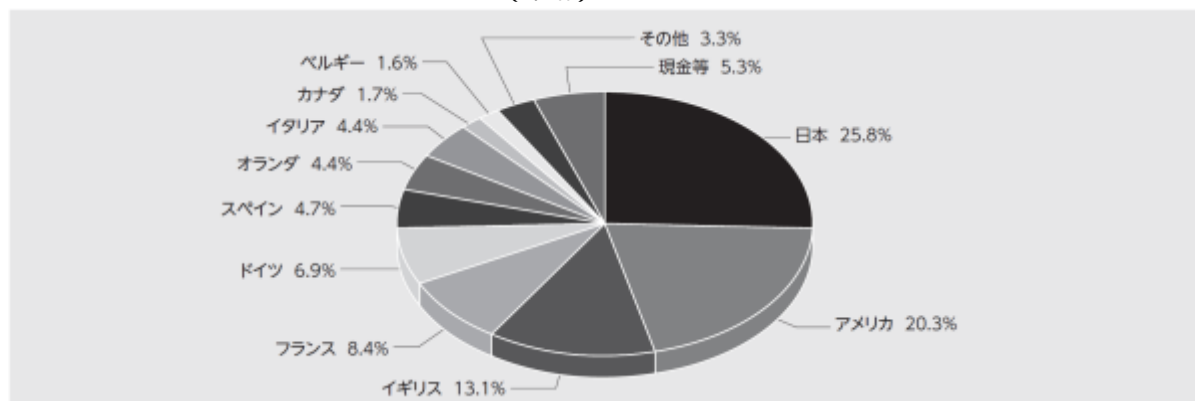
2015年6月末現在 出所：パークレイズ

< Aコース(限定為替ヘッジ)の特徴 >

(中略)

Aコースの債券国別構成比率

(中略)

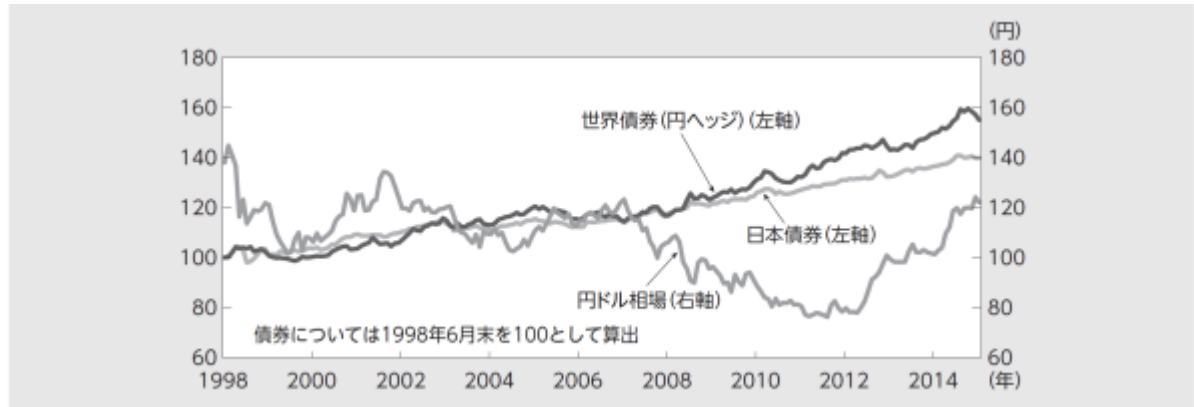


2015年6月末現在

上記はマザーファンドの数値です。また、上記の数値は先物を含みません。

世界債券の値動きの推移と円ドル相場

(中略)



期間：1998年6月末～2015年6月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガン

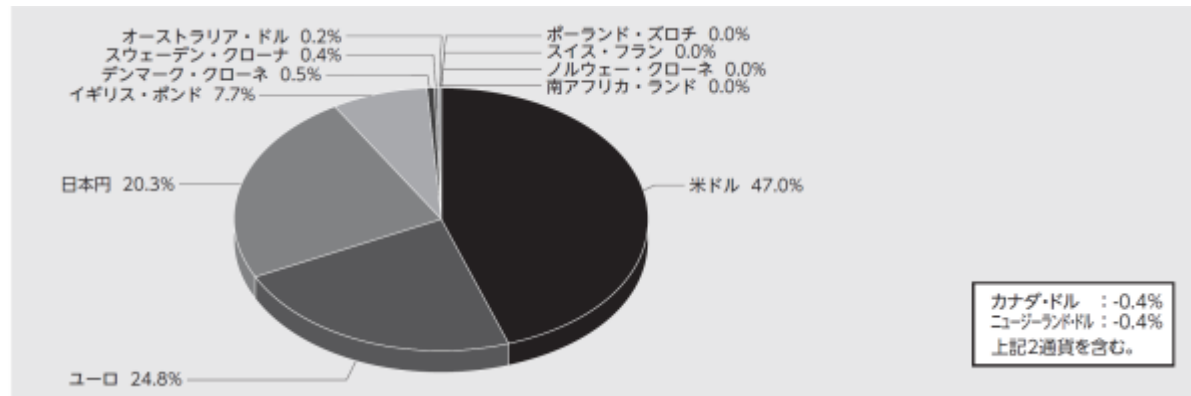
(中略)

< Bコース（為替ヘッジなし）の特徴 >

(中略)

Bコースの通貨別構成比率

(中略)

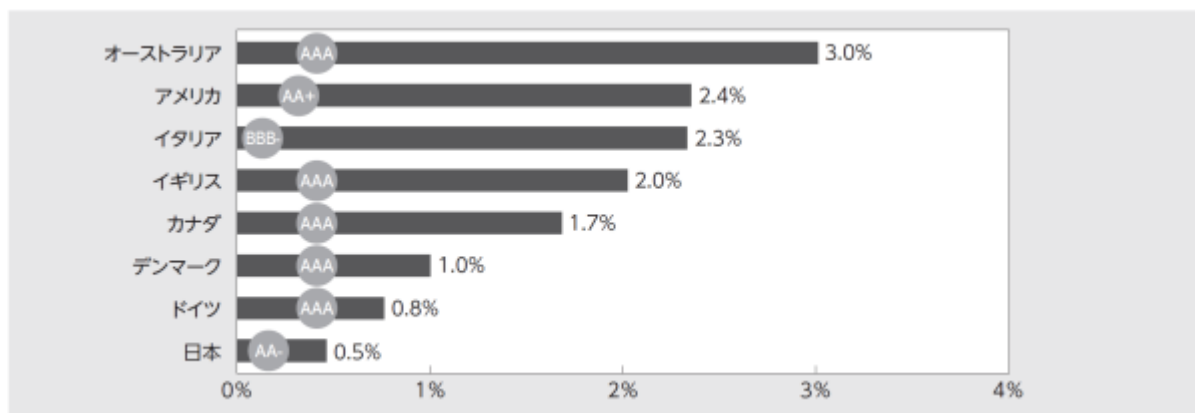


2015年6月末現在

上記はマザーファンドの数値です。

各国の10年国債利回りと格付け

海外金利は国内金利を上回っています。

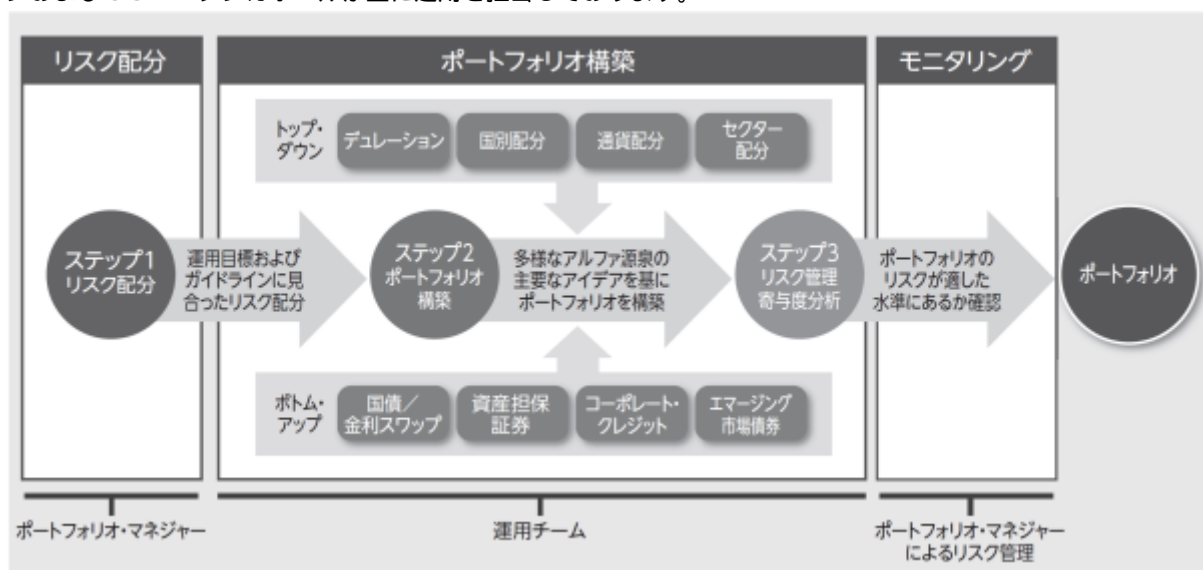


2015年6月末現在

(中略)

< ファンドの運用 >

本ファンドの運用は、「グローバル債券・通貨運用グループ」によって行われます。同グループは世界各地に運用拠点を展開し、幅広い調査能力ならびに専門性を活用した運用を行っています。なお、本ファンドにおいて債券はG S A M ロンドン、G S A M ニューヨークおよびG S A M シンガポールが運用を担当しており、通貨についてはG S A M ロンドンおよびG S A M シンガポールが主に運用を担当しております。



本運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。また本運用プロセスは変更される場合があります。

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

2. ファンドの関係法人

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 (G S A M) とは

(中略)

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 (G S A M) 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、2014年12月末現在、グループ全体で1兆239億米ドル(約123.4兆円*)の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2014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 = 120.55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。

委託会社等の概況

(中略)

c. 大株主の状況

(本書提出日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (株)	所有比率 (%)
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州ニューヨーク市ウェスト・ストリート200番地	6,336	99
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州ニューヨーク市ウェスト・ストリート200番地	64	1

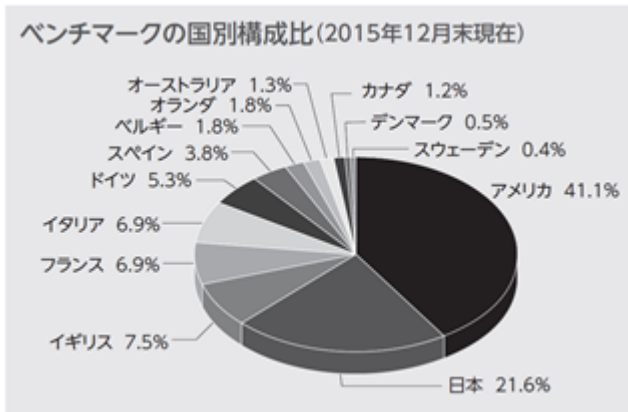
<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドのベンチマーク>

(中略)



(中略)

(中略)

<なぜ世界債券投資なのでしょう？>



(中略)

債券への投資は、短期金融商品（預貯金等）を上回る収益を追求することができます。一方で、値下がりリスクがあり、その価格変動幅は、一般に短期金融商品より大きくなりますが株式への投資と比べ小さくなります。

期間：1998年6月末～2015年12月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガン、MSCI Inc.のデータを

基にゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント作成

世界株式：MSCIワールド・インデックス（円ヘッジ）

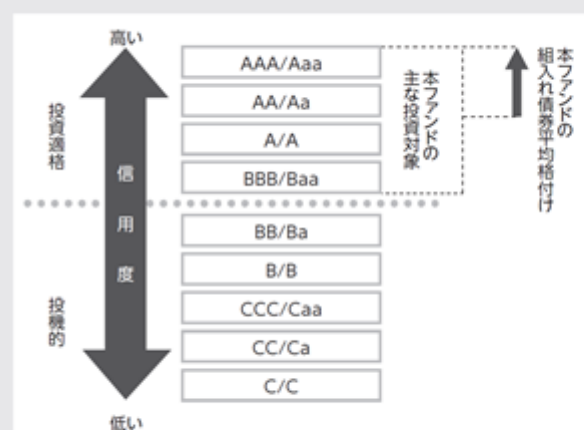
世界債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス

（グローバル、円ヘッジ）

円短期金融商品：1ヵ月円LIBOR

<高格付け債券への投資>

投資対象債券の信用格付けの位置付け



※格付けが公表されていない債券の場合は、委託会社が発行体の財務内容等を分析して適切と判断した格付けとします。

投資する債券の信用格付けについては組入れ時においてトリプルB格（トリプルBマイナス格も含まれます。）相当以上とします。また、原則として、ポートフォリオの平均格付けはダブルA格（ダブルAマイナス格も含まれます。）相当以上に維持するように運用します。投資対象債券の信用格付けを投資適格に限定することで、リターン安定化をめざします。

ポイント

●債務不履行の可能性を第三者が評価したものが格付けです。債券を購入するにあたって、債券を発行した企業等の元本・利息の支払能力を知る上で重要な情報の一つといえます。

●格付けは英字の記号で表されます。左図の例では、トリプルAが最も信用度が高い、つまり債務不履行が生じる可能性が最も低いことを表しています。

社債市場では、信用力の高い（格付けが高い）銘柄は、国債に対する上乗せ金利が低くなっていますが、債務不履行が生じる可能性が低く、比較的安定したリターンが期待できます。

<債務不履行率>

期間：1981年～2014年

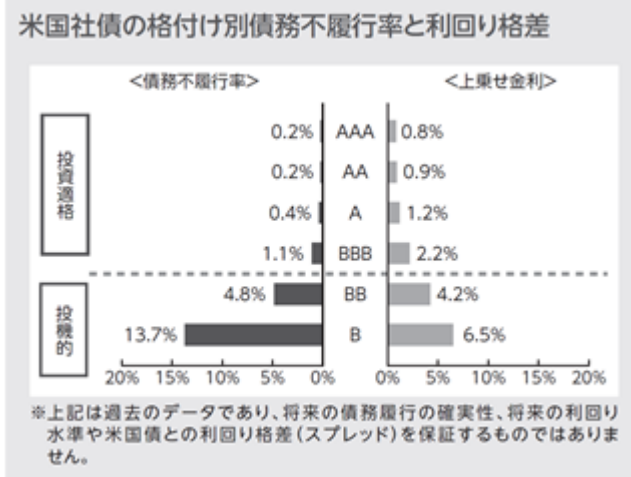
出所：スタンダード＆プアーズ

1981年～2014年の期間について、債務不履行を起こした米国社債の割合を格付け別に算出。なお、該当社債の格付けは、債務不履行時の3年前（各年1月1日時点）の格付けを参照。（2014年12月末現在）

<上乗せ金利>

2015年12月末現在

出所：パークレイズ

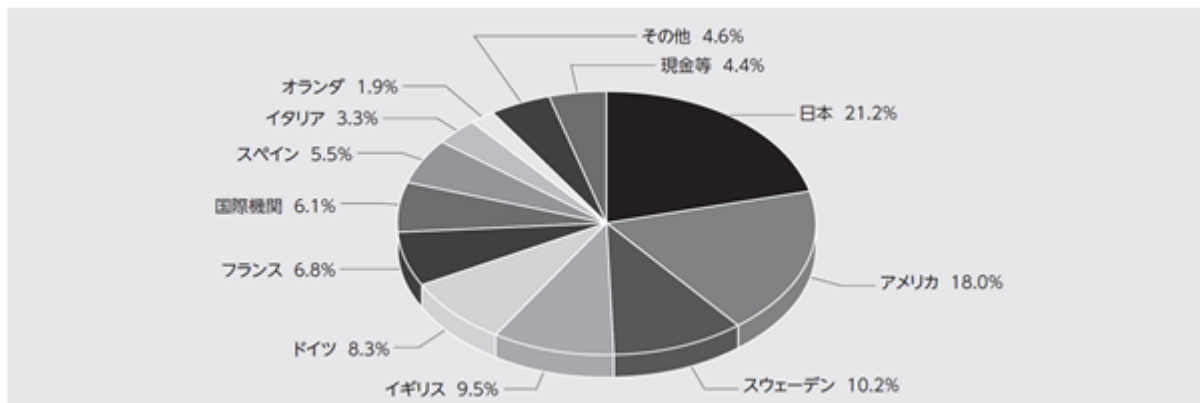


< Aコース（限定為替ヘッジ）の特徴 >

（中略）

Aコースの債券国別構成比率

（中略）

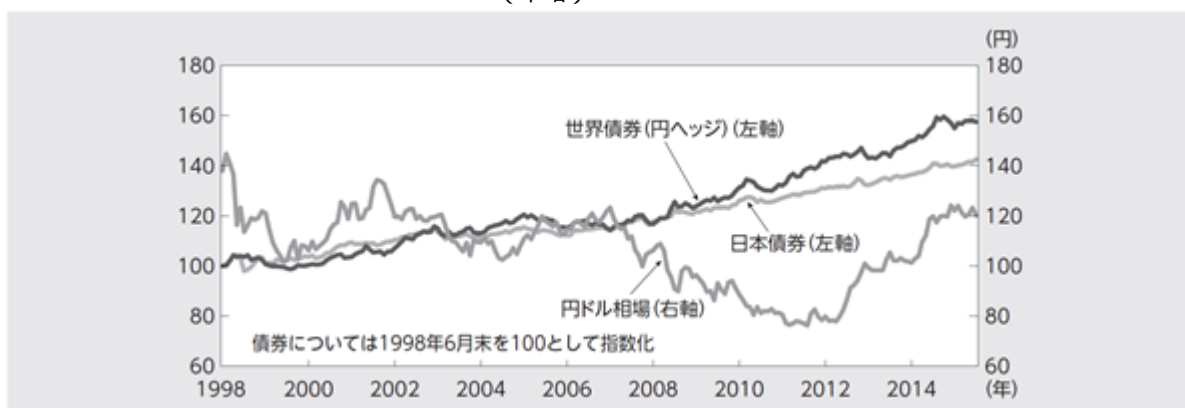


2015年12月末現在

上記はマザーファンドの数値です。また、上記の数値は先物を含みません。

世界債券の値動きの推移と円ドル相場

（中略）



期間：1998年6月末～2015年12月末

出所：ブルームバーグ、JPモルガンのデータを基にゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント作成

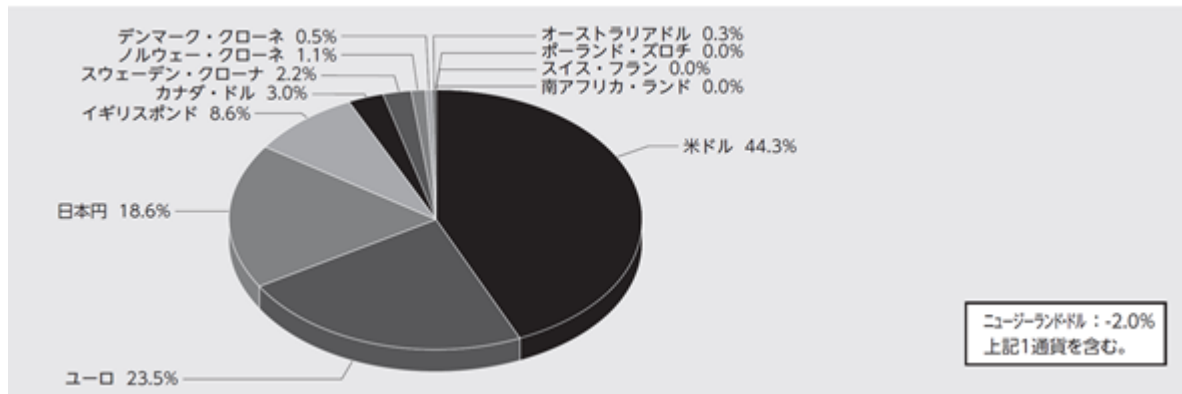
（中略）

< Bコース（為替ヘッジなし）の特徴 >

（中略）

Bコースの通貨別構成比率

（中略）

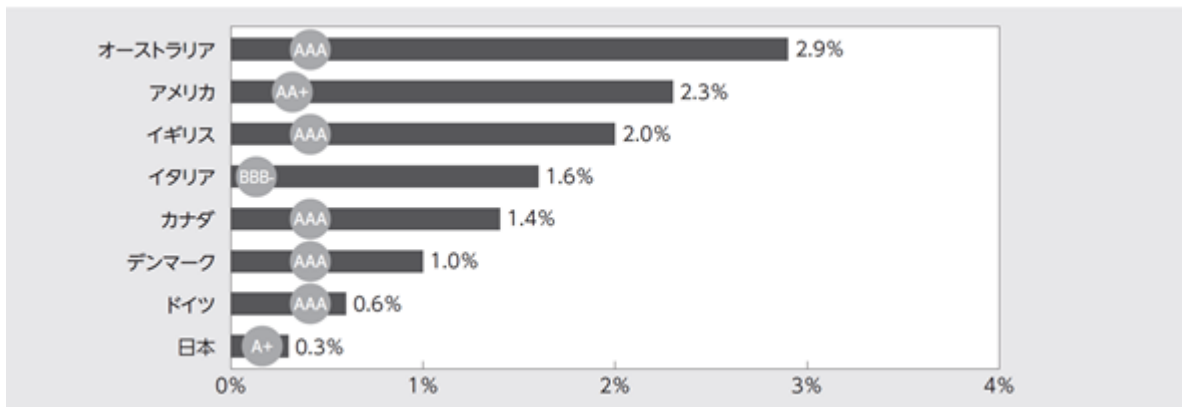


2015年12月末現在

上記はマザーファンドの数値です。

各国の10年国債利回りと格付け

海外金利は国内金利を上回っています。

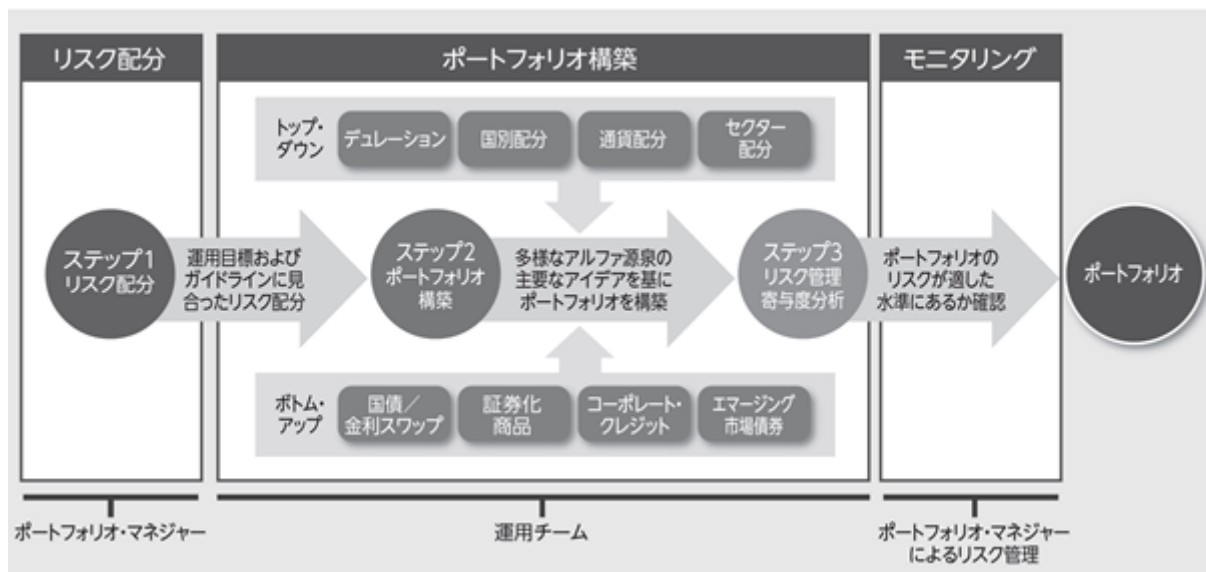


2015年12月末現在

（中略）

< ファンドの運用 >

本ファンドの運用は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントのグローバル債券・通貨運用グループによって行われます。同グループは世界各地に運用拠点を展開し、幅広い調査能力ならびに専門性を活用した運用を行っています。なお、本ファンドにおいて債券はG S A Mロンドン、G S A MニューヨークおよびG S A Mシンガポールが運用を担当しており、通貨についてはG S A MロンドンおよびG S A Mシンガポールが主に運用を担当しております。



本運用プロセスがその目的を達成できる保証はありません。また本運用プロセスは変更される場合があります。

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

2. ファンドの関係法人

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 (G S A M) とは

(中略)

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 (G S A M) 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、2015年12月末現在、グループ全体で1兆827億米ドル(約131兆円*)の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2015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 = 120.61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。

委託会社等の概況

(中略)

c. 大株主の状況

(本書提出日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (株)	所有比率 (%)
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市ウェスト・ストリート200番地	6,400	100

[次へ](#)

2 投資方針

<訂正前>

(1) 投資方針

(中略)

b. 本ファンドの運用方針

(中略)

- ・ Aコースにおける実質外貨建資産*については、対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。

(中略)

(3) 運用体制

a. 組織

本ファンドの運用は、G S A Mロンドン、G S A MニューヨークおよびG S A Mシンガポールに属する「グローバル債券・通貨運用グループ」によって行われます。

(後略)

<訂正後>

(1) 投資方針

(中略)

b. 本ファンドの運用方針

(中略)

- ・ Aコースにおける実質外貨建資産*については、対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。Bコースにおける実質外貨建資産*については、原則として為替ヘッジを行いません。

(中略)

(3) 運用体制

a. 組織

本ファンドの運用は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメントのグローバル債券・通貨運用グループによって行われます。

(後略)

[次へ](#)

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 投資リスク

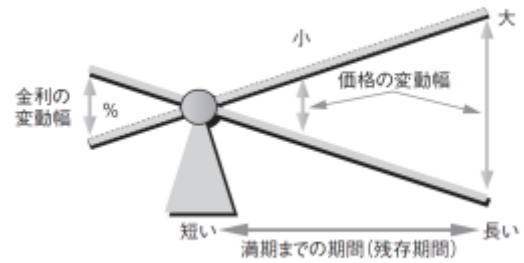
(中略)

(a) 元本の変動リスク（本ファンドの投資内容に伴うリスク）

(中略)

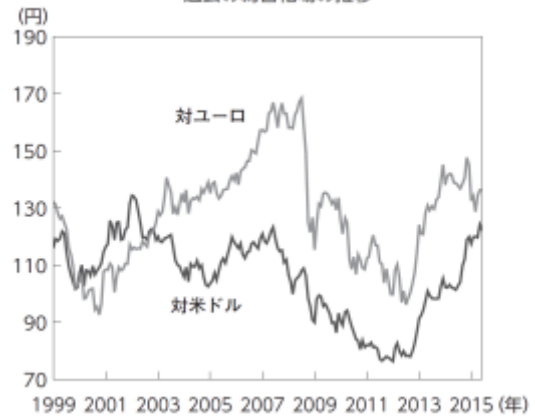
(中略)

金利変動と残存期間の異なる債券の価格変動幅のイメージ



上記はあくまで例示をもって理解を深めるための概念図です。

過去の為替相場の推移



期間：1999年1月末～2015年6月末

出所：ブルームバーグ

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。

(中略)

(3) 参考情報

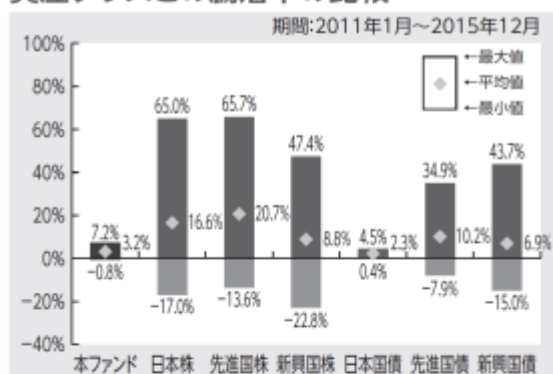
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)

本ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移



本ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

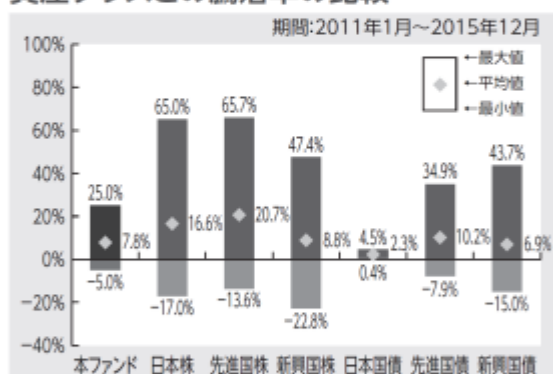


ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)

本ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移



本ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較



● 年間騰落率は各月末における直近1年間の騰落率を表示したものです。

● グラフは、本ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
● 全ての資産クラスが本ファンドの投資対象とは限りません。
● 上記5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、本ファンドおよびその他の代表的資産クラスについて表示したものです。

● 各資産クラスの指数

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
先進国株：MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)
日本国債：NOMURA-BPI 国債
先進国債：シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

※ 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースまたは円換算ベースの指数を採用しております。

本ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および当該基準価額の年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<訂正後>

(1) 投資リスク

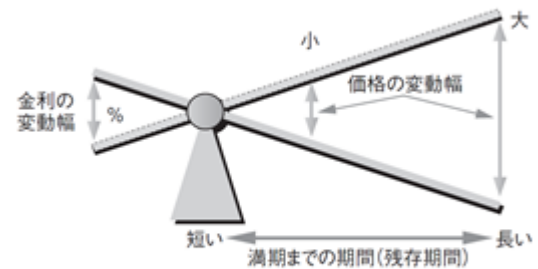
(中略)

(a) 元本の変動リスク（本ファンドの投資内容に伴うリスク）

(中略)

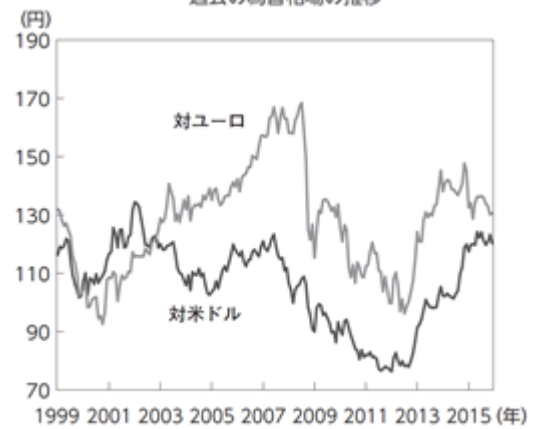
(中略)

金利変動と残存期間の異なる債券の価格変動幅のイメージ



上記はあくまで例示をもって理解を深めるための概念図です。

過去の為替相場の推移



期間：1999年1月末～2015年12月末

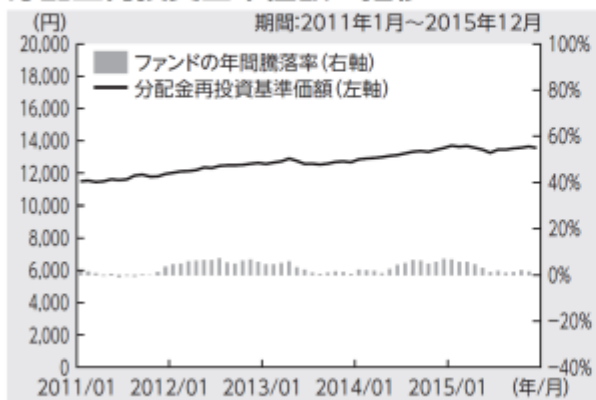
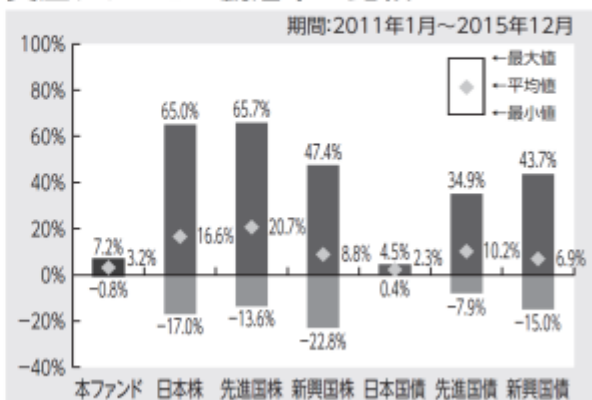
出所：ブルームバーグ

上記は過去のデータであり、将来の結果を示唆または保証するものではありません。

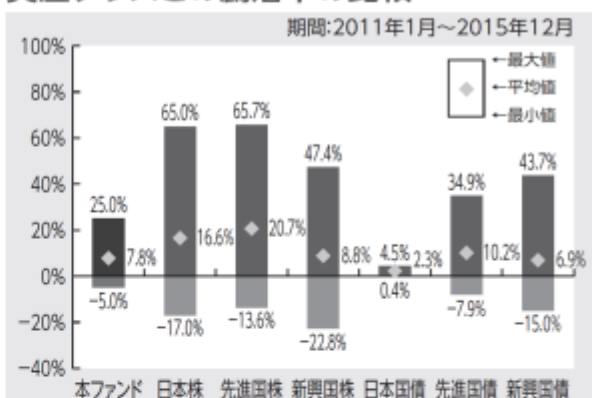
(中略)

(3) 参考情報

ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)

本ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移本ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)

本ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移本ファンドと他の代表的な
資産クラスとの騰落率の比較

- 年間騰落率は各月末における直近1年間の騰落率を表示したものです。

- グラフは、本ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- 全ての資産クラスが本ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を、本ファンドおよびその他の代表的資産クラスについて表示したものです。

● 各資産クラスの指数

- 日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株：MSCI コクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円換算ベース)
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
- 新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースまたは円換算ベースの指数を採用しております。

本ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および当該基準価額の年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

[次へ](#)

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

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

(2015年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	4,038,406,477	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,518,781	0.06
合計(純資産総額)		4,035,887,696	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。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

(2015年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	7,667,113,997	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,804,916	0.06
合計(純資産総額)		7,662,309,081	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

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース(限定為替ヘッジ)マザーファンド>

(2015年12月30日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	7,348,260,506	21.21
	アメリカ	2,747,783,030	7.93
	カナダ	228,367,443	0.66
	ドイツ	1,462,127,381	4.22
	イタリア	993,901,326	2.87
	フランス	1,249,035,659	3.61
	イギリス	1,137,270,131	3.28
	オランダ	332,447,675	0.96
	スペイン	1,893,505,153	5.47
	ベルギー	545,819,317	1.58
	スウェーデン	3,544,023,566	10.23
	デンマーク	312,113,204	0.90
	小計	21,794,654,391	62.92
	特殊債券	アメリカ	755,284,601
カナダ		99,938,182	0.29
ドイツ		1,416,267,793	4.09
フランス		414,650,209	1.20
オランダ		31,738,185	0.09
国際機関		2,109,765,126	6.09
小計		4,827,644,096	13.94
社債券	アメリカ	2,740,787,742	7.91
	イタリア	159,484,525	0.46
	フランス	707,549,486	2.04
	オーストラリア	212,896,413	0.61
	イギリス	2,158,596,542	6.23
	オランダ	300,897,813	0.87
	ルクセンブルク	83,660,733	0.24
	アイルランド	119,458,731	0.34
小計	6,483,331,985	18.72	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,535,374,442	4.42
合計(純資産総額)		34,641,004,914	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。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース（為替ヘッジなし）マザーファンド>

（2015年12月30日現在）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	15,785,535,093	21.24
	アメリカ	6,666,491,614	8.97
	カナダ	552,011,685	0.74
	ドイツ	1,500,026,726	2.02
	イタリア	1,487,695,869	2.00
	フランス	3,699,679,944	4.98
	イギリス	2,186,636,397	2.94
	オランダ	292,402,750	0.39
	スペイン	4,439,183,390	5.97
	ベルギー	757,121,691	1.02
	スウェーデン	7,757,832,254	10.44
	デンマーク	578,970,785	0.78
	小計	45,703,588,198	61.51
	特殊債券	アメリカ	2,158,678,141
カナダ		218,046,944	0.29
ドイツ		2,201,764,253	2.96
フランス		1,076,064,249	1.45
オランダ		52,896,977	0.07
国際機関		4,544,544,286	6.12
小計		10,251,994,850	13.80
社債券	アメリカ	6,253,349,247	8.42
	イタリア	445,571,054	0.60
	フランス	1,796,799,287	2.42
	オーストラリア	700,306,719	0.94
	イギリス	6,030,600,405	8.12
	オランダ	843,043,849	1.13
	ルクセンブルク	239,681,533	0.32
	アイルランド	258,827,252	0.35
小計	16,568,179,346	22.30	
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,781,010,058	2.39
合計（純資産総額）		74,304,772,452	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

投資有価証券の主要銘柄

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ゴールドマン・サックス・世界 債券オープンAコース(限定為 替ヘッジ)マザーファンド	2,561,303,024	1.5333	3,927,502,057	1.5767	4,038,406,477	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2015年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

(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。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	ゴールドマン・サックス・世界 債券オープンBコース(為替 ヘッジなし)マザーファンド	3,427,255,821	2.2521	7,718,851,486	2.2371	7,667,113,997	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2015年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

(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

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）マザーファンド>

（2015年12月30日現在）

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT 3.75%	230,700,000	1,538.73	3,549,866,466	1,536.20	3,544,023,566	3.75	2017/8/12	10.23
2	日本	国債証券	第110回利付国債 (5年)	1,776,000,000	100.71	1,788,733,920	100.71	1,788,716,160	0.3	2018/3/20	5.16
3	日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	1,328,000,000	104.58	1,388,822,400	104.55	1,388,543,520	1	2020/9/20	4.01
4	国際機関	特殊債券	EURO STABILITY M 0.05%	9,500,000	13,237.87	1,257,598,360	13,233.00	1,257,135,250	0.05	2018/12/17	3.63
5	ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 1%	7,810,000	13,562.55	1,059,235,890	13,633.97	1,064,813,730	1	2025/8/15	3.07
6	ドイツ	特殊債券	KFW 1.125%	7,100,000	11,988.87	851,210,141	11,953.29	848,683,981	1.125	2018/8/6	2.45
7	日本	国債証券	第145回利付国債 (20年)	655,900,000	113.05	741,514,627	114.75	752,651,809	1.7	2033/6/20	2.17
8	国際機関	特殊債券	EURO STABILITY M 0.1%	5,700,000	13,151.96	749,661,913	13,145.37	749,286,401	0.1	2020/11/3	2.16
9	日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	694,300,000	104.95	728,723,394	105.31	731,188,159	0.8	2023/9/20	2.11
10	日本	国債証券	第118回利付国債 (20年)	580,100,000	118.63	688,172,630	119.81	695,052,616	2	2030/6/20	2.01
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.75%	5,730,000	11,994.13	687,264,196	11,974.76	686,153,995	0.75	2017/12/31	1.98
12	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25%	3,300,000	16,868.53	556,661,701	16,863.00	556,479,073	4.25	2023/10/25	1.61
13	日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	546,700,000	100.90	551,631,234	101.46	554,731,023	0.4	2025/9/20	1.60
14	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.4%	3,210,000	16,947.46	544,013,674	16,845.34	540,735,528	5.4	2023/1/31	1.56
15	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.5%	3,580,000	14,427.89	516,518,535	14,383.35	514,924,080	4.5	2018/1/31	1.49
16	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	2,560,000	19,997.28	511,930,465	19,993.06	511,822,526	4.5	2041/4/25	1.48
17	日本	国債証券	第27回利付国債 (30年)	383,200,000	125.25	479,992,488	127.66	489,204,616	2.5	2037/9/20	1.41
18	ドイツ	特殊債券	KFW 0%	3,600,000	13,223.51	476,046,551	13,219.16	475,890,023	0	2018/12/7	1.37
19	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	1,970,000	23,329.53	459,591,895	23,315.77	459,320,718	4.5	2034/9/7	1.33
20	イタリア	国債証券	BTPS 4.25%	2,950,000	15,086.34	445,047,237	15,045.89	443,853,866	4.25	2019/9/1	1.28
21	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B 0.625%	3,600,000	12,220.33	439,932,104	12,100.32	435,611,578	0.625	2024/1/15	1.26
22	イギリス	社債券	ROYAL BK OF SCOT 4%	2,700,000	13,317.99	359,585,835	13,285.05	358,696,388	4	2016/3/15	1.04
23	オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVT 1.75%	2,300,000	14,405.62	331,329,355	14,454.24	332,447,675	1.75	2023/7/15	0.96
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125%	2,620,000	12,325.61	322,931,201	12,266.39	321,379,658	3.125	2044/8/15	0.93
25	イタリア	国債証券	BTPS 5%	1,590,000	18,760.09	298,285,509	18,824.52	299,310,021	5	2039/8/1	0.86
26	フランス	社債券	DEXIA CREDIT LOC 1.875%	1,600,000	18,028.17	288,450,791	18,044.97	288,719,660	1.875	2017/7/17	0.83
27	ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4%	1,460,000	19,503.40	284,749,781	19,555.19	285,505,861	4	2037/1/4	0.82
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.75%	2,020,000	13,889.93	280,576,608	13,830.71	279,380,344	3.75	2043/11/15	0.81
29	日本	国債証券	第96回利付国債 (20年)	224,900,000	118.73	267,032,766	119.53	268,836,464	2.1	2027/6/20	0.78
30	デンマーク	国債証券	KINGDOM OF DENMARK 4%	13,700,000	1,915.42	262,413,641	1,909.22	261,563,929	4	2017/11/15	0.76

種類別及び業種別投資比率

（2015年12月30日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	62.92
特殊債券	13.94
社債券	18.72
合計	95.57

(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。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース(為替ヘッジなし)マザーファンド>

(2015年12月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT 3.75%	505,000,000	1,538.73	7,770,622,304	1,536.20	7,757,832,254	3.75	2017/8/12	10.44
2	日本	国債証券	第110回利付国債 (5年)	3,623,500,000	100.71	3,649,480,495	100.71	3,649,444,260	0.3	2018/3/20	4.91
3	日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	2,408,700,000	104.58	2,519,018,460	104.55	2,518,512,633	1	2020/9/20	3.39
4	国際機関	特殊債券	EURO STABILITY M 0.05%	14,380,000	13,237.87	1,903,606,781	13,233.00	1,902,905,780	0.05	2018/12/17	2.56
5	ドイツ	特殊債券	KFW 1.125%	15,700,000	11,988.87	1,882,253,410	11,953.29	1,876,667,395	1.125	2018/8/6	2.53
6	日本	国債証券	第145回利付国債 (20年)	1,608,900,000	113.05	1,818,909,717	114.75	1,846,228,839	1.7	2033/6/20	2.48
7	国際機関	特殊債券	EURO STABILITY M 0.1%	12,100,000	13,151.96	1,591,387,568	13,145.37	1,590,590,432	0.1	2020/11/3	2.14
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875%	12,380,000	11,750.06	1,454,658,300	11,704.35	1,448,999,285	2.875	2043/5/15	1.95
9	日本	国債証券	第92回利付国債 (20年)	1,173,200,000	118.39	1,389,021,872	119.09	1,397,199,076	2.1	2026/12/20	1.88
10	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25%	8,150,000	16,868.53	1,374,785,717	16,863.00	1,374,334,680	4.25	2023/10/25	1.85
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	5,910,000	19,997.28	1,181,839,473	19,993.06	1,181,590,285	4.5	2041/4/25	1.59
12	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B 0.625%	9,310,000	12,220.33	1,137,713,304	12,100.32	1,126,539,941	0.625	2024/1/15	1.52
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.75%	9,320,000	11,994.13	1,117,853,806	11,974.76	1,116,048,035	0.75	2017/12/31	1.50
14	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.4%	6,380,000	16,947.46	1,081,248,363	16,845.34	1,074,732,919	5.4	2023/1/31	1.45
15	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.5%	7,340,000	14,427.49	1,058,978,302	14,383.35	1,055,738,199	4.5	2018/1/31	1.42
16	ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 2%	7,040,000	14,832.55	1,044,212,130	14,860.88	1,046,206,563	2	2023/8/15	1.41
17	日本	国債証券	第330回利付国債 (10年)	965,100,000	104.95	1,012,949,658	105.31	1,016,375,763	0.8	2023/9/20	1.37
18	イギリス	社債券	ABBEY NATL TREAS 0.375%	7,600,000	13,233.13	1,005,718,286	13,229.04	1,005,407,705	0.375	2019/9/18	1.35
19	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75%	6,870,000	14,229.71	977,581,095	14,231.02	977,671,647	1.75	2024/11/25	1.32
20	日本	国債証券	第325回利付国債 (10年)	903,900,000	104.78	947,151,615	105.01	949,212,507	0.8	2022/9/20	1.28
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	7,535,000	11,937.97	899,526,627	11,906.61	897,163,765	1.375	2020/2/29	1.21
22	日本	国債証券	第30回利付国債 (30年)	700,000,000	121.67	851,718,000	124.36	870,555,000	2.3	2039/3/20	1.17
23	日本	国債証券	第96回利付国債 (20年)	709,000,000	118.73	841,824,060	119.53	847,510,240	2.1	2027/6/20	1.14
24	国際機関	特殊債券	INTERAMER DEV BK 7%	5,010,000	16,177.90	810,512,895	16,113.61	807,292,179	7	2025/6/15	1.09
25	アメリカ	特殊債券	FHMS K029 A2	6,200,000	12,622.99	782,625,500	12,541.01	777,543,125	3.32	2023/2/25	1.05
26	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	3,270,000	23,329.53	762,875,885	23,315.77	762,425,760	4.5	2034/9/7	1.03
27	日本	国債証券	第340回利付国債 (10年)	739,700,000	100.90	746,372,094	101.46	750,566,193	0.4	2025/9/20	1.01
28	日本	国債証券	第16回利付国債 (30年)	575,000,000	125.80	723,378,750	127.66	734,050,750	2.5	2034/9/20	0.99
29	フランス	社債券	DEXIA CREDIT LOC 1.875%	3,800,000	18,028.17	685,070,629	18,044.97	685,709,192	1.875	2017/7/17	0.92
30	日本	国債証券	第5回利付国債 (40年)	560,300,000	114.16	639,638,480	118.54	664,207,635	2	2052/3/20	0.89

種類別及び業種別投資比率

(2015年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	61.51
特殊債券	13.80
社債券	22.30
合計	97.60

(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。

投資不動産物件

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A コース(限定為替ヘッジ)マザーファンド>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B コース(為替ヘッジなし)マザーファンド>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)>

(2015年12月30日現在)

該当事項はありません。

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）マザーファンド>

有価証券先物取引等

（2015年12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	帳簿価額 (円)	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1603	売建	37	米ドル	4,666,431.16	562,818,261	4,649,281.25	560,749,811	1.62
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1603	買建	78	米ドル	16,960,420.46	2,045,596,312	16,936,968.36	2,042,767,753	5.90
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1603	売建	43	米ドル	6,615,771.45	797,928,194	6,591,093.75	794,951,817	2.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1603	買建	63	米ドル	9,966,906.21	1,202,108,558	9,934,312.5	1,198,177,429	3.46
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1603	買建	212	米ドル	25,120,783.4	3,029,817,687	25,052,438.56	3,021,574,614	8.72
	カナダ	モンリオール取引所	MON 10Y 1603	買建	59	カナダドル	8,199,820	714,860,308	8,310,740	724,530,313	2.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	B0BL 1603	売建	52	ユーロ	6,800,829.8	896,145,330	6,792,760	895,081,980	2.58
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1603	買建	98	ユーロ	13,417,180	1,767,981,811	13,451,480	1,772,501,516	5.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1603	買建	94	ユーロ	14,821,355.05	1,953,009,956	14,840,720	1,955,561,663	5.65
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL 1603	売建	22	ユーロ	3,364,250.3	443,307,247	3,318,040	437,218,123	1.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1603	買建	14	ユーロ	2,095,380	276,108,224	2,097,760	276,421,832	0.80
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1603	買建	53	オーストラリアドル	6,704,914.56	589,496,088	6,794,357.79	597,359,935	1.72
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1603	買建	329	オーストラリアドル	36,560,971.85	3,214,440,645	36,723,611.68	3,228,739,935	9.32
その他先物取引	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1603	買建	20	英ポンド	2,335,800	417,594,324	2,343,600	418,988,807	1.21
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	買建	21	米ドル	5,198,861.01	627,034,627	5,193,300	626,363,913	1.81
	アメリカ	シカゴ商業取引所	EURO\$ 90Days	買建	21	米ドル	5,168,673.51	623,393,712	5,161,537.5	622,533,037	1.80
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1603	売建	11	英ポンド	1,366,062.5	244,224,653	1,366,337.5	244,273,818	0.71
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1606	売建	11	英ポンド	1,364,962.5	244,027,995	1,364,962.5	244,027,995	0.70
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1609	売建	104	英ポンド	12,893,150.9	2,305,037,516	12,889,500	2,304,384,809	6.65	

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	帳簿価額 (円)	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1612	売建	11	英ポンド	1,361,937.5	243,487,186	1,361,387.5	243,388,857	0.70
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1703	売建	11	英ポンド	1,360,425	243,216,780	1,359,462.5	243,044,705	0.70
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1706	売建	11	英ポンド	1,358,775	242,921,794	1,357,537.5	242,700,554	0.70
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1709	売建	104	英ポンド	12,837,388.4	2,295,068,295	12,820,600	2,292,066,867	6.62
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1712	売建	11	英ポンド	1,356,025	242,430,149	1,354,650	242,184,327	0.70
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3M EURIBOR	買建	103	ユーロ	25,787,471.4	3,398,015,107	25,778,325	3,396,809,885	9.81

(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。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース(為替ヘッジなし)マザーファンド>

有価証券先物取引等

(2015年12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	帳簿価額 (円)	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
債券先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1603	売建	330	米ドル	41,572,158.78	5,014,018,065	41,466,562.5	5,001,282,101	6.73
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1603	買建	82	米ドル	17,823,607.74	2,149,705,329	17,805,530.84	2,147,525,074	2.89
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1603	売建	69	米ドル	10,647,422.85	1,284,185,665	10,576,406.25	1,275,620,355	1.72
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1603	買建	128	米ドル	20,264,942.99	2,444,154,774	20,184,000	2,434,392,237	3.28
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1603	買建	557	米ドル	65,987,932.76	7,958,804,570	65,821,737.16	7,938,759,717	10.68
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1603	買建	129	カナダドル	17,928,420	1,562,999,656	18,170,940	1,584,142,549	2.13
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL 1603	売建	117	ユーロ	15,305,572.05	2,016,815,219	15,283,710	2,013,934,462	2.71
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1603	買建	239	ユーロ	32,721,490	4,311,710,737	32,805,140	4,322,733,292	5.82
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1603	買建	261	ユーロ	41,128,256.3	5,419,470,333	41,206,680	5,429,804,212	7.31
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL 1603	売建	24	ユーロ	3,690,807.6	486,337,706	3,619,680	476,965,228	0.64
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1603	買建	8	ユーロ	1,197,360	157,776,128	1,198,720	157,955,331	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1603	買建	127	オーストラリアドル	16,066,500.43	1,412,566,718	16,280,819.61	1,431,409,658	1.93
オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1603	買建	718	オーストラリアドル	79,789,590.33	7,015,100,782	80,144,538.56	7,046,307,827	9.48	
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1603	買建	29	英ポンド	3,394,359.6	606,843,609	3,398,220	607,533,771	0.82	
その他先物取引	アメリカ	シカゴ商品取引所	EURO\$ 90Days	買建	47	米ドル	11,635,546.07	1,403,363,212	11,623,100	1,401,862,091	1.89
	アメリカ	シカゴ商品取引所	EURO\$ 90Days	買建	47	米ドル	11,567,983.57	1,395,214,498	11,552,012.5	1,393,288,227	1.88
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1603	売建	24	英ポンド	2,980,500	532,853,790	2,981,100	532,961,058	0.72
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1606	売建	24	英ポンド	2,978,100	532,424,718	2,978,100	532,424,718	0.72
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1609	売建	230	英ポンド	28,513,702.8	5,097,679,786	28,505,625	5,096,235,637	6.86

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	帳簿価額 (円)	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3MLIBOR 1612	売建	24	英ポ ンド	2,971,500	531,244,770	2,970,300	531,030,234	0.71
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3MLIBOR 1703	売建	24	英ポ ンド	2,968,200	530,654,796	2,966,100	530,279,358	0.71
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3MLIBOR 1706	売建	24	英ポ ンド	2,964,600	530,011,188	2,961,900	529,528,482	0.71
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3MLIBOR 1709	売建	230	英ポ ンド	28,390,377.8	5,075,631,742	28,353,250	5,068,994,035	6.82
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3MLIBOR 1712	売建	24	英ポ ンド	2,958,600	528,938,508	2,955,600	528,402,168	0.71
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取 引所	3M EURIBOR	買建	227	ユーロ	56,832,582.6	7,488,829,409	56,812,425	7,486,173,242	10.07

(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

純資産の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)>

2015年12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。

期別	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)
第5計算期間末 (2006年6月7日)	871	871	1.0510	1.0510
第6計算期間末 (2007年6月7日)	955	955	1.0294	1.0294
第7計算期間末 (2008年6月9日)	1,099	1,099	1.0247	1.0247
第8計算期間末 (2009年6月8日)	1,924	1,924	1.0549	1.0549
第9計算期間末 (2010年6月7日)	2,577	2,577	1.1605	1.1605
第10計算期間末 (2011年6月7日)	2,822	2,822	1.1626	1.1626
第11計算期間末 (2012年6月7日)	3,435	3,435	1.2367	1.2367
第12計算期間末 (2013年6月7日)	3,585	3,585	1.2727	1.2727
第13計算期間末 (2014年6月9日)	3,749	3,749	1.3116	1.3116
第14計算期間末 (2015年6月8日)	3,911	3,911	1.3274	1.3274
2014年12月末日	3,990	-	1.3558	-
2015年1月末日	4,053	-	1.3707	-
2月末日	4,040	-	1.3640	-
3月末日	4,077	-	1.3682	-
4月末日	4,048	-	1.3577	-
5月末日	3,984	-	1.3463	-
6月末日	3,908	-	1.3263	-
7月末日	3,945	-	1.3464	-
8月末日	3,933	-	1.3458	-
9月末日	3,988	-	1.3536	-
10月末日	4,019	-	1.3577	-
11月末日	4,017	-	1.3657	-
12月末日	4,035	-	1.3566	-

(注) 表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

2015年12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。

期別	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)
第5計算期間末 (2006年6月7日)	779	779	1.2693	1.2693
第6計算期間末 (2007年6月7日)	1,176	1,176	1.3711	1.3711
第7計算期間末 (2008年6月9日)	1,833	1,833	1.3609	1.3609
第8計算期間末 (2009年6月8日)	3,850	3,850	1.2855	1.2855
第9計算期間末 (2010年6月7日)	4,481	4,481	1.2673	1.2673
第10計算期間末 (2011年6月7日)	5,085	5,085	1.2551	1.2551
第11計算期間末 (2012年6月7日)	5,426	5,426	1.2719	1.2719
第12計算期間末 (2013年6月7日)	6,563	6,563	1.5387	1.5387
第13計算期間末 (2014年6月9日)	7,131	7,131	1.6707	1.6707
第14計算期間末 (2015年6月8日)	7,776	7,776	1.8509	1.8509
2014年12月末日	7,982	-	1.8771	-
2015年1月末日	7,791	-	1.8278	-
2月末日	7,747	-	1.8303	-
3月末日	7,804	-	1.8237	-
4月末日	7,724	-	1.8179	-
5月末日	7,790	-	1.8491	-
6月末日	7,672	-	1.8237	-
7月末日	7,751	-	1.8556	-
8月末日	7,665	-	1.8313	-
9月末日	7,637	-	1.8253	-
10月末日	7,666	-	1.8329	-
11月末日	7,730	-	1.8447	-
12月末日	7,662	-	1.8217	-

(注) 表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

分配の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	0.0000
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	0.0000
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	0.0000
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	0.0000
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	0.0000
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	0.0000
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	0.0000
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	0.0000
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	0.0000
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	0.0000

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	0.0000
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	0.0000
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	0.0000
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	0.0000
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	0.0000
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	0.0000
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	0.0000
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	0.0000
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	0.0000
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	0.0000

収益率の推移

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

期	期間	収益率（％）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	3.9
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	2.1
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	0.5
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	2.9
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	10.0
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	0.2
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	6.4
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	2.9
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	3.1
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	1.2
第15中間計算期間	2015年6月9日～2015年12月8日	2.6

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

期	期間	収益率（％）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	4.2
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	8.0
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	0.7
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	5.5
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	1.4
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	1.0
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	1.3
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	21.0
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	8.6
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	10.8
第15中間計算期間	2015年6月9日～2015年12月8日	0.4

(4) 設定及び解約の実績

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

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	期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	200,751,068	190,195,039	829,470,003
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	277,164,674	178,433,512	928,201,165
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	496,012,940	350,984,719	1,073,229,386
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	1,021,056,268	270,328,802	1,823,956,852
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	682,944,551	285,880,298	2,221,021,105
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	722,231,350	515,326,184	2,427,926,271
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	722,570,328	372,391,917	2,778,104,682
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	717,680,971	678,187,314	2,817,598,339
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	463,973,376	422,878,027	2,858,693,688
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	561,864,661	473,742,899	2,946,815,450
第15中間 計算期間	2015年6月9日～2015年12月8日	272,333,792	260,144,343	2,959,004,899

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

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	期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第5計算期間	2005年6月8日～2006年6月7日	298,892,479	163,182,842	614,350,355
第6計算期間	2006年6月8日～2007年6月7日	381,703,113	137,702,548	858,350,920
第7計算期間	2007年6月8日～2008年6月9日	679,981,878	190,710,301	1,347,622,497
第8計算期間	2008年6月10日～2009年6月8日	1,946,217,360	298,301,344	2,995,538,513
第9計算期間	2009年6月9日～2010年6月7日	852,071,919	311,749,460	3,535,860,972
第10計算期間	2010年6月8日～2011年6月7日	816,154,634	300,416,157	4,051,599,449
第11計算期間	2011年6月8日～2012年6月7日	574,535,606	359,192,597	4,266,942,458
第12計算期間	2012年6月8日～2013年6月7日	571,990,984	573,581,655	4,265,351,787
第13計算期間	2013年6月8日～2014年6月9日	527,137,507	524,028,360	4,268,460,934
第14計算期間	2014年6月10日～2015年6月8日	531,662,638	598,960,649	4,201,162,923
第15中間 計算期間	2015年6月9日～2015年12月8日	249,819,288	252,390,231	4,198,591,980

[次へ](#)

(参考)運用実績

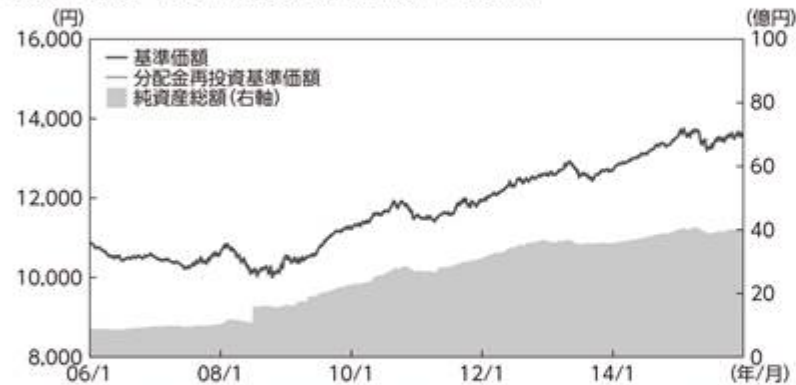
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2015年12月30日現在

Aコース(限定為替ヘッジ)

基準価額・純資産の推移

2006年1月4日～2015年12月30日(設定日:2001年11月22日)



基準価額・純資産総額

基準価額	13,566円
純資産総額	40.4億円

期間別騰落率
(分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	-0.67%
3ヵ月	0.22%
6ヵ月	2.28%
1年	0.06%
3年	7.31%
5年	17.49%
設定来	35.66%

●分配金再投資基準価額および期間別騰落率(分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●基準価額および分配金再投資基準価額は、1万口当たりの値です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	11/6/7	12/6/7	13/6/7	14/6/9	15/6/8	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

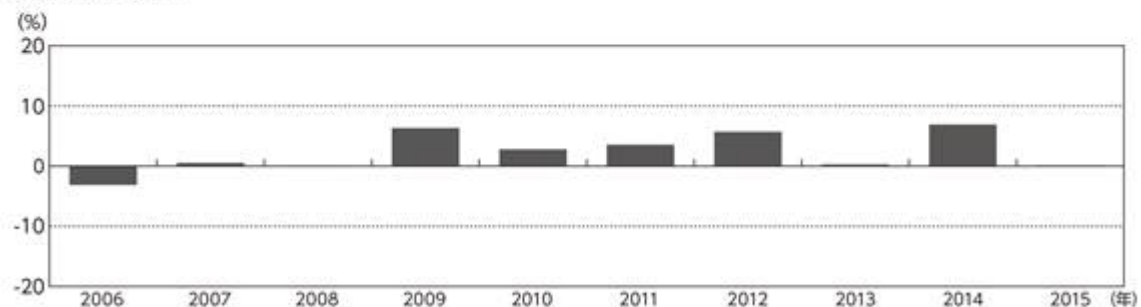
●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	スウェーデン国債 3.75% 2017年8月12日	SEK	1.6年	10.2%
2	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	2.2年	5.2%
3	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	4.7年	4.0%
4	欧州安定メカニズム 0.05% 2018年12月17日	EUR	3.0年	3.6%
5	ドイツ国債 1% 2025年8月15日	EUR	9.6年	3.1%
6	ドイツ復興金融公庫 1.125% 2018年8月6日	USD	2.6年	2.5%
7	第145回利付国債(20年) 1.7% 2033年6月20日	JPY	17.5年	2.2%
8	欧州安定メカニズム 0.1% 2020年11月3日	EUR	4.8年	2.2%
9	第330回利付国債(10年) 0.8% 2023年9月20日	JPY	7.7年	2.1%
10	第118回利付国債(20年) 2% 2030年6月20日	JPY	14.5年	2.0%

●債券現物のみ(先物を除く)の数値です。

年間収益率の推移



●本ファンドの収益率は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

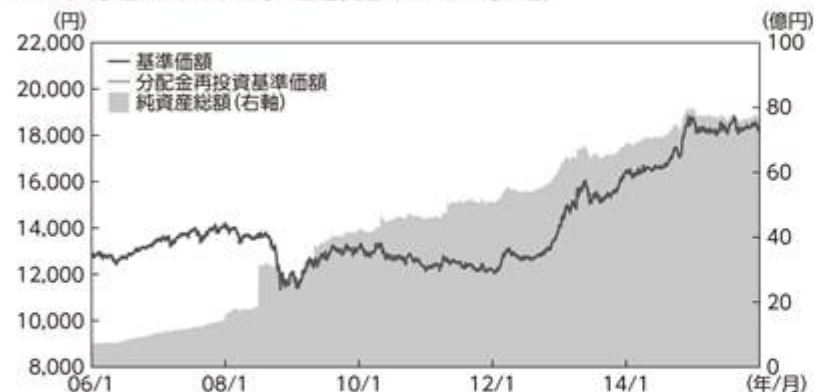
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2015年12月30日現在

Bコース(為替ヘッジなし)

基準価額・純資産の推移

2006年1月4日～2015年12月30日(設定日:2001年11月22日)



基準価額・純資産総額

基準価額	18,217円
純資産総額	76.6億円

期間別騰落率 (分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	-1.25%
3ヵ月	-0.20%
6ヵ月	-0.11%
1年	-2.95%
3年	29.10%
5年	49.93%
設定来	82.17%

●分配金再投資基準価額および期間別騰落率(分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●基準価額および分配金再投資基準価額は、1万口当たりの値です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	11/6/7	12/6/7	13/6/7	14/6/9	15/6/8	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

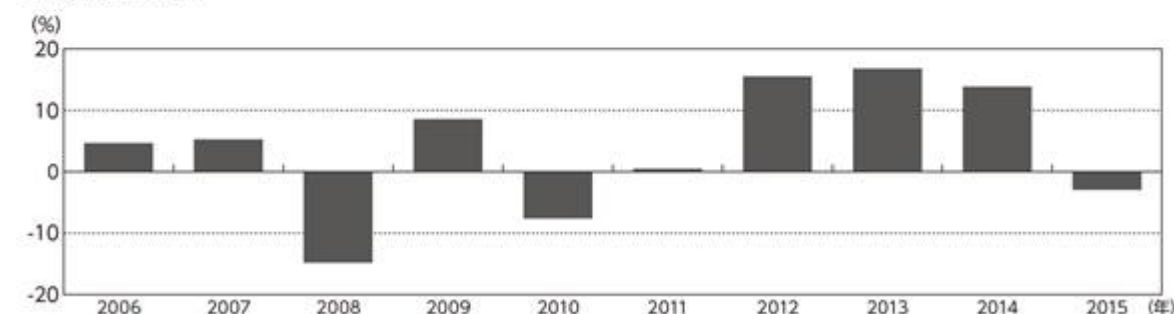
●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	スウェーデン国債 3.75% 2017年8月12日	SEK	1.6年	10.4%
2	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	2.2年	4.9%
3	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	4.7年	3.4%
4	欧州安定メカニズム 0.05% 2018年12月17日	EUR	3.0年	2.6%
5	ドイツ復興金融公庫 1.125% 2018年8月6日	USD	2.6年	2.5%
6	第145回利付国債(20年) 1.7% 2033年6月20日	JPY	17.5年	2.5%
7	欧州安定メカニズム 0.1% 2020年11月3日	EUR	4.8年	2.1%
8	アメリカ国債 2.875% 2043年5月15日	USD	27.4年	2.0%
9	第92回利付国債(20年) 2.1% 2026年12月20日	JPY	11.0年	1.9%
10	フランス国債 4.25% 2023年10月25日	EUR	7.8年	1.9%

●債券現物のみ(先物を除く)の数値です。

年間収益率の推移



●本ファンドの収益率は、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

第3【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

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 1 財務諸表」については、以下の内容が追加されます。

<追加>

- (1) ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）及びゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）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、「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) A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）及びB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第15期中間計算期間（平成27年6月9日から平成27年12月8日まで）の中間財務諸表について、PwC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

【ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 (平成27年6月8日現在)	第15期中間計算期間 (平成27年12月8日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	3,932,261,508	4,048,708,714
未収入金	3,894,640	3,351,028
流動資産合計	3,936,156,148	4,052,059,742
資産合計	3,936,156,148	4,052,059,742
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,894,640	3,351,028
未払受託者報酬	1,077,364	1,068,831
未払委託者報酬	19,392,484	19,238,843
その他未払費用	241,546	231,119
流動負債合計	24,606,034	23,889,821
負債合計	24,606,034	23,889,821
純資産の部		
元本等		
元本	2,946,815,450	2,959,004,899
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	964,734,664	1,069,165,022
（分配準備積立金）	392,927,247	360,476,016
元本等合計	3,911,550,114	4,028,169,921
純資産合計	3,911,550,114	4,028,169,921
負債純資産合計	3,936,156,148	4,052,059,742

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成26年6月10日 至 平成26年12月9日	自	平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
営業収益				
有価証券売買等損益		126,468,443		118,916,395
営業収益合計		126,468,443		118,916,395
営業費用				
受託者報酬		1,041,102		1,068,831
委託者報酬		18,739,855		19,238,843
その他費用		250,640		231,119
営業費用合計		20,031,597		20,538,793
営業利益又は営業損失（ ）		106,436,846		98,377,602
経常利益又は経常損失（ ）		106,436,846		98,377,602
中間純利益又は中間純損失（ ）		106,436,846		98,377,602
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（ ）		3,578,128		4,081,779
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		890,678,540		964,734,664
剰余金増加額又は欠損金減少額		97,970,278		94,578,129
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		97,970,278		94,578,129
剰余金減少額又は欠損金増加額		66,435,240		84,443,594
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		66,435,240		84,443,594
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,025,072,296		1,069,165,022

[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14期 自 平成26年 6月10日 至 平成27年 6月 8日	第15期中間計算期間 自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8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、親投資信託 受益証券の基準価額で評価しており ます。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 平成26年 6月 7日及びその翌日が 休業日のため、当計算期間期首は平 成26年 6月10日としております。ま た、平成27年 6月 7日が休業日のた め、当計算期間末日は平成27年 6月 8日としております。	中間計算期間の取扱い 平成27年 6月 7日が休業日のた め、当中間計算期間期首は平成27年 6月 9日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第14期 (平成27年 6月 8日現在)	第15期中間計算期間 (平成27年12月 8日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	2,858,693,688円	2,946,815,450円
期中追加設定元本額	561,864,661円	272,333,792円
期中一部解約元本額	473,742,899円	260,144,343円
2. 受益権の総数	2,946,815,450口	2,959,004,899口

(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。

(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	第14期 自 平成26年6月10日 至 平成27年6月8日	第15期中間計算期間 自 平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 (2) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1) 有価証券以外の金融商品 同左 (2) 有価証券 同左
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。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	第14期 (平成27年6月8日現在)	第15期中間計算期間 (平成27年12月8日現在)
1口当たり純資産額	1.3274円	1.3613円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

【ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第14期 （平成27年6月8日現在）	第15期中間計算期間 （平成27年12月8日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	7,815,987,360	7,838,225,325
未収入金	9,285,932	1,424,468
流動資産合計	7,825,273,292	7,839,649,793
資産合計	7,825,273,292	7,839,649,793
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,285,932	1,424,468
未払受託者報酬	2,083,645	2,074,562
未払委託者報酬	37,505,550	37,341,980
その他未払費用	309,024	305,166
流動負債合計	49,184,151	41,146,176
負債合計	49,184,151	41,146,176
純資産の部		
元本等		
元本	4,201,162,923	4,198,591,980
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,574,926,218	3,599,911,637
（分配準備積立金）	1,925,865,058	1,814,370,504
元本等合計	7,776,089,141	7,798,503,617
純資産合計	7,776,089,141	7,798,503,617
負債純資産合計	7,825,273,292	7,839,649,793

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第14期中間計算期間		第15期中間計算期間	
	自	平成26年6月10日 至 平成26年12月9日	自	平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
営業収益				
有価証券売買等損益		936,194,077		64,850,954
営業収益合計		936,194,077		64,850,954
営業費用				
受託者報酬		1,994,446		2,074,562
委託者報酬		35,899,905		37,341,980
その他費用		327,817		305,166
営業費用合計		38,222,168		39,721,708
営業利益又は営業損失()		897,971,909		25,129,246
経常利益又は経常損失()		897,971,909		25,129,246
中間純利益又は中間純損失()		897,971,909		25,129,246
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()		18,889,824		4,267,194
期首剰余金又は期首欠損金()		2,862,721,800		3,574,926,218
剰余金増加額又は欠損金減少額		202,248,266		208,933,931
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		202,248,266		208,933,931
剰余金減少額又は欠損金増加額		180,385,368		213,344,952
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		180,385,368		213,344,952
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		3,763,666,783		3,599,911,637

[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14期 自 平成26年 6月10日 至 平成27年 6月 8日	第15期中間計算期間 自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8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、親投資信託 受益証券の基準価額で評価しており ます。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 平成26年 6月 7日及びその翌日が 休業日のため、当計算期間期首は平 成26年 6月10日としております。ま た、平成27年 6月 7日が休業日のた め、当計算期間末日は平成27年 6月 8日としております。	中間計算期間の取扱い 平成27年 6月 7日が休業日のた め、当中間計算期間期首は平成27年 6月 9日としております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区分	第14期 (平成27年 6月 8日現在)	第15期中間計算期間 (平成27年12月 8日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	4,268,460,934円	4,201,162,923円
期中追加設定元本額	531,662,638円	249,819,288円
期中一部解約元本額	598,960,649円	252,390,231円
2. 受益権の総数	4,201,162,923口	4,198,591,980口

(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。

(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	第14期 自 平成26年6月10日 至 平成27年6月8日	第15期中間計算期間 自 平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券以外の金融商品 有価証券以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。 (2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(1) 有価証券以外の金融商品 同左 (2) 有価証券 同左
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。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	第14期 (平成27年6月8日現在)	第15期中間計算期間 (平成27年12月8日現在)
1口当たり純資産額	1.8509円	1.8574円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

[次へ](#)

参考情報

A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）は、「ゴールドマン・サックス・世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）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す。同親投資信託の状況は以下の通りです。

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	(平成27年6月8日現在)	(平成27年12月8日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		5,937,216	42,148,263
コール・ローン		751,866,932	584,555,612
国債証券		25,748,757,368	21,778,521,454
特殊債券		2,213,517,823	4,936,886,659
社債券		8,307,432,581	7,122,205,400
派生商品評価勘定		1,533,179,490	760,611,370
未収入金		2,317,877,913	723,910,722
未収利息		231,639,666	220,369,111
前払費用		36,319,786	11,868,512
差入委託証拠金		157,448,687	137,918,428
流動資産合計		41,303,977,462	36,318,995,531
資産合計		41,303,977,462	36,318,995,531
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,148,931,271	957,224,738
未払金		1,108,436,203	597,220,259
未払解約金		78,952,328	129,030,292
流動負債合計		4,336,319,802	1,683,475,289
負債合計		4,336,319,802	1,683,475,289
純資産の部			
元本等			
元本		24,093,864,686	21,903,918,697
剰余金			
剰余金又は欠損金()		12,873,792,974	12,731,601,545
元本等合計		36,967,657,660	34,635,520,242
純資産合計		36,967,657,660	34,635,520,242
負債純資産合計		41,303,977,462	36,318,995,531

(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26年 6月10日 至 平成27年 6月 8日	自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、法令及び一般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。</p>	<p>国債証券、特殊債券、社債券 同左</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>(2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び一般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。</p>	<p>(1) 為替予約取引 同左</p> <p>(2) 先物取引 同左</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 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。</p> <p>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。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成27年6月8日現在)	(平成27年12月8日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	24,489,506,348円	24,093,864,686円
期中追加設定元本額	9,402,085,085円	2,724,036,272円
期中一部解約元本額	9,797,726,747円	4,913,982,261円
期末元本額	24,093,864,686円	21,903,918,697円
元本の内訳		
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ(確定拠出年金向け)	2,562,902,632円	2,560,529,164円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ(野村SMA向け)	9,169,571,126円	8,969,589,453円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ(野村SMA・EW向け)	1,050,976,915円	2,496,354,975円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Cコース(毎月分配型、限定為替ヘッジ)	874,502,492円	955,108,502円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Aコース(限定為替ヘッジ)	2,232,464,379円	1,974,638,495円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA (限定為替ヘッジ)VA(適格機関投資家専用)	2,270,862,522円	1,981,554,714円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンF (適格機関投資家専用)	1,490,516,644円	925,670,480円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンFVA (適格機関投資家専用)	4,442,067,976円	2,040,472,914円
2. 受益権の総数	24,093,864,686口	21,903,918,697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	自 平成26年6月10日 至 平成27年6月8日	自 平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法	<p>金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。</p> <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、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。なお、市場価格がない場合には、同種商品間の価格比較、同一銘柄の価格推移時系列比較、市場公表指標との整合分析等、定期的な状況確認を踏まえ、外部業者から入手する価格に基づく価額を合理的に算定された価額としております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2) 有価証券 同左</p> <p>(3) デリバティブ取引 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p>

(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

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 債券関連

区分	種類	(平成27年6月8日現在)				(平成27年12月8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	14,195,864,518	-	14,078,468,307	117,396,211	12,670,555,279	-	12,687,549,472	16,994,193
	売建	5,386,556,630	-	5,308,326,784	78,229,846	1,929,135,549	-	1,937,904,846	8,769,297
	合計	19,582,421,148	-	19,386,795,091	39,166,365	14,599,690,828	-	14,625,454,318	8,224,896

(2) 通貨関連

区分	種類	(平成27年6月8日現在)				(平成27年12月8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	29,439,060,934	-	30,109,511,671	670,450,737	19,702,381,752	-	20,013,393,261	311,011,509
	カナダドル	1,975,355,500	-	2,070,450,369	95,094,869	1,906,445,401	-	1,890,118,178	16,327,223
	ユーロ	7,851,342,886	-	8,301,850,263	450,507,377	11,444,297,350	-	11,526,745,682	82,448,332
	英ポンド	1,709,683,561	-	1,769,206,068	59,522,507	1,543,290,070	-	1,563,979,943	20,689,873
	スウェーデン クローナ	596,188,110	-	627,320,056	31,131,946	825,384,444	-	839,540,652	14,156,208
	ノルウェー クローネ	416,698,535	-	427,990,785	11,292,250	515,951,181	-	505,781,224	10,169,957
	オーストラリ アドル	2,450,940,348	-	2,524,540,224	73,599,876	2,278,627,379	-	2,361,645,223	83,017,844
	ニュージーラ ンドドル	1,717,869,509	-	1,700,769,020	17,100,489	1,416,274,438	-	1,456,261,359	39,986,921
	売建								
	米ドル	37,970,540,660	-	39,187,392,088	1,216,851,428	28,280,189,445	-	28,798,700,188	518,510,743
	カナダドル	3,241,946,011	-	3,354,615,123	112,669,112	2,310,856,981	-	2,304,663,558	6,193,423
	ユーロ	21,350,635,981	-	22,732,770,275	1,382,134,294	23,556,506,744	-	23,679,636,474	123,129,730
	英ポンド	5,019,089,161	-	5,128,770,446	109,681,285	4,277,384,923	-	4,262,390,004	14,994,919
	スウェーデン クローナ	682,147,947	-	726,009,614	43,861,667	734,908,778	-	739,666,034	4,757,256
	ノルウェー クローネ	409,227,574	-	427,990,786	18,763,212	330,064,042	-	327,476,821	2,587,221
	デンマーク クローネ	320,175,254	-	348,609,537	28,434,283	319,259,711	-	323,332,510	4,072,799
	オーストラリ アドル	3,189,300,003	-	3,254,153,040	64,853,037	2,757,114,523	-	2,813,189,408	56,074,885
	ニュージーラ ンドドル	1,819,078,727	-	1,796,947,139	22,131,588	1,658,525,307	-	1,704,945,723	46,420,416
合計	120,159,280,701	-	124,488,896,504	1,580,617,657	103,857,462,469	-	105,111,466,242	204,376,759	

(3) 金利関連

区分	種類	（平成27年6月8日現在）				（平成27年12月8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	金利先物取引								
	買建	8,164,175,179	4,078,141,563	8,167,990,951	3,815,772	-	-	-	-
	売建	1,156,503,289	-	1,156,286,820	216,469	2,020,597,951	1,260,861,878	2,021,059,456	461,505
合計	9,320,678,468	4,078,141,563	9,324,277,771	4,032,241	2,020,597,951	1,260,861,878	2,021,059,456	461,505	

(注) 時価の算定方法

・先物取引

- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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、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

- 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。
 - 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。
 - 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。

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計算したレートにより評価しております。

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。
- 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、対顧客相場の仲値により評価しております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	（平成27年6月8日現在）	（平成27年12月8日現在）
1口当たり純資産額	1.5343円	1.5812円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）は、「ゴールドマン・サックス・世界債券オープンBコース（為替ヘッジなし）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す。同親投資信託の状況は以下の通りです。

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	（平成27年6月8日現在）	（平成27年12月8日現在）
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		-	246,476,013
コール・ローン		1,679,424,421	2,255,811,832
国債証券		50,843,322,448	43,172,183,513
特殊債券		9,068,123,378	10,510,816,833
社債券		21,374,974,963	17,745,902,051
派生商品評価勘定		3,947,719,970	1,684,870,519
未収入金		3,272,227,972	1,703,532,322
未収利息		598,050,090	477,415,204
前払費用		75,031,710	10,298,236
差入委託証拠金		397,098,749	372,289,364
流動資産合計		91,255,973,701	78,179,595,887
資産合計		91,255,973,701	78,179,595,887
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,005,485,377	1,394,224,951
未払金		3,375,399,147	234,152,105
未払解約金		131,365,011	254,899,114
流動負債合計		7,512,249,535	1,883,276,170
負債合計		7,512,249,535	1,883,276,170
純資産の部			
元本等			
元本		37,047,479,783	33,470,029,933
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		46,696,244,383	42,826,289,784
元本等合計		83,743,724,166	76,296,319,717
純資産合計		83,743,724,166	76,296,319,717
負債純資産合計		91,255,973,701	78,179,595,887

(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26年 6月10日 至 平成27年 6月 8日	自 平成27年 6月 9日 至 平成27年12月 8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、法令及び一般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。</p>	<p>国債証券、特殊債券、社債券 同左</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>(2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び一般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。</p>	<p>(1) 為替予約取引 同左</p> <p>(2) 先物取引 同左</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 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。</p> <p>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。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準 同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成27年6月8日現在)	(平成27年12月8日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	46,312,207,972円	37,047,479,783円
期中追加設定元本額	5,936,897,555円	2,488,951,831円
期中一部解約元本額	15,201,625,744円	6,066,401,681円
期末元本額	37,047,479,783円	33,470,029,933円
元本の内訳		
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)	3,457,789,489円	3,438,572,198円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし(野村SMA向け)	6,306,598,168円	5,916,353,944円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし(野村SMA・EW向け)	1,015,311,728円	2,888,161,144円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Dコース(毎月分配型、為替ヘッジなし)	372,843,983円	352,864,702円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープン Bコース(為替ヘッジなし)	2,066,979,494円	1,951,323,847円
ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB (為替ヘッジなし)VA(適格機関投資家専用)	23,827,956,921円	18,922,754,098円
2. 受益権の総数	37,047,479,783口	33,470,029,933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	自 平成26年6月10日 至 平成27年6月8日	自 平成27年6月9日 至 平成27年12月8日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法	<p>金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。</p> <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、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。なお、市場価格がない場合には、同種商品間の価格比較、同一銘柄の価格推移時系列比較、市場公表指標との整合分析等、定期的な状況確認を踏まえ、外部業者から入手する価格に基づく価額を合理的に算定された価額としております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2) 有価証券 同左</p> <p>(3) デリバティブ取引 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p>

(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

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 債券関連

区分	種類	(平成27年6月8日現在)				(平成27年12月8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	38,798,645,267	-	38,515,625,742	283,019,525	28,221,447,837	-	28,243,339,180	21,891,343
	売建	18,795,253,060	-	18,539,925,241	255,327,819	7,224,416,863	-	7,234,161,585	9,744,722
	合計	57,593,898,327	-	57,055,550,983	27,691,706	35,445,864,700	-	35,477,500,765	12,146,621

(2) 通貨関連

区分	種類	(平成27年6月8日現在)				(平成27年12月8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	56,412,001,715	-	58,315,155,488	1,903,153,773	48,282,504,302	-	49,091,057,718	808,553,416
	カナダドル	5,154,402,612	-	5,389,428,787	235,026,175	4,375,408,552	-	4,336,211,931	39,196,621
	ユーロ	16,438,131,261	-	17,443,727,278	1,005,596,017	24,334,909,396	-	24,480,645,789	145,736,393
	英ポンド	4,026,340,334	-	4,166,968,884	140,628,550	3,330,610,966	-	3,375,883,025	45,272,059
	スウェーデン クローナ	1,452,392,551	-	1,527,040,789	74,648,238	1,771,824,032	-	1,802,251,969	30,427,937
	ノルウェー クローネ	958,139,187	-	983,896,385	25,757,198	1,093,046,014	-	1,071,453,734	21,592,280
	オーストラリ アドル	6,347,401,285	-	6,517,373,082	169,971,797	5,472,859,781	-	5,644,285,773	171,425,992
	ニュージーラ ンドドル	3,930,019,403	-	3,890,842,730	39,176,673	3,096,261,877	-	3,184,858,076	88,596,199
	売建								
	米ドル	43,711,550,092	-	45,093,533,063	1,381,982,971	41,215,276,304	-	41,846,189,640	630,913,336
	カナダドル	6,358,106,711	-	6,605,121,219	247,014,508	4,349,330,761	-	4,350,553,859	1,223,098
	ユーロ	24,053,342,300	-	25,526,803,009	1,473,460,709	28,141,356,319	-	28,207,667,115	66,310,796
	英ポンド	4,951,841,132	-	5,151,489,632	199,648,500	3,420,136,691	-	3,438,023,845	17,887,154
	スウェーデン クローナ	1,391,872,599	-	1,487,690,730	95,818,131	1,400,209,215	-	1,407,370,289	7,161,074
	ノルウェー クローネ	940,764,523	-	983,896,386	43,131,863	702,649,647	-	697,214,062	5,435,585
	デンマーク クローネ	177,618,232	-	193,392,240	15,774,008	236,528,850	-	239,546,250	3,017,400
	オーストラリ アドル	7,089,171,695	-	7,237,624,455	148,452,760	5,591,515,909	-	5,715,566,688	124,050,779
	ニュージーラ ンドドル	4,151,987,243	-	4,101,214,838	50,772,405	3,628,859,531	-	3,733,453,764	104,594,233
	合計	187,545,082,875	-	194,615,198,995	38,905,970	180,443,288,147	-	182,622,233,527	279,500,810

(3) 金利関連

区分	種類	(平成27年6月8日現在)				(平成27年12月8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	金利先物取引								
	買建	18,518,740,663	9,250,420,509	18,527,394,109	8,653,446	-	-	-	-
	売建	2,720,776,924	-	2,720,598,101	178,823	4,408,582,412	2,750,973,904	4,409,584,275	1,001,863
合計	21,239,517,587	9,250,420,509	21,247,992,210	8,832,269	4,408,582,412	2,750,973,904	4,409,584,275	1,001,863	

(注) 時価の算定方法

・先物取引

- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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、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

- 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。
 - 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。
 - 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。

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計算したレートにより評価しております。

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。
- 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、対顧客相場の仲値により評価しております。

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	(平成27年6月8日現在)	(平成27年12月8日現在)
1口当たり純資産額	2.2604円	2.2795円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

[次へ](#)

2 ファンドの現況

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 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

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）>

（平成27年12月30日現在）

資産総額	4,038,406,477円
負債総額	2,518,781円
純資産総額（ - ）	4,035,887,696円
発行済口数	2,974,966,963口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3566円

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）>

（平成27年12月30日現在）

資産総額	7,667,113,997円
負債総額	4,804,916円
純資産総額（ - ）	7,662,309,081円
発行済口数	4,206,058,755口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8217円

参考情報

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A コース（限定為替ヘッジ）マザーファンド>

（平成27年12月30日現在）

資産総額	34,958,430,581円
負債総額	317,425,667円
純資産総額（ - ）	34,641,004,914円
発行済口数	21,971,210,393口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5767円

<ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B コース（為替ヘッジなし）マザーファンド>

（平成27年12月30日現在）

資産総額	75,025,126,209円
負債総額	720,353,757円
純資産総額（ - ）	74,304,772,452円
発行済口数	33,214,052,618口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2371円

第三部【委託会社等の情報】

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「第三部 委託会社等の情報 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>

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。

委託会社の運用するファンド

2016年1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	108	1,617,782,740,022
合計	108	1,617,782,740,022

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 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. 財務諸表及び中間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。

当社の中間財務諸表は、「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条及び第57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、財務諸表及び中間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20期事業年度（平成26年4月1日から平成27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。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた監査法人の中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているあらた監査法人は、平成27年7月1日に名称を変更し、PwCあらた監査法人となりました。

(1) 貸借対照表

期別		第19期 (平成26年3月31日現在)			第20期 (平成27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			6,190,481			6,748,612	
有価証券			15,497,189			13,297,906	
支払委託金			38			39	
収益分配金		38			39		
前払費用			-			18	
未収委託者報酬			1,629,300			1,842,228	
未収運用受託報酬			1,149,245			1,578,480	
未収収益			90,505			368,604	
立替金			2			-	
預け金			2,290			-	
繰延税金資産			810,563			826,971	
流動資産計			25,369,618	88.8		24,662,860	88.5
固定資産							
投資その他の資産			3,209,508			3,193,568	
投資有価証券		1,515,755			1,596,511		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,683,753			1,587,056		
固定資産計			3,209,508	11.2		3,193,568	11.5
資産合計			28,579,127	100.0		27,856,428	100.0

期別		第19期 (平成26年3月31日現在)			第20期 (平成27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			265			599	
未払金			539,515			585,816	
未払収益分配金		203			229		
未払償還金		72			72		
未払手数料		539,240			585,514		
未払費用			3,077,924			3,406,376	
未払法人税等			2,327,419			957,171	
未払消費税等			154,504			470,936	
流動負債計			6,099,629	21.3		5,420,899	19.5
固定負債							
長期未払費用			5,610,919			6,285,478	
その他固定負債			650			-	
固定負債計			5,611,569	19.6		6,285,478	22.6
負債合計			11,711,198	41.0		11,706,378	42.0

期別	第19期 (平成26年3月31日現在)			第20期 (平成27年3月31日現在)			
純資産の部							
科目		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			15,752,528			14,867,795	
その他利益剰余金		15,752,528			14,867,795		
繰越利益剰余金		15,752,528			14,867,795		
株主資本合計			16,632,528	58.2		15,747,795	56.5
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		235,400			402,254		
評価・換算差額等合計			235,400	0.8		402,254	1.4
純資産合計			16,867,928	59.0		16,150,050	58.0
負債・純資産合計			28,579,127	100.0		27,856,428	100.0

(2) 損益計算書

期別		第19期 自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日			第20期 自 平成26年 4月 1日 至 平成27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			13,635,195			14,066,674		
		運用受託報酬	* 2		9,656,904			9,173,012		
		その他営業収益	* 2		6,207,085			5,932,747		
		営業収益計			29,499,185	100.0		29,172,434	100.0	
		営業費用								
		支払手数料			6,962,756			6,754,210		
		広告宣伝費			144,681			139,448		
		調査費			5,933,889			6,692,987		
		委託調査費	* 2	5,933,889				6,692,987		
		委託計算費			223,678			220,885		
		営業雑経費			461,100			384,844		
		通信費		255,040				205,675		
		印刷費		177,694				147,770		
		協会費		28,365				31,398		
		営業費用計			13,726,106	46.5		14,192,375	48.6	
		一般管理費								
		給料			7,256,790			7,106,650		
		役員報酬		206,318				228,309		
		給料・手当		2,653,784				2,654,259		
		賞与		1,204,783				1,251,694		
		株式従業員報酬	* 1	1,588,176				1,027,305		
		その他の報酬		1,603,726				1,945,082		
		交際費			51,545			84,594		
		寄付金			21,662			71,518		
		旅費交通費			180,749			234,673		
		租税公課			132,233			83,891		
		不動産賃借料			563,642			416,707		
		退職給付費用			1,238,747			842,766		
		事務委託費			381,217			376,536		
		諸経費			1,348,001			998,793		
一般管理費計			11,174,589	37.9		10,216,131	35.0			
営業利益			4,598,489	15.6		4,763,926	16.3			

期別		第19期 自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日			第20期 自 平成26年4月1日 至 平成27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	営業外収益							
	収益分配金			104,727			49,958	
	受取利息			17,522			18,605	
	投資有価証券売却益			320,553			36,653	
	雑益			1,661			1,332	
	営業外収益計			444,464	1.5		106,549	0.4
	営業外費用							
	支払利息			-			138	
	株式従業員報酬	* 1		292,295			434,620	
	為替差損			40,483			33,391	
	投資有価証券売却損			491			1,065	
	営業外費用計			333,269	1.1		469,216	1.6
経常利益				4,709,683	16.0		4,401,260	15.1
税引前当期純利益				4,709,683	16.0		4,401,260	15.1
法人税、住民税及び事業税				2,774,220	9.4		2,267,605	7.8
法人税等調整額				592,957	2.0		18,387	0.1
当期純利益				2,528,421	8.6		2,115,267	7.3

(3) 株主資本等変動計算書

第19期

(自平成25年4月1日 至平成26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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成25年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	13,224,106	13,224,106	14,104,106	257,467	257,467	14,361,574
事業年度中の変動額									
当期純利益				2,528,421	2,528,421	2,528,421			2,528,421
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							22,067	22,067	22,067
事業年度中の変動額合計	-	-	-	2,528,421	2,528,421	2,528,421	22,067	22,067	2,506,354
平成26年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,752,528	15,752,528	16,632,528	235,400	235,400	16,867,928

第20期

(自平成26年4月1日 至平成27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 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成26年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	15,752,528	15,752,528	16,632,528	235,400	235,400	16,867,928
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000			3,000,000
当期純利益				2,115,267	2,115,267	2,115,267			2,115,267
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							166,854	166,854	166,854
事業年度中の変動額合計	-	-	-	884,732	884,732	884,732	166,854	166,854	717,878
平成27年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	14,867,795	14,867,795	15,747,795	402,254	402,254	16,150,050

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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法によっております。</p> <p>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。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</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>(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（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。</p> <p>(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。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第19期 (平成26年3月31日現在)	第20期 (平成27年3月31日現在)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(損益計算書関係)

第19期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	第20期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)																		
<p>* 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が、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。</p> <p>* 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。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">営業収益</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">6,098,382千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">営業費用</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">5,933,889千円</td> </tr> </table>	営業収益		その他営業収益	6,098,382千円	営業費用		委託調査費	5,933,889千円	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">営業収益</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,942,406千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">5,828,635千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">営業費用</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">6,692,987千円</td> </tr> </table>	営業収益		運用受託報酬	2,942,406千円	その他営業収益	5,828,635千円	営業費用		委託調査費	6,692,987千円
営業収益																			
その他営業収益	6,098,382千円																		
営業費用																			
委託調査費	5,933,889千円																		
営業収益																			
運用受託報酬	2,942,406千円																		
その他営業収益	5,828,635千円																		
営業費用																			
委託調査費	6,692,987千円																		

（株主資本等変動計算書関係）

第19期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．配当に関する事項

該当事項はありません。

第20期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年12月12日 臨時株主総会	普通株式	3,000,000	468,750	平成26年12月18日	平成26年12月18日

（リース取引関係）

第19期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27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

（金融商品関係）

第19期
（自 平成25年4月1日
至 平成26年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

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、コマーシャル・ペーパー、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び投資有価証券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。投資有価証券は事業推進目的のために保有する当社設定の投資信託であります。

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、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、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。

コマーシャル・ペーパーに関しましては、主にゴールドマン・サックスのグループ会社が発行するものとし、定期的に見直すことによって信用リスクを管理しております。

また、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬に関しては、過去に回収できなかったケースは無く、特に未収委託者報酬に関しては、受託者たる信託銀行で分別管理されている当社が運用する信託財産から受領するため、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、外貨建資産負債の純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。また、当社は事業推進目的のために当社設定の投資有価証券を保有していることから、基準価額の変動による価格変動リスクに晒されております。係る投資有価証券については運用を行う資産の種類を文書に定め、取得にあたり事前に社内委員会にて検討・承認をし、保有の目的が達成されたと判断された時点で適時処分しております。

流動性および資金調達リスク

当社は総資産の75%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの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。

第19期
(自 平成25年4月1日
至 平成26年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成26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	6,190,481	6,190,481	-
有価証券			
其他有価証券	15,497,189	15,497,189	-
未収委託者報酬	1,629,300	1,629,300	-
未収運用受託報酬	1,149,245	1,149,245	-
投資有価証券			
其他投資有価証券	1,515,755	1,515,755	-

金融商品の時価の算定方法

現金・預金、有価証券、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬については、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。投資有価証券については、投資信託であり、直近の基準価額によっております。

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(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	6,190,481	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券のうち満期があるもの	15,500,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,629,300	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,149,245	-	-	-	-	-

第20期
（自 平成26年4月1日
至 平成27年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

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、コマーシャル・ペーパー、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び投資有価証券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。投資有価証券は事業推進目的のために保有する当社設定の投資信託であります。

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

当社の信用リスクは主に、銀行預金、コマーシャル・ペーパー、営業債権（当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬等）に係るものがあります。

銀行預金に係る信用リスクについては、預金先銀行の信用力を口座開設時およびその後継続的に評価することによって管理しております。

コマーシャル・ペーパーに係る信用リスクについては、発行体をゴールドマン・サックスのグループ会社とし、定期的に金額その他条件を見直すことによって管理しております。

また、営業債権は一年以内に回収される債権であり、社内規程に沿ってリスク管理を行っております。なお、過去に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できなかったケースはございません。

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、外貨建資産負債の純額が予め社内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。また、当社は事業推進目的のために当社設定の投資有価証券を保有していることから、基準価額の変動による価格変動リスクに晒されております。係る投資有価証券については運用を行う資産の種類を文書に定め、取得にあたり事前に社内委員会にて検討・承認をし、保有の目的が達成されたと判断された時点で適時処分しております。

流動性および資金調達リスク

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、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、ゴールドマン・サックスのグループ会社との間で融資枠を設定し、緊急時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。

第20期
(自 平成26年4月1日
至 平成27年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成27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	6,748,612	6,748,612	-
有価証券			
其他有価証券	13,297,906	13,297,906	-
未収委託者報酬	1,842,228	1,842,228	-
未収運用受託報酬	1,578,480	1,578,480	-
投資有価証券			
其他投資有価証券	1,596,511	1,596,511	-

金融商品の時価の算定方法

現金・預金、有価証券、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬については、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。投資有価証券については、投資信託であり、直近の基準価額によっております。

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(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	6,748,612	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券のうち満期があるもの	13,300,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,842,228	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,578,480	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）					第20期 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）				
1. その他有価証券で時価のあるもの					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）	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	1,140,000	1,505,843	365,843	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	1,002,000	1,596,511	594,511
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	10,000	9,912	88	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	13,297,906	13,297,906	-
	コマーシャル・ペーパー	15,497,189	15,497,189	-					
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券					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）			売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）		
2,610,062	320,553	491			285,818	36,653	1,065		

（デリバティブ取引関係）

第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）	第20期 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27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19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）	第20期 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、退職給付制度を採用しておりません。</p> <p>2. 退職給付費用に関する事項</p> <p>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。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付費用に関する事項</p> <p>同左</p>

（税効果会計関係）

第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）	第20期 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）
<p>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</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <p>未払費用 634,857千円</p> <p>未払事業税 165,496</p> <p>その他 10,209</p> <p style="text-align: right;">小計 810,563</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p>繰延税金資産（流動資産）の純額 810,563</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,773,080</p> <p>その他 41,028</p> <p style="text-align: right;">小計 1,814,108</p> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <p>その他有価証券評価差額金 130,355</p> <p style="text-align: right;">小計 130,355</p> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額 1,683,753千円</p>	<p>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</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <p>未払費用 735,838千円</p> <p>未払事業税 67,023</p> <p>その他 24,108</p> <p style="text-align: right;">小計 826,971</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p>繰延税金資産（流動資産）の純額 826,971</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,710,136</p> <p>その他 69,177</p> <p style="text-align: right;">小計 1,779,313</p> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <p>その他有価証券評価差額金 192,256</p> <p style="text-align: right;">小計 192,256</p> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額 1,587,056千円</p>
<p>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</p> <p>法定実効税率 38.01 %</p> <p>（調整）</p> <p>賞与等永久に損金に算入されない項目 7.42 %</p> <p>その他 0.89 %</p> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 46.31 %</p>	<p>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</p> <p>法定実効税率 35.64 %</p> <p>（調整）</p> <p>賞与等永久に損金に算入されない項目 10.62 %</p> <p>法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正 5.57 %</p> <p>その他 0.11 %</p> <p>税効果会計適用後の法人税等の負担率 51.94 %</p>

<p style="text-align: center;">第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第20期 （自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日）</p>
<p>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</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）により開始され、平成26年4月1日に開始する事業年度まで適用される予定だった復興特別法人税が、平成25年4月1日に開始する事業年度をもって廃止されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異について従来の38.01%から35.64%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は45百万円減少し、法人税等調整額が53百万円増加しております。</p>	<p>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</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率及び事業税率の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は225百万円減少し、法人税等調整額が245百万円増加しております。</p>

〔セグメント情報等〕

第19期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	13,635,195	9,656,904	6,207,085	29,499,185

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	米国	その他	合計
24,320,243	4,007,386	1,171,554	29,499,185

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

第20期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	14,066,674	9,173,012	5,932,747	29,172,434

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
25,087,105	4,085,328	29,172,434

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

（関連当事者情報）

第19期 （自 平成25年4月1日 至 平成26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	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 ニューヨーク州	8 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 委託調査費の支払（注1）	6,098,382 5,933,889		
取引条件及び取引条件の決定方針等 （注1）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。										
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 有価証券 の購入	兼務従業員の 人件費等の支 払（注1）	2,207,798	有価証券 未払費用	15,497,189 278,488
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 有限公司	東京都港区	100 百万円	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） 営業費用及 び一般管理 費 株式従業員 報酬	8,427,134 272,838	未払費用 長期未払 費用	2,505,305 5,560,064
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 ニューヨーク州	8,000 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	1,760,744
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	71 百万ドル	投資顧問業		投資助言	運用受託報酬 （注3）	3,329,598		
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、グループ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公司（以下GSJH）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より行われております。 但し、これらの費用はGSJH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 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20期
（自 平成26年4月1日
至 平成27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	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 ニューヨーク州	8 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 運用受託報酬（注1） 委託調査費の支払（注1）	5,828,635 2,942,406 6,692,987		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）その他営業収益、運用受託報酬、ならびに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。

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 役員との兼任 有価証券の購入	兼務従業員の 人件費等の支払（注1）	2,452,937	有価証券 未払費用	13,297,906 287,201
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 百万円	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 役員との兼任	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	6,803,100	未払費用 長期未払 費用	2,791,417 6,188,739
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 ニューヨーク州	8,000 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	1,975,463
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	37 百万ドル	投資顧問業		投資助言			未収収益	354,819

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、グループ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G S J H）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G S J Hより行われております。

但し、これらの費用はG S J H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G S J H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

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19期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）		第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	
1株当たり純資産額	2,635,613円85銭	1株当たり純資産額	2,523,445円38銭
1株当たり当期純利益金額	395,065円83銭	1株当たり当期純利益金額	330,510円53銭
損益計算書上の当期純利益	2,528,421千円	損益計算書上の当期純利益	2,115,267千円
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	2,528,421千円	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	2,115,267千円
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。

[次へ](#)

1. 中間財務諸表
 (1) 中間貸借対照表

区分	注記 番号	第21期中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		7,184,783	
有価証券		16,597,059	
支払委託金		26	
前払費用		2,366	
未収委託者報酬		1,784,787	
未収運用受託報酬		1,972,129	
未収収益		66,812	
繰延税金資産		1,166,824	
流動資産計		28,774,788	91.9
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		573,290	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,950,818	
投資その他の資産計		2,534,108	
固定資産計		2,534,108	8.1
資産合計		31,308,897	100.0

区分	注記 番号	第21期中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		276	
未払金		575,588	
未払費用		4,256,383	
未払法人税等		1,526,914	
未払消費税	* 1	178,034	
流動負債計		6,537,198	20.9
固定負債			
長期未払費用		7,335,406	
固定負債計		7,335,406	23.4
負債合計		13,872,604	44.3

区分	注記 番号	第21期中間会計期間末 (平成27年9月30日)	
		金額	構成比
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		490,000	
資本剰余金			
資本準備金		390,000	
資本剰余金合計		390,000	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		16,506,646	
利益剰余金合計		16,506,646	
株主資本合計		17,386,646	55.5
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		49,646	
評価・換算差額等合計		49,646	
純資産合計		17,436,292	55.7
負債・純資産合計		31,308,897	100.0

(2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第21期中間会計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		7,818,399	
運用受託報酬		5,431,519	
その他営業収益		2,796,719	
営業収益計		16,046,638	100.0
営業費用及び一般管理費		14,093,602	87.8
営業利益		1,953,036	12.2
営業外収益	* 1	717,958	4.5
営業外費用	* 2	8	0.0
経常利益		2,670,985	16.6
税引前中間純利益		2,670,985	16.6
法人税、住民税及び事業税		1,567,136	9.8
法人税等調整額		535,001	3.3
中間純利益		1,638,850	10.2

重要な会計方針

項目	第21期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>時価をもって中間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。</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金</p> <p>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。</p> <p>(2) 金融商品取引責任準備金</p> <p>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。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>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公司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。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>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。</p> <p>(3) 決算日の変更に関する事項</p> <p>当社は平成27年6月26日開催の株主総会で決算日を3月31日から12月31日に変更致しました。これに伴い、平成27年12月期の会計年度は平成27年4月1日から平成27年12月31日までの9ヶ月間となります。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第21期中間会計期間末 (平成27年9月30日)
* 1 消費税等の取扱い	控除対象の仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債に表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第21期中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)
* 1 営業外収益のうち主要なもの	収益分配金 502,884千円 株式従業員報酬 126,859千円
* 2 営業外費用のうち主要なもの	投資有価証券売却損 8千円

（リース取引関係）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30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。

（金融商品関係）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成27年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、中間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）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	7,184,783	7,184,783	-
有価証券			
その他有価証券	16,597,059	16,597,059	-
未収委託者報酬	1,784,787	1,784,787	-
未収運用受託報酬	1,972,129	1,972,129	-
投資有価証券			
その他有価証券	573,290	573,290	-

金融商品の時価の算定方法

投資有価証券以外の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。

投資有価証券につきましては、投資信託のため、直近の基準価額によっております。

（有価証券関係）

第21期中間会計期間末（平成27年9月30日）

その他有価証券で時価のあるもの

（単位：千円）

区分	種類	取得原価	中間貸借対照表計上額	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	500,000	573,290	73,290
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	16,597,059	16,597,059	-

（デリバティブ取引関係）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30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。

（セグメント情報等）

第21期中間会計期間（自平成27年4月1日 至平成27年9月30日）

〔セグメント情報〕

当社の報告セグメントは、投資運用業者として単一であるため、該当事項はありません。

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ ファンド関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	7,818,399	5,431,519	2,796,719	16,046,638

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	米国	その他	合計
13,147,415	1,818,544	1,080,679	16,046,638

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、該当事項はありません。

(1株当たり情報)

第21期中間会計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)	
1株当たり純資産額	2,724,420円72銭
1株当たり中間純利益金額	256,070円43銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間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いません。	
(1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎)	
中間損益計算書上の中間純利益	1,638,850千円
1株当たり中間純利益金額の算定に用いられた普通株式に係る中間純利益	1,638,850千円
差 額	- 千円
期中平均株式数	
普通株式	6,400株

(重要な後発事象)

第21期中間会計期間（自平成27年 4月 1日 至平成27年 9月30日）

該当事項はありません。

[次へ](#)

5 その他

<訂正前>

- (1) 委託会社に関し、定款の変更、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。
(後略)

<訂正後>

- (1) 株主総会の決議により、2015年6月26日付けで事業年度の変更に関する定款の変更を、2016年1月1日付けで株券の不発行に関する定款の変更を行いました。出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。
(後略)

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 投資顧問会社

(2014年12月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル(GSAMロンドン)	1,756千米ドル (212百万円 1米ドル=120.55円)	GSAMロンドンは、主として英国において業務を行うザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクの関連企業です。GSAMロンドンおよびその投資顧問関連企業は、現在、投資信託、公的年金・企業年金、各種公益基金、銀行、保険会社、事業法人および個人投資家を含む広範囲の顧客にサービスを提供しています。
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(GSAMニューヨーク)	8百万米ドル (964百万円 1米ドル=120.55円)	GSAMニューヨークは、米国において、内外の有価証券等に係る投資顧問業務およびその他付帯関連する一切の業務を営んでいます。
ゴールドマン・サックス(シンガポール)ピーティーイー(GSAMシンガポール)	287百万米ドル (34,598百万円 1米ドル=120.55円)	GSAMシンガポールは、シンガポールにおいて、投資銀行業務、トレーディングおよび自己勘定投資ならびに証券関連サービスを営んでおり、その資産運用部門は内外の有価証券等に係る投資顧問業務、その他付帯関連する一切の業務を営んでいます。

(2) 受託銀行

(2015年3月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	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。

(3) 販売会社

(2015年3月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を中心としたサービスを提供しています。

2 関係業務の概要

(1) 投資顧問会社

G S A M ロンドン、G S A M ニューヨークおよびG S A M シンガポールは本ファンドおよびマザーファンドの投資顧問会社であり、本ファンドに関し、委託会社より債券および通貨の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断・発注等を行っています。

(2) 受託銀行

本ファンドの受託者として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(3) 販売会社

本ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行います。

3 資本関係

(1) 投資顧問会社

G S A M ロンドン、G S A M ニューヨーク、G S A M シンガポールおよび委託会社はいずれもザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクの子会社です。

(2) 受託銀行

該当事項はありません。

(3) 販売会社

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28年1月20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

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木貴司
指定社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

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」に掲げられているゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）の平成27年6月9日から平成27年12月8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、ゴールドマン・サックス・世界債券オープンA 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）の平成27年12月8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27年6月9日から平成27年12月8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

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）財務諸表の範囲にはX B R L データ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月20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

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木貴司
指定社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

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」に掲げられているゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）の平成27年6月9日から平成27年12月8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、ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB 為替ヘッジなし（確定拠出年金向け）の平成27年12月8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27年6月9日から平成27年12月8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

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）財務諸表の範囲にはX B R L 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27年6月1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 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、「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26年4月1日から平成27年3月31日までの第20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、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27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、その原本は当社が別途保管しております。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成27年12月1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

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木貴司
指定社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

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27年4月1日から平成27年12月31日までの第21期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記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、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27年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の経営成績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

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

（注）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。