

【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29年2月24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28年8月26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>

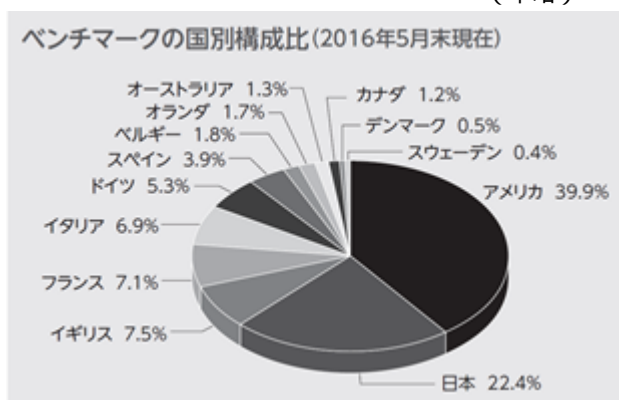
(1) ファンドの目的及び基本的性格

本ファンドは、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）マザーファンドまたはゴールドマン・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（両者を総称して以下「マザーファンド」といいます。）への投資を通じて、日本を含む世界各国の債券へ分散投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

（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）

期間：1998年6月末～2016年5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

（中略）

<高格付け債券への投資>

（中略）

米国社債の格付け別債務不履行率と利回り格差



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～2015年 出所：S & P

1981年～2015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。（2015年12月末現在）

< 上乗せ金利 >

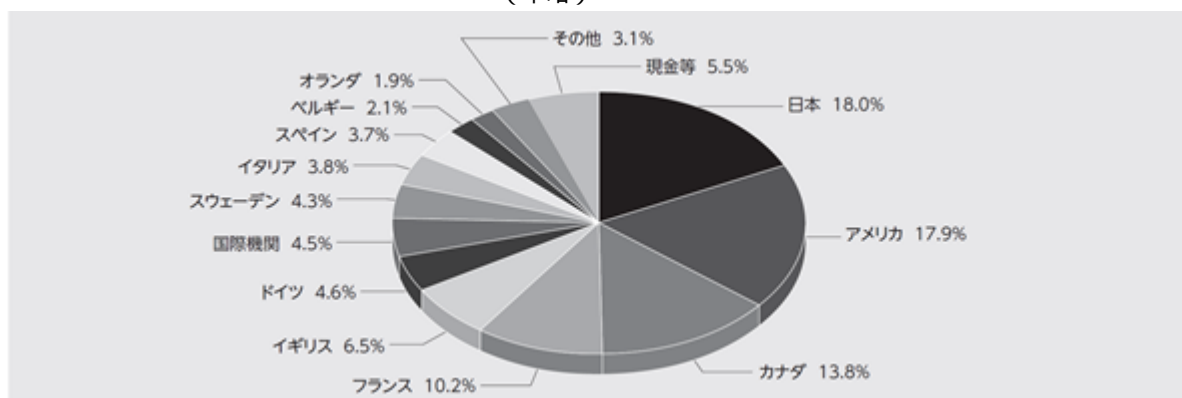
2016年5月末現在 出所：パークレイズ

< 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）

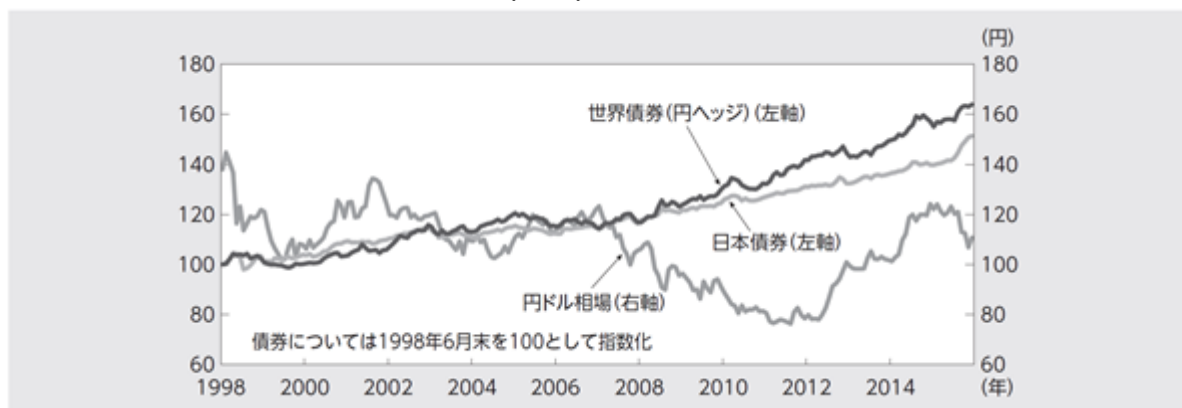


2016年5月末現在

（中略）

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～2016年5月末

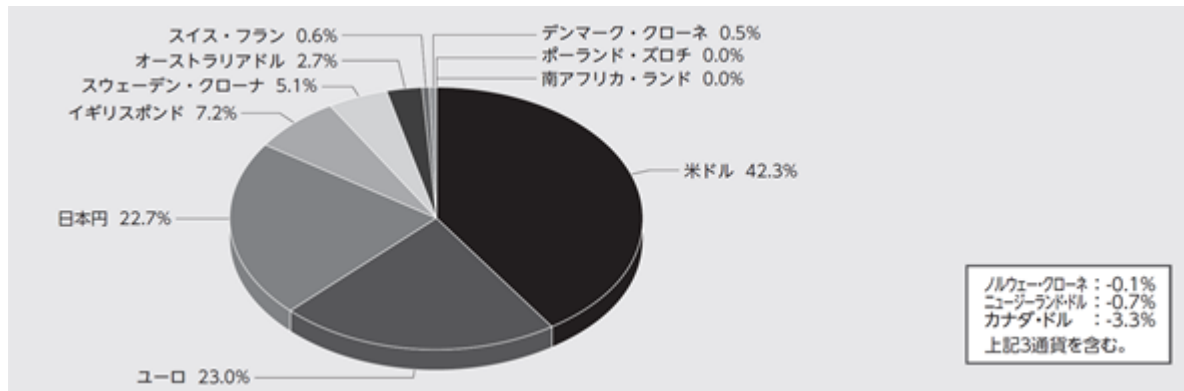
（中略）

< 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）

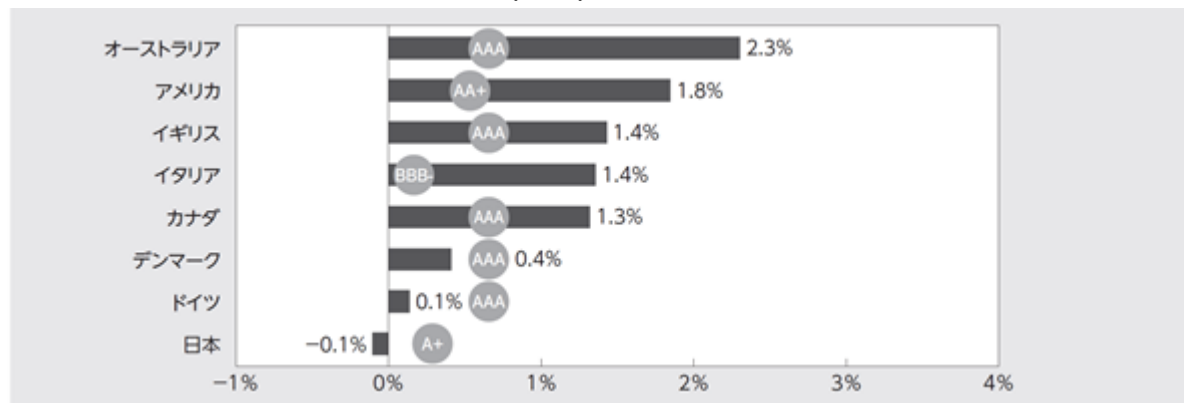


2016年5月末現在

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

（中略）



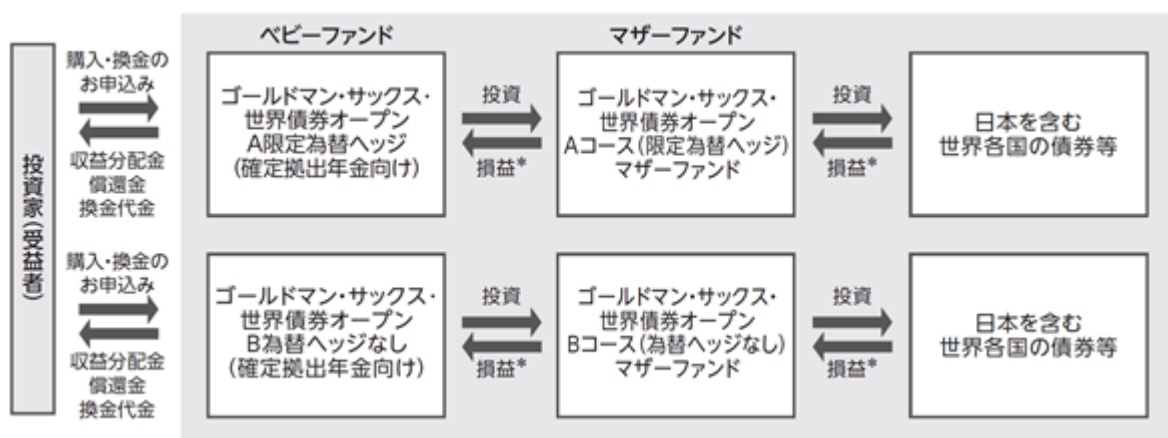
2016年5月末現在

（中略）

(3) ファンドの仕組み

1. ファンドの仕組み

（中略）



* 損益はすべて投資家である受益者に帰属します。

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 (GSAM) 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(GS AM)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。

(後略)

<訂正後>

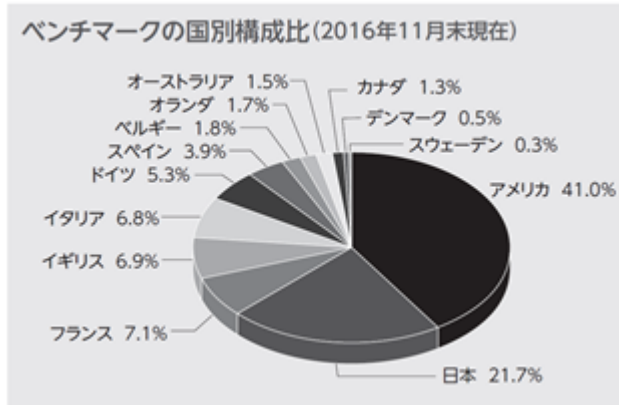
(1) ファンドの目的及び基本的性格

本ファンドは、世界債券オープンAコース(限定為替ヘッジ)マザーファンドまたは世界債券オープンBコース(為替ヘッジなし)マザーファンド(両者を総称して以下「マザーファンド」といいます。)への投資を通じて、日本を含む世界各国の債券へ分散投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

(中略)

<ファンドのベンチマーク>

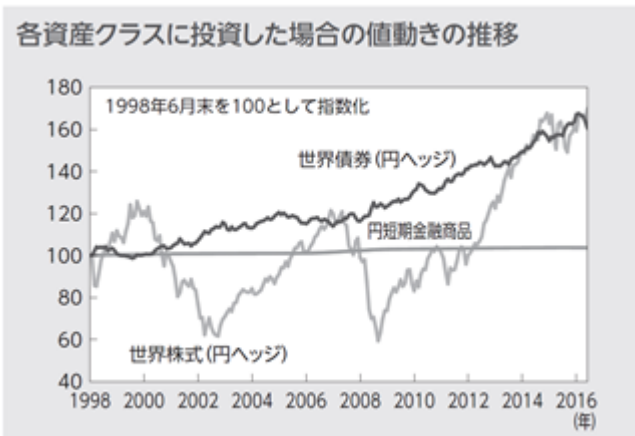
(中略)



(中略)

(中略)

<なぜ世界債券投資なのでしょう？>



(中略)

期間：1998年6月末～2016年11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)

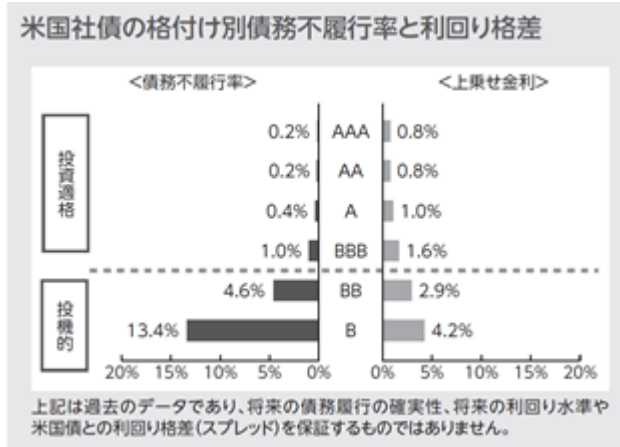
世界債券：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル、円ヘッジ)

円短期金融商品：1ヵ月円LIBOR

(中略)

<高格付け債券への投資>

(中略)



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～2015年 出所：S & P

1981年～2015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。（2015年12月末現在）

< 上乗せ金利 >

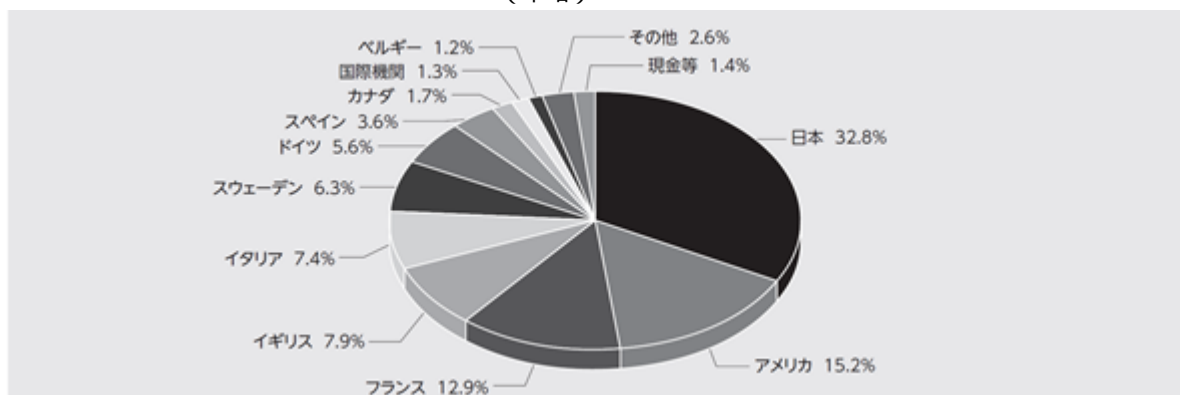
2016年11月末現在 出所：ブルームバーグ

< 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）



2016年11月末現在

（中略）

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～2016年11月末

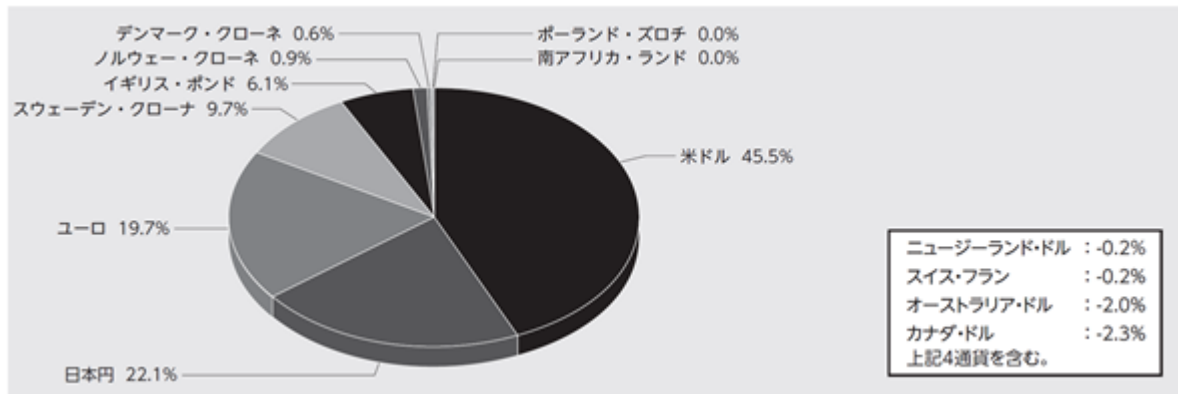
（中略）

< 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）

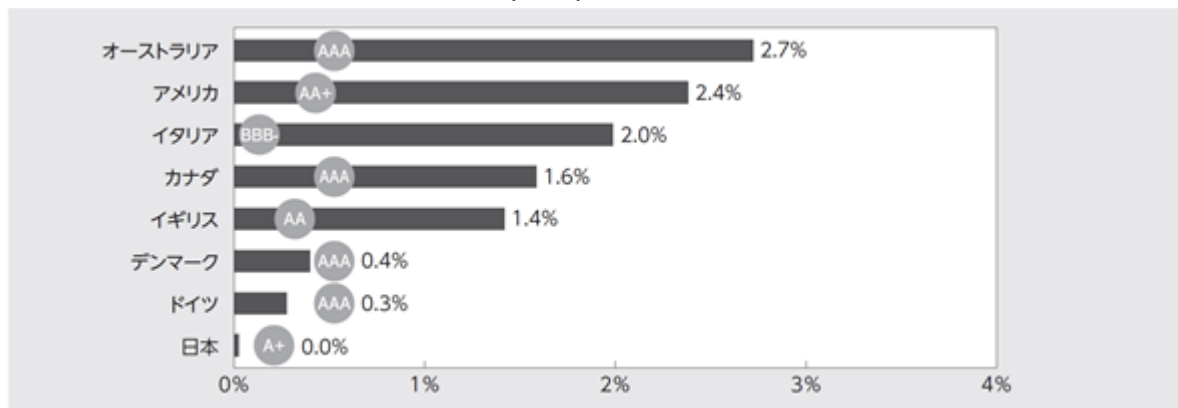


2016年11月末現在

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

（中略）



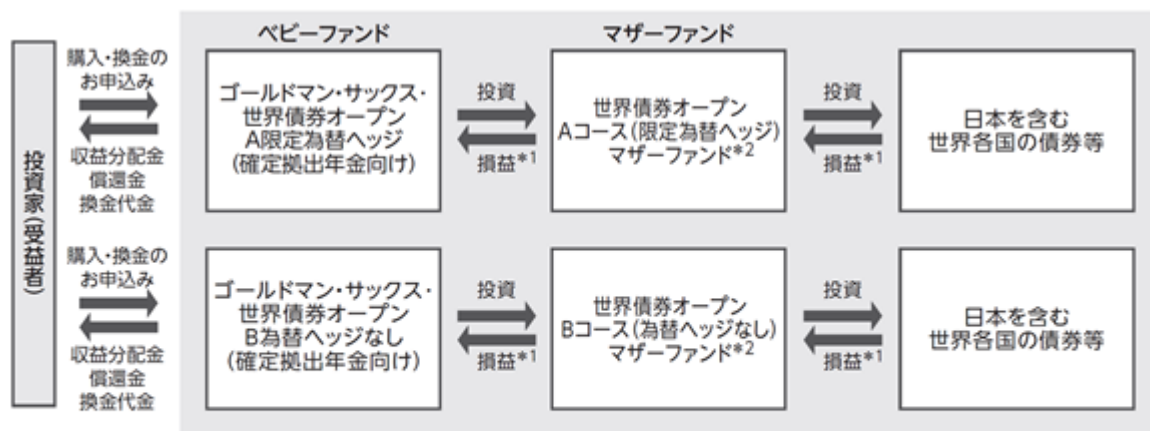
2016年11月末現在

（中略）

(3) ファンドの仕組み

1. ファンドの仕組み

（中略）



*1 損益はすべて投資家である受益者に帰属します。

*2 2017年2月、「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」および「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」は「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」および「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」に名称を変更しました。

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（GSAM）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（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、2016年6月末現在、グループ全体で1兆1,270億米ドル（約116兆円*）の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2016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＝102.91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）

[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

- ・ Aコースはゴールドマン・サックス・世界債券オープン A コース（限定為替ヘッジ）マザーファンドの受益証券を、Bコースはゴールドマン・サックス・世界債券オープン B コース（為替ヘッジなし）マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、原則として、マザーファンド受益証券の組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。

(中略)

c. マザーファンドの運用方針

(中略)

- ・ 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）マザーファンドは、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・ベース)をベンチマークとして運用を行い、外貨建資産については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。
- ・ 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）マザーファンドは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ベース)をベンチマークとして運用を行い、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)

(4) 分配方針

(中略)

<収益分配金に関わる留意点>

分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行った場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。また、投資家の購入価額によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

(後略)

<訂正後>

(1) 投資方針

(中略)

b. 本ファンドの運用方針

- ・ Aコースは世界債券オープン A コース（限定為替ヘッジ）マザーファンドの受益証券を、Bコースは世界債券オープン B コース（為替ヘッジなし）マザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、原則として、マザーファンド受益証券の組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げる場合もあります。）。

(中略)

c. マザーファンドの運用方針

(中略)

- ・ 世界債券オープンAコース（限定為替ヘッジ）マザーファンドは、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・ベース)をベンチマークとして運用を行い、外貨建資産については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。
- ・ 世界債券オープンBコース（為替ヘッジなし）マザーファンドは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(円ベース)をベンチマークとして運用を行い、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)

(4) 分配方針

(中略)

<収益分配金に関わる留意点>

分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行った場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。また、投資家のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。

(後略)

[次へ](#)

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 投資リスク

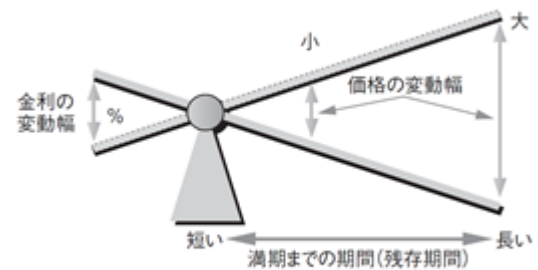
(中略)

(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)

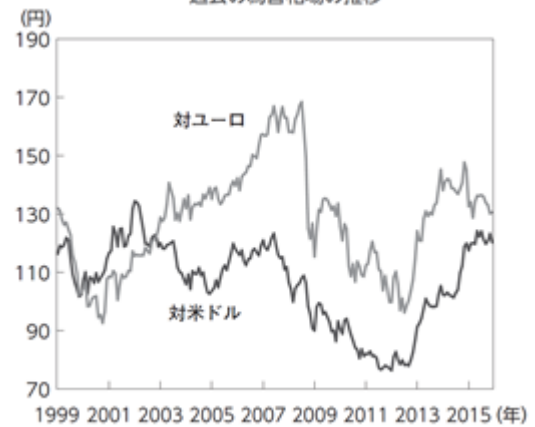
(中略)

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

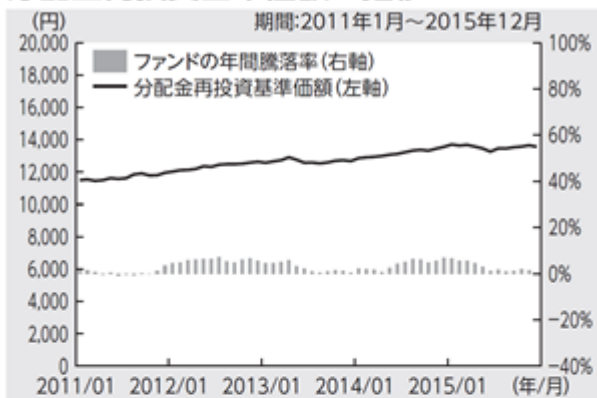
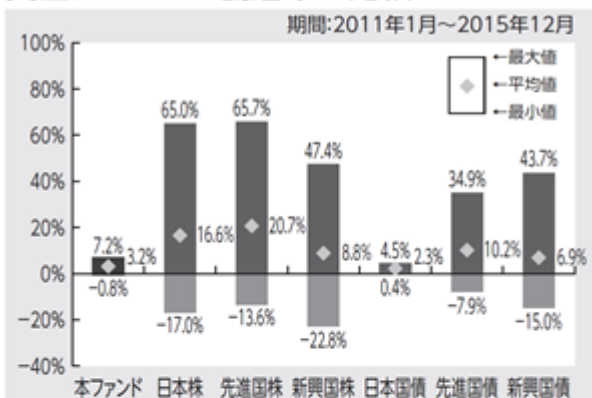
出所：ブルームバーグ

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。

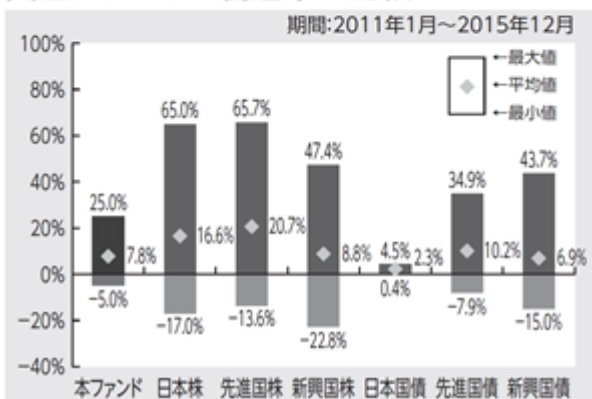
(中略)

(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。

<訂正後>

(1) 投資リスク

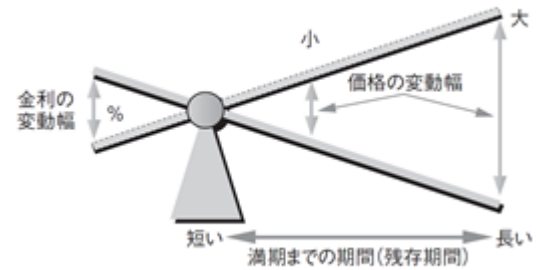
(中略)

(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～2016年11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。

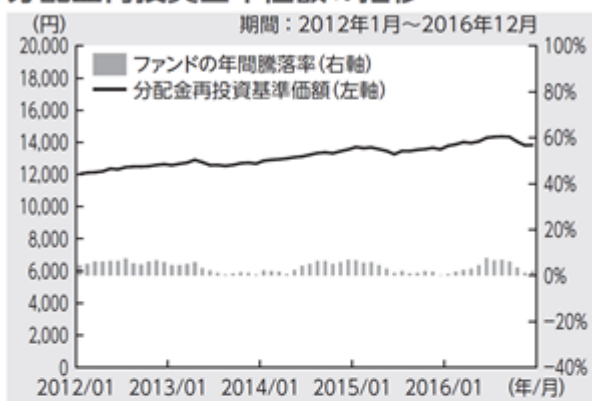
(中略)

(3) 参考情報

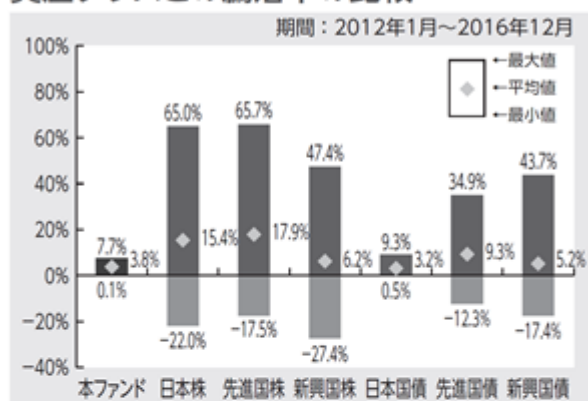
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

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

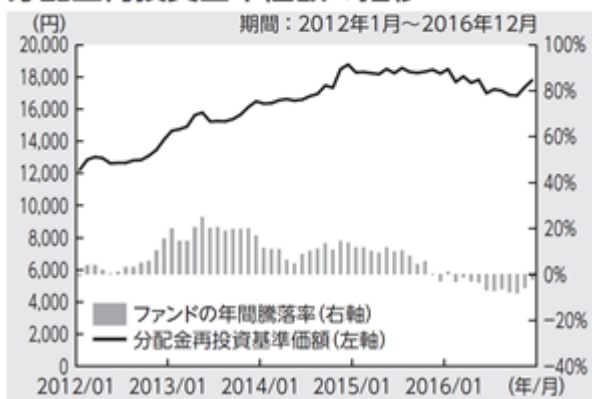


本ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

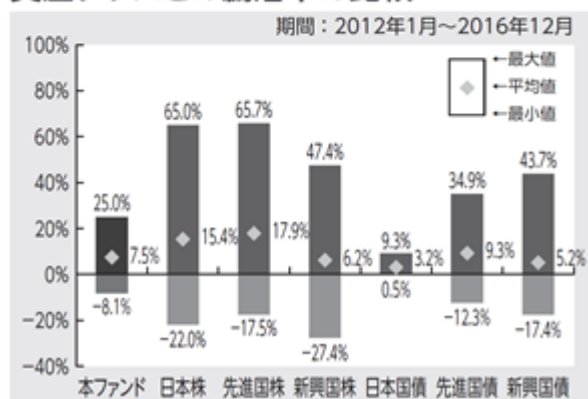


ゴールドマン・サックス・世界債券オープンB為替ヘッジなし(確定拠出年金向け)

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。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

(2) 換金（解約）手数料

< 訂正前 >

換金（解約）請求には手数料はかかりません。ただし、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額に対し0.3%の信託財産留保額をご負担いただきます。

信託財産留保額とは、運用の安定性を高めると同時に、信託期間の途中で換金される方と引き続き本ファンドを保有される受益者との公平性を確保するために、換金される方にご負担いただくもので、信託財産に繰り入れられません。

< 訂正後 >

換金（解約）請求には手数料はかかりません。

なお、2017年2月25日より、信託財産留保額は「0.3%」から「なし」に変更となりました。

[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）>

（2016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	4,920,989,319	100.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,136,878	0.06
合計（純資産総額）		4,917,852,441	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）>

（2016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	7,718,670,511	100.06
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,005,349	0.06
合計（純資産総額）		7,713,665,162	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>

（2016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	15,395,017,623	34.04
	アメリカ	1,292,645,299	2.86
	カナダ	537,023,378	1.19
	ドイツ	1,512,875,991	3.34
	イタリア	2,851,946,609	6.31
	フランス	3,303,325,837	7.30
	イギリス	1,965,654,609	4.35
	スペイン	1,559,945,768	3.45
	ベルギー	388,141,310	0.86
	スウェーデン	2,964,478,523	6.55
	デンマーク	286,983,147	0.63
	小計	32,058,038,094	70.87
地方債証券	カナダ	171,390,349	0.38
特殊債券	アメリカ	825,770,001	1.83
	カナダ	97,706,198	0.22
	ドイツ	732,800,064	1.62
	国際機関	586,781,126	1.30
	小計	2,243,057,389	4.96
社債券	日本	109,861,073	0.24
	アメリカ	5,236,698,259	11.58
	イタリア	18,915,185	0.04
	フランス	1,849,702,844	4.09
	オーストラリア	211,377,259	0.47
	イギリス	1,365,480,370	3.02
	スイス	105,239,186	0.23
	オランダ	238,699,087	0.53
	スペイン	121,279,134	0.27
	ベルギー	149,205,164	0.33
	ルクセンブルク	245,641,736	0.54
	アイルランド	127,907,453	0.28
	小計	9,780,006,750	21.62
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		979,496,130	2.17
合計（純資産総額）		45,231,988,712	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>

（2016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	15,009,341,755	27.71
	アメリカ	1,840,372,538	3.40
	カナダ	77,632,434	0.14
	イタリア	2,758,154,713	5.09
	フランス	4,983,025,265	9.20
	イギリス	1,587,481,355	2.93
	スペイン	2,772,336,957	5.12
	ベルギー	39,322,773	0.07
	スウェーデン	3,013,487,600	5.56
	デンマーク	535,715,780	0.99
	小計	32,616,871,170	60.22
地方債証券	カナダ	78,078,826	0.14
特殊債券	アメリカ	2,244,719,402	4.14
	カナダ	213,177,159	0.39
	ドイツ	1,758,066,806	3.25
	国際機関	1,583,884,261	2.92
小計	5,799,847,628	10.71	
社債券	日本	225,504,307	0.42
	アメリカ	6,839,334,532	12.63
	イタリア	31,525,310	0.06
	フランス	2,698,377,917	4.98
	オーストラリア	283,527,725	0.52
	イギリス	1,418,586,778	2.62
	オランダ	710,764,108	1.31
	スペイン	278,942,011	0.52
	ベルギー	272,702,347	0.50
	ルクセンブルク	480,384,012	0.89
	アイルランド	104,651,552	0.19
	小計	13,344,300,599	24.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		2,319,469,561	4.29
合計（純資産総額）		54,158,567,784	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)>

(2016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	3,031,285,770	1.6440	4,983,694,248	1.6234	4,920,989,319	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2016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)>

(2016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	3,492,611,091	2.1507	7,511,904,839	2.2100	7,718,670,511	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2016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>

（2016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	日本	国債証券	第366回利付国債（2年）	4,318,000,000	100.50	4,339,762,720	100.48	4,338,769,580	0.1	2018/7/15	9.59
2	日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	2,309,000,000	104.27	2,407,663,570	104.18	2,405,724,010	1	2020/9/20	5.32
3	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT 4.25%	108,610,000	1,425.13	1,547,842,497	1,419.73	1,541,971,167	4.25	2019/3/12	3.41
4	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0%	11,990,000	12,378.71	1,484,207,621	12,449.87	1,492,740,439	0	2021/5/25	3.30
5	日本	国債証券	第110回利付国債（5年）	1,439,000,000	100.71	1,449,317,630	100.68	1,448,799,590	0.3	2018/3/20	3.20
6	日本	国債証券	第335回利付国債（10年）	1,372,000,000	104.13	1,428,704,760	104.05	1,427,607,160	0.5	2024/9/20	3.16
7	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVT 3.75%	107,980,000	1,321.09	1,426,518,706	1,317.38	1,422,507,356	3.75	2017/8/12	3.14
8	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1%	10,620,000	12,569.51	1,334,882,062	12,565.09	1,334,412,916	1	2018/5/25	2.95
9	ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 5.5%	5,430,000	20,378.99	1,106,579,547	20,773.35	1,127,993,208	5.5	2031/1/4	2.49
10	日本	国債証券	第371回利付国債（2年）	896,650,000	100.59	902,020,933	100.57	901,805,737	0.1	2018/12/15	1.99
11	日本	国債証券	第21回利付国債（物価連動・10年）	720,600,000	105.87	762,961,479	106.36	766,463,541	0.1	2026/3/10	1.69
12	日本	国債証券	第20回利付国債（物価連動・10年）	719,300,000	105.67	760,124,590	106.08	763,039,194	0.1	2025/3/10	1.69
13	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	3,680,000	19,929.76	733,415,440	20,410.53	751,107,629	4.5	2034/9/7	1.66
14	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B 0.625%	5,770,000	12,302.20	709,837,226	12,240.00	706,248,514	0.625	2024/1/15	1.56
15	イタリア	国債証券	BTPS 0.65%	5,450,000	12,335.89	672,306,020	12,467.42	679,474,631	0.65	2020/11/1	1.50
16	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 3.8%	4,490,000	14,595.90	655,356,012	14,757.86	662,628,151	3.8	2024/4/30	1.46
17	ドイツ	特殊債券	KFW 1.125%	5,600,000	11,612.18	650,282,579	11,601.35	649,675,932	1.125	2018/8/6	1.44
18	イタリア	国債証券	BTPS 1.15%	5,250,000	12,345.33	648,130,234	12,333.80	647,524,710	1.15	2017/5/15	1.43
19	イタリア	国債証券	BTPS 4.25%	4,020,000	13,587.18	546,204,821	13,648.65	548,676,019	4.25	2019/9/1	1.21
20	アメリカ	社債券	NAVSL 2016-7A A	4,347,299.74	11,765.48	511,481,115	11,767.83	511,582,905	1.90611	2066/3/25	1.13
21	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVT BK 1.5%	3,500,000	14,592.00	510,720,170	14,608.88	511,310,820	1.5	2019/2/1	1.13
22	カナダ	国債証券	CANADA-GOV'T 0.75%	5,500,000	8,562.91	470,960,157	8,524.69	468,858,314	0.75	2021/3/1	1.04
23	アメリカ	社債券	MRAFT 2016-1 A	4,000,000	11,649.00	465,960,000	11,649.00	465,960,000	1.637	2018/9/10	1.03
24	アメリカ	社債券	MRAFT 2016-2 A	4,000,000	11,649.00	465,960,000	11,649.00	465,960,000	1.837	2019/3/10	1.03
25	日本	国債証券	第34回利付国債（30年）	340,700,000	136.65	465,583,585	134.95	459,788,278	2.2	2041/3/20	1.02
26	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 1.15%	3,510,000	12,711.96	446,189,941	12,758.71	447,830,838	1.15	2020/7/30	0.99
27	イギリス	国債証券	UK TREASURY 1%	3,030,000	14,392.09	436,080,387	14,397.09	436,232,039	1	2017/9/7	0.96
28	日本	国債証券	第25回利付国債（30年）	323,750,000	133.74	433,002,675	132.54	429,101,487	2.3	2036/12/20	0.95
29	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	2,090,000	19,735.92	412,480,872	20,120.10	420,510,094	4.5	2041/4/25	0.93
30	イタリア	国債証券	BTPS 3.75%	2,890,000	14,224.46	411,087,080	14,360.80	415,027,351	3.75	2024/9/1	0.92

種類別及び業種別投資比率

（2016年12月30日現在）

種類	投資比率（％）
国債証券	70.87
地方債証券	0.38
特殊債券	4.96
社債券	21.62
合計	97.83

(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>

（2016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	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1%	27,240,000	12,569.38	3,423,901,291	12,565.09	3,422,731,435	1	2018/5/25	6.32
2	日本	国債証券	第310回利付国 債(10年)	2,408,700,000	104.27	2,511,623,751	104.18	2,509,600,443	1	2020/9/20	4.63
3	日本	国債証券	第110回利付国 債(5年)	2,259,500,000	100.71	2,275,700,615	100.68	2,274,887,195	0.3	2018/3/20	4.20
4	イタリア	国債証券	BTPS 1.15%	15,970,000	12,345.33	1,971,550,447	12,333.80	1,969,708,499	1.15	2017/5/15	3.64
5	スウェー デン	国債証券	SWEDISH GOV'T 3.75%	134,030,000	1,321.09	1,770,664,030	1,317.38	1,765,684,950	3.75	2017/8/12	3.26
6	日本	国債証券	第366回利付国 債(2年)	1,756,000,000	100.50	1,764,850,240	100.48	1,764,446,360	0.1	2018/7/15	3.26
7	ドイツ	特殊債券	KFW 1.125%	12,600,000	11,612.18	1,463,135,804	11,601.35	1,461,770,848	1.125	2018/8/6	2.70
8	日本	国債証券	第92回利付国 債(20年)	1,194,600,000	120.70	1,441,882,200	120.48	1,439,349,648	2.1	2026/12/20	2.66
9	日本	国債証券	第20回利付国 債(物価連 動・10年)	1,177,500,000	105.67	1,244,330,190	106.08	1,249,101,420	0.1	2025/3/10	2.31
10	スウェー デン	国債証券	SWEDISH GOV'T 4.25%	87,890,000	1,425.13	1,252,553,882	1,419.73	1,247,802,650	4.25	2019/3/12	2.30
11	アメリカ	国債証券	TSY INFL IX N/B 0.625%	9,310,000	12,302.20	1,145,335,282	12,240.00	1,139,544,830	0.625	2024/1/15	2.10
12	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	5,170,000	19,735.92	1,020,347,420	20,120.10	1,040,209,181	4.5	2041/4/25	1.92
13	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 2.1%	8,140,000	12,385.46	1,008,176,501	12,369.38	1,006,868,102	2.1	2017/4/30	1.86
14	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 3.8%	6,200,000	14,595.90	904,945,942	14,757.86	914,987,649	3.8	2024/4/30	1.69
15	国際機関	特殊債券	INTERAMER DEV BK 7%	5,010,000	15,292.34	766,146,302	15,183.88	760,712,847	7	2025/6/15	1.40
16	アメリカ	特殊債券	FHMS K029 A2	6,200,000	12,232.50	758,415,118	12,161.93	754,039,800	3.32	2023/2/25	1.39
17	日本	国債証券	第21回利付国 債(物価連 動・10年)	689,600,000	105.87	730,139,101	106.36	733,490,505	0.1	2026/3/10	1.35
18	フランス	社債券	DEXIA CREDIT LOC 1.875%	6,100,000	11,583.76	706,609,701	11,562.79	705,330,641	1.875	2019/3/28	1.30
19	日本	国債証券	第328回利付国 債(10年)	649,000,000	104.28	676,835,610	104.23	676,504,620	0.6	2023/3/20	1.25
20	イギリス	国債証券	UK TREASURY 4.5%	3,270,000	19,929.76	651,703,394	20,410.53	667,424,442	4.5	2034/9/7	1.23
21	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVT BK 1.5%	4,400,000	14,592.00	642,048,212	14,608.88	642,790,744	1.5	2019/2/1	1.19
22	アメリカ	社債券	NAVSL 2016-7A A	5,137,717.88	11,765.48	604,477,682	11,767.83	604,597,980	1.90611	2066/3/25	1.12
23	日本	国債証券	第72回利付国 債(20年)	509,600,000	116.61	594,249,656	116.40	593,215,168	2.1	2024/9/20	1.10
24	アメリカ	社債券	MRAFT 2016-1 A	5,050,000	11,649.00	588,274,500	11,649.00	588,274,500	1.637	2018/9/10	1.09
25	アメリカ	社債券	MRAFT 2016-2 A	5,050,000	11,649.00	588,274,500	11,649.00	588,274,500	1.837	2019/3/10	1.09
26	日本	国債証券	第156回利付国 債(20年)	601,000,000	98.50	591,991,010	97.56	586,359,640	0.4	2036/3/20	1.08
27	日本	国債証券	第5回利付国 債(40年)	416,300,000	141.58	589,414,192	138.67	577,299,862	2	2052/3/20	1.07
28	オランダ	社債券	ALLIANDER NV VAR	4,400,000	12,823.62	564,239,391	12,815.52	563,883,021	3.25	2049/11/29	1.04
29	日本	国債証券	第126回利付国 債(5年)	536,100,000	100.89	540,871,290	100.89	540,892,734	0.1	2020/12/20	1.00
30	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 2.75%	3,740,000	13,675.16	511,451,049	13,854.30	518,150,923	2.75	2024/10/31	0.96

種類別及び業種別投資比率

(2016年12月30日現在)

種類	投資比率(%)
国債証券	60.22
地方債証券	0.14
特殊債券	10.71
社債券	24.64
合計	95.72

(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)>

(2016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)>

(2016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>

(2016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>

(2016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)>

(2016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)>

(2016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

（2016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 1703	買建	27	米ドル	3,569,985.54	415,867,615	3,604,078.26	419,839,076	0.93
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1703	売建	34	米ドル	4,182,720.22	487,245,079	4,213,875	490,874,299	1.09
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1703	売建	79	米ドル	17,107,314.67	1,992,831,085	17,113,375	1,993,537,053	4.41
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1703	売建	39	米ドル	5,798,441.31	675,460,428	5,846,343.75	681,040,583	1.51
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1703	買建	214	米ドル	34,105,337.89	3,972,930,811	34,086,187.5	3,970,699,982	8.78
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1703	買建	219	米ドル	25,722,265.07	2,996,386,658	25,732,500	2,997,578,925	6.63
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1703	買建	45	カナダドル	6,222,600	538,005,996	6,184,350	534,698,901	1.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1703	買建	45	ユーロ	6,023,080.75	739,032,008	6,102,000	748,715,400	1.66
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1703	買建	19	ユーロ	3,064,405.65	376,002,573	3,127,400	383,731,980	0.85
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1703	買建	5	ユーロ	749,150	91,920,705	761,350	93,417,645	0.21
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1703	買建	42	オーストラリアドル	5,343,219	450,753,954	5,358,863.58	452,073,731	1.00
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1703	買建	510	オーストラリアドル	56,910,494.17	4,800,969,288	56,800,954.2	4,791,728,496	10.59
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 1703	売建	22	英ポンド	2,709,683.6	387,484,755	2,769,140	395,987,020	0.88
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1703	買建	88	英ポンド	10,953,800	1,566,393,400	10,956,550	1,566,786,650	3.46
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1706	買建	88	英ポンド	10,950,500	1,565,921,500	10,953,800	1,566,393,400	3.46
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1709	買建	88	英ポンド	10,947,200	1,565,449,600	10,950,500	1,565,921,500	3.46
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	3MLIBOR 1712	買建	88	英ポンド	10,941,700	1,564,663,100	10,947,200	1,565,449,600	3.46	

(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

(2016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 10U 1703	買建	11	米ドル	1,454,658.04	169,453,114	1,468,328.18	171,045,549	0.32
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1703	売建	67	米ドル	8,258,506.44	962,033,415	8,303,812.5	967,311,118	1.79
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 2Y 1703	売建	92	米ドル	19,918,126.64	2,320,262,572	19,929,500	2,321,587,455	4.29
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 20Y 1703	売建	66	米ドル	9,830,351.06	1,145,137,595	9,893,812.5	1,152,530,218	2.13
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 30Y 1703	買建	267	米ドル	42,541,959.06	4,955,712,811	42,528,093.75	4,954,097,641	9.15
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 5Y 1703	買建	160	米ドル	18,790,278.4	2,188,879,531	18,800,000	2,190,012,000	4.04
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1703	買建	80	カナダドル	11,062,400	956,455,104	10,994,400	950,575,824	1.76
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BOBL 1703	買建	70	ユーロ	9,260,394.5	1,136,250,405	9,359,700	1,148,435,190	2.12
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BTP 1703	買建	138	ユーロ	18,470,806.3	2,266,367,933	18,712,800	2,296,060,560	4.24
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1703	買建	72	ユーロ	11,643,621.55	1,428,672,364	11,851,200	1,454,142,240	2.68
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUXL 1703	買建	30	ユーロ	5,128,860.5	629,311,184	5,280,600	647,929,620	1.20
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	OAT 1703	売建	29	ユーロ	4,345,070	533,140,089	4,415,830	541,822,341	1.00
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1703	買建	57	オーストラリアドル	7,251,511.5	611,737,509	7,272,743.43	613,528,635	1.13
オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE3Y 1703	買建	634	オーストラリアドル	70,739,428.01	5,967,578,147	70,611,382.28	5,956,776,209	11.00	
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1703	売建	25	英ポンド	3,076,340	439,916,620	3,146,750	449,985,250	0.83	

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 (%)
その他 先物取引	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取引 所	3MLIBOR 1703	買建	131	英ポ ンド	16,306,225	2,331,790,175	16,310,318.75	2,332,375,581	4.31
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取引 所	3MLIBOR 1706	買建	131	英ポ ンド	16,301,312.5	2,331,087,688	16,306,225	2,331,790,175	4.31
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取引 所	3MLIBOR 1709	買建	131	英ポ ンド	16,296,400	2,330,385,199	16,301,312.5	2,331,087,687	4.30
	イギリス	ロンドン 国際金融 先物オブ ション取引 所	3MLIBOR 1712	買建	131	英ポ ンド	16,288,212.5	2,329,214,387	16,296,400	2,330,385,200	4.30

(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)>

2016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
第15計算期間末 (2016年6月7日)	4,481	4,481	1.4116	1.4116
2015年12月末日	4,035	-	1.3566	-
2016年1月末日	4,172	-	1.3786	-
2月末日	4,199	-	1.3874	-
3月末日	4,323	-	1.4015	-
4月末日	4,360	-	1.3964	-
5月末日	4,445	-	1.4055	-
6月末日	4,590	-	1.4282	-
7月末日	4,740	-	1.4342	-
8月末日	4,853	-	1.4364	-
9月末日	4,944	-	1.4343	-
10月末日	4,926	-	1.4047	-
11月末日	4,829	-	1.3814	-
12月末日	4,917	-	1.3831	-

(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)>

2016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
第15計算期間末 (2016年6月7日)	7,446	7,446	1.7536	1.7536
2015年12月末日	7,662	-	1.8217	-
2016年1月末日	7,815	-	1.8486	-
2月末日	7,421	-	1.7689	-
3月末日	7,620	-	1.8036	-
4月末日	7,485	-	1.7634	-
5月末日	7,575	-	1.7824	-
6月末日	7,248	-	1.6991	-
7月末日	7,398	-	1.7233	-
8月末日	7,392	-	1.7138	-
9月末日	7,321	-	1.6878	-
10月末日	7,326	-	1.6841	-
11月末日	7,577	-	1.7376	-
12月末日	7,713	-	1.7817	-

(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
第15計算期間	2015年6月9日～2016年6月7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
第15計算期間	2015年6月9日～2016年6月7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計算期間	2015年6月9日～2016年6月7日	6.3
第16中間計算期間	2016年6月8日～2016年12月7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計算期間	2015年6月9日～2016年6月7日	5.3
第16中間計算期間	2016年6月8日～2016年12月7日	0.1

(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計算期間	2015年6月9日～2016年6月7日	722,160,136	494,056,308	3,174,919,278
第16中間計算期間	2016年6月8日～2016年12月7日	672,549,592	352,716,760	3,494,752,110

<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計算期間	2015年6月9日～2016年6月7日	473,342,726	428,176,081	4,246,329,568
第16中間計算期間	2016年6月8日～2016年12月7日	277,892,321	172,821,338	4,351,400,551

[次へ](#)

(参考)運用実績

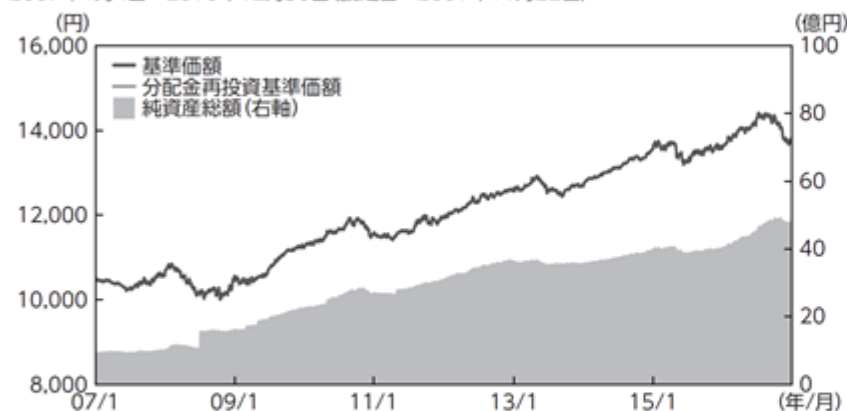
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2016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

2007年1月4日～2016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	13,831円
純資産総額	49.2億円

期間別騰落率
(分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	0.12%
3ヵ月	-3.57%
6ヵ月	-3.16%
1年	1.95%
3年	9.09%
5年	15.64%
設定来	38.31%

●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	12/6/7	13/6/7	14/6/9	15/6/8	16/6/7	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

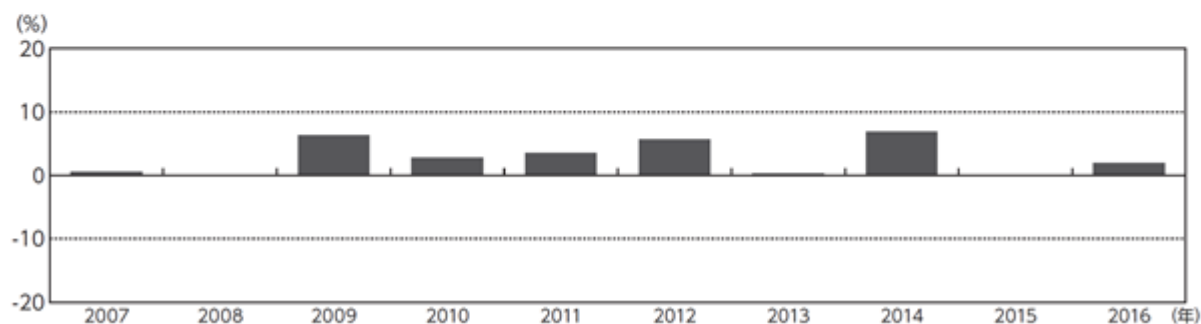
●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	第366回利付国債(2年) 0.1% 2018年7月15日	JPY	1.5年	9.6%
2	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	3.7年	5.3%
3	スウェーデン国債 4.25% 2019年3月12日	SEK	2.2年	3.4%
4	フランス国債 0% 2021年5月25日	EUR	4.4年	3.3%
5	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	1.2年	3.2%
6	第335回利付国債(10年) 0.5% 2024年9月20日	JPY	7.7年	3.2%
7	スウェーデン国債 3.75% 2017年8月12日	SEK	0.6年	3.1%
8	フランス国債 1% 2018年5月25日	EUR	1.4年	3.0%
9	ドイツ国債 5.5% 2031年1月4日	EUR	14.0年	2.5%
10	第371回利付国債(2年) 0.1% 2018年12月15日	JPY	2.0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。

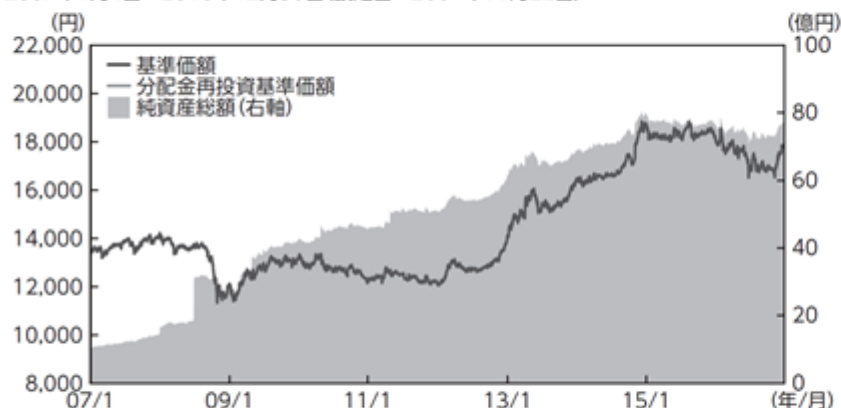
下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2016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

2007年1月4日～2016年12月30日(設定日:2001年11月22日)



●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。

基準価額・純資産総額

基準価額	17,817円
純資産総額	77.1億円

期間別騰落率 (分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	2.54%
3ヵ月	5.56%
6ヵ月	4.86%
1年	-2.20%
3年	8.09%
5年	45.91%
設定来	78.17%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	12/6/7	13/6/7	14/6/9	15/6/8	16/6/7	設定来累計
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円

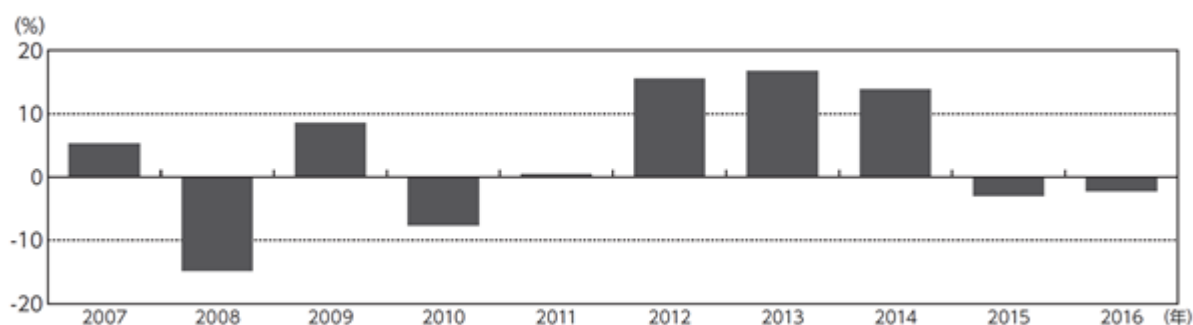
●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

	銘柄名	通貨	残存年数	構成比
1	フランス国債 1% 2018年5月25日	EUR	1.4年	6.3%
2	第310回利付国債(10年) 1% 2020年9月20日	JPY	3.7年	4.6%
3	第110回利付国債(5年) 0.3% 2018年3月20日	JPY	1.2年	4.2%
4	イタリア国債 1.15% 2017年5月15日	EUR	0.4年	3.6%
5	スウェーデン国債 3.75% 2017年8月12日	SEK	0.6年	3.3%
6	第366回利付国債(2年) 0.1% 2018年7月15日	JPY	1.5年	3.3%
7	ドイツ復興金融公庫 1.125% 2018年8月6日	USD	1.6年	2.7%
8	第92回利付国債(20年) 2.1% 2026年12月20日	JPY	10.0年	2.7%
9	第20回利付国債(物価連動・10年) 0.1% 2025年3月10日	JPY	8.2年	2.3%
10	スウェーデン国債 4.25% 2019年3月12日	SEK	2.2年	2.3%

●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2【管理及び運営】

2 換金（解約）手続等

<訂正前>

（前略）

(3) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

（後略）

<訂正後>

（前略）

(3) 一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額とします。

（後略）

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16期中間計算期間（平成28年6月8日から平成28年12月7日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任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15期 （平成28年6月7日現在）	第16期中間計算期間 （平成28年12月7日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	4,503,754,957	4,828,562,739
未収入金	227,743	23,784,884
流動資産合計	4,503,982,700	4,852,347,623
資産合計	4,503,982,700	4,852,347,623
負債の部		
流動負債		
未払解約金	227,743	23,784,884
未払受託者報酬	1,136,482	1,294,639
未払委託者報酬	20,456,525	23,303,515
その他未払費用	306,171	240,287
流動負債合計	22,126,921	48,623,325
負債合計	22,126,921	48,623,325
純資産の部		
元本等		
元本	3,174,919,278	3,494,752,110
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,306,936,501	1,308,972,188
（分配準備積立金）	556,577,119	503,007,007
元本等合計	4,481,855,779	4,803,724,298
純資産合計	4,481,855,779	4,803,724,298
負債純資産合計	4,503,982,700	4,852,347,623

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成28年6月8日 至 平成28年12月7日
営業収益				
有価証券売買等損益		118,916,395		112,247,760
営業収益合計		118,916,395		112,247,760
営業費用				
受託者報酬		1,068,831		1,294,639
委託者報酬		19,238,843		23,303,515
その他費用		231,119		240,287
営業費用合計		20,538,793		24,838,441
営業利益又は営業損失()		98,377,602		137,086,201
経常利益又は経常損失()		98,377,602		137,086,201
中間純利益又は中間純損失()		98,377,602		137,086,201
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()		4,081,779		1,706,680
期首剰余金又は期首欠損金()		964,734,664		1,306,936,501
剰余金増加額又は欠損金減少額		94,578,129		281,841,632
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		94,578,129		281,841,632
剰余金減少額又は欠損金増加額		84,443,594		144,426,424
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		84,443,594		144,426,424
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金()		1,069,165,022		1,308,972,188

[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15期 自 平成27年6月9日 至 平成28年6月7日	第16期中間計算期間 自 平成28年6月8日 至 平成28年12月7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27年6月7日が休業日のた め、当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15期 (平成28年6月7日現在)	第16期中間計算期間 (平成28年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	2,946,815,450円	3,174,919,278円
期中追加設定元本額	722,160,136円	672,549,592円
期中一部解約元本額	494,056,308円	352,716,760円
2. 受益権の総数	3,174,919,278口	3,494,752,110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15期 自 平成27年6月9日 至 平成28年6月7日	第16期中間計算期間 自 平成28年6月8日 至 平成28年12月7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15期 (平成28年6月7日現在)	第16期中間計算期間 (平成28年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.4116円	1.3746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15期 （平成28年6月7日現在）	第16期中間計算期間 （平成28年12月7日現在）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	7,485,115,533	7,675,387,504
未収入金	29,383	4,781,094
流動資産合計	7,485,144,916	7,680,168,598
資産合計	7,485,144,916	7,680,168,598
負債の部		
流動負債		
未払解約金	29,383	4,781,094
未払受託者報酬	2,025,824	1,984,318
未払委託者報酬	36,464,776	35,717,658
その他未払費用	422,448	352,814
流動負債合計	38,942,431	42,835,884
負債合計	38,942,431	42,835,884
純資産の部		
元本等		
元本	4,246,329,568	4,351,400,551
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	3,199,872,917	3,285,932,163
（分配準備積立金）	1,821,135,794	1,750,449,334
元本等合計	7,446,202,485	7,637,332,714
純資産合計	7,446,202,485	7,637,332,714
負債純資産合計	7,485,144,916	7,680,168,598

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第15期中間計算期間		第16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	自	平成28年6月8日 至 平成28年12月7日
営業収益				
有価証券売買等損益		64,850,954		50,274,109
営業収益合計		64,850,954		50,274,109
営業費用				
受託者報酬		2,074,562		1,984,318
委託者報酬		37,341,980		35,717,658
その他費用		305,166		352,814
営業費用合計		39,721,708		38,054,790
営業利益又は営業損失（ ）		25,129,246		12,219,319
経常利益又は経常損失（ ）		25,129,246		12,219,319
中間純利益又は中間純損失（ ）		25,129,246		12,219,319
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（ ）		4,267,194		8,278,801
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,574,926,218		3,199,872,917
剰余金増加額又は欠損金減少額		208,933,931		194,622,441
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		208,933,931		194,622,441
剰余金減少額又は欠損金増加額		213,344,952		129,061,315
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		213,344,952		129,061,315
分配金		-		-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		3,599,911,637		3,285,932,163

[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15期 自 平成27年6月9日 至 平成28年6月7日	第16期中間計算期間 自 平成28年6月8日 至 平成28年12月7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27年6月7日が休業日のた め、当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15期 (平成28年6月7日現在)	第16期中間計算期間 (平成28年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	4,201,162,923円	4,246,329,568円
期中追加設定元本額	473,342,726円	277,892,321円
期中一部解約元本額	428,176,081円	172,821,338円
2. 受益権の総数	4,246,329,568口	4,351,400,551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15期 自 平成27年6月9日 至 平成28年6月7日	第16期中間計算期間 自 平成28年6月8日 至 平成28年12月7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15期 (平成28年6月7日現在)	第16期中間計算期間 (平成28年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.7536円	1.7551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28年6月7日現在)	(平成28年12月7日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		743,570,925	3,111,655
コール・ローン		1,738,751,036	1,039,217,462
国債証券		27,346,957,842	32,658,918,126
地方債証券		-	170,843,158
特殊債券		4,700,310,730	2,222,468,618
社債券		7,665,495,188	9,704,547,238
派生商品評価勘定		1,686,492,281	4,013,554,341
未収入金		777,134,003	602,583,959
未収利息		157,751,968	203,565,670
前払費用		72,126,344	74,592,856
差入委託証拠金		61,657,973	326,620,155
流動資産合計		44,950,248,290	51,020,023,238
資産合計		44,950,248,290	51,020,023,238
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,245,858,897	5,952,310,102
未払金		1,493,999,825	88,533,870
未払解約金		43,591,771	79,818,279
未払利息		4,150	2,389
流動負債合計		2,783,454,643	6,120,664,640
負債合計		2,783,454,643	6,120,664,640
純資産の部			
元本等			
元本		25,593,448,874	27,846,385,802
剰余金			
剰余金又は欠損金()		16,573,344,773	17,052,972,796
元本等合計		42,166,793,647	44,899,358,598
純資産合計		42,166,793,647	44,899,358,598
負債純資産合計		44,950,248,290	51,020,023,238

(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27年 6月 9日 至 平成28年 6月 7日	自 平成28年 6月 8日 至 平成28年12月 7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</p> <p>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、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>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</p> <p>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)</p> <p>(3) 先物取引</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>(2) 金利スワップ取引</p> <p>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。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額により評価しております。</p> <p>(3) 先物取引</p> <p>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</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</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</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成28年6月7日現在)	(平成28年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	24,093,864,686円	25,593,448,874円
期中追加設定元本額	9,768,106,938円	6,272,290,412円
期中一部解約元本額	8,268,522,750円	4,019,353,484円
期末元本額	25,593,448,874円	27,846,385,802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)	2,733,524,495円	2,994,643,227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)	11,085,838,410円	12,122,992,174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)	3,298,957,844円	4,272,033,984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)	782,939,845円	1,294,144,251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)	2,411,212,052円	2,564,511,284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)	1,754,276,750円	1,553,545,187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)	1,276,976,704円	1,289,747,741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)	2,249,722,774円	1,754,767,954円
2. 受益権の総数	25,593,448,874口	27,846,385,802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

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28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	9,757,966,622	-	9,847,429,032	89,462,410	14,285,972,900	-	14,172,803,273	113,169,627
	売建	9,371,938,242	-	9,438,086,343	66,148,101	3,540,187,991	-	3,531,458,409	8,729,582
	合計	19,129,904,864	-	19,285,515,375	23,314,309	17,826,160,891	-	17,704,261,682	104,440,045

(2) 通貨関連

区分	種類	(平成28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	21,440,732,604	-	20,901,576,964	539,155,640	25,343,903,543	-	27,095,067,719	1,751,164,176
	カナダドル	3,529,506,519	-	3,486,907,869	42,598,650	3,987,410,779	-	4,297,914,644	310,503,865
	ユーロ	13,184,692,917	-	12,963,818,756	220,874,161	10,906,839,931	-	11,485,670,023	578,830,092
	英ポンド	2,741,731,992	-	2,686,489,425	55,242,567	3,261,467,231	-	3,620,572,997	359,105,766
	スイスフラン	847,333,501	-	838,152,534	9,180,967	1,569,721,017	-	1,663,356,136	93,635,119
	スウェーデン クローナ	4,330,164,220	-	4,295,579,692	34,584,528	6,041,446,295	-	6,315,160,393	273,714,098
	ノルウェー クローネ	1,135,480,532	-	1,130,088,572	5,391,960	2,336,984,100	-	2,499,042,326	162,058,226
	デンマーク クローネ	295,061,225	-	296,072,203	1,010,978	-	-	-	-
	オーストラリ アドル	4,051,462,111	-	3,908,256,655	143,205,456	4,324,616,056	-	4,539,133,180	214,517,124
	ニュージーラ ンドドル	2,329,390,612	-	2,296,376,056	33,014,556	3,029,135,888	-	3,273,335,341	244,199,453
	売建								
	米ドル	29,387,743,806	-	28,780,110,600	607,633,206	30,780,632,346	-	32,885,117,929	2,104,485,583
	カナダドル	11,052,022,126	-	10,977,477,207	74,544,919	6,142,863,854	-	6,645,596,900	502,733,046
	ユーロ	27,526,913,042	-	27,109,504,724	417,408,318	27,725,061,007	-	29,266,052,265	1,540,991,258
	英ポンド	5,298,509,514	-	5,144,858,900	153,650,614	7,717,279,181	-	8,344,596,072	627,316,891
	スイスフラン	515,873,286	-	505,650,564	10,222,722	1,243,419,422	-	1,338,157,815	94,738,393
	スウェーデン クローナ	4,612,757,945	-	4,570,139,786	42,618,159	5,040,244,041	-	5,366,711,299	326,467,258
	ノルウェー クローネ	1,179,401,691	-	1,159,465,796	19,935,895	2,002,617,731	-	2,162,321,721	159,703,990
	デンマーク クローネ	592,509,081	-	592,144,406	364,675	276,237,171	-	296,794,330	20,557,159
	オーストラリ アドル	3,161,142,548	-	3,050,393,003	110,749,545	5,857,129,668	-	6,067,982,334	210,852,666
	ニュージーラ ンドドル	3,147,056,649	-	3,084,628,120	62,428,529	2,961,747,059	-	3,195,364,483	233,617,424
	合計	140,359,485,921	-	137,777,691,832	417,319,075	150,548,756,320	-	160,357,947,907	1,833,735,749

(3) 金利関連

区分	種類	(平成28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	-	-	-	-	6,330,449,095	1,581,833,113	6,329,869,128	579,967
	合計	-	-	-	-	6,330,449,095	1,581,833,113	6,329,869,128	579,967

(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28年6月7日現在)	(平成28年12月7日現在)
1口当たり純資産額	1.6476円	1.6124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28年6月7日現在）	（平成28年12月7日現在）
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		848,052,375	8,724,331
コール・ローン		1,675,640,129	491,376,792
国債証券		36,917,620,399	34,557,698,478
地方債証券		-	78,073,112
特殊債券		9,656,743,473	5,736,400,687
社債券		12,241,448,472	13,274,714,169
派生商品評価勘定		2,221,319,218	5,321,307,591
未収入金		1,361,372,522	72,891,227
未収利息		279,223,397	270,103,124
前払費用		81,792,022	52,050,070
差入委託証拠金		113,497,153	372,199,860
流動資産合計		65,396,709,160	60,235,539,441
資産合計		65,396,709,160	60,235,539,441
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,349,749,068	5,473,721,959
未払金		2,062,116,347	74,253,426
未払解約金		18,674,551	194,894,181
未払利息		3,999	1,130
流動負債合計		4,430,543,965	5,742,870,696
負債合計		4,430,543,965	5,742,870,696
純資産の部			
元本等			
元本		28,185,262,889	25,046,378,023
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		32,780,902,306	29,446,290,722
元本等合計		60,966,165,195	54,492,668,745
純資産合計		60,966,165,195	54,492,668,745
負債純資産合計		65,396,709,160	60,235,539,441

(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27年 6月 9日 至 平成28年 6月 7日	自 平成28年 6月 8日 至 平成28年12月 7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</p> <p>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、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>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</p> <p>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)</p>	<p>(1) 為替予約取引</p> <p>同左</p> <p>(2) 金利スワップ取引</p> <p>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。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額又は価格情報会社の提供する価額により評価しております。</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>(3) 先物取引</p> <p>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>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。</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>(3) 先物取引</p> <p>同左</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成28年6月7日現在)	(平成28年12月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	37,047,479,783円	28,185,262,889円
期中追加設定元本額	4,208,876,090円	1,030,767,789円
期中一部解約元本額	13,071,092,984円	4,169,652,655円
期末元本額	28,185,262,889円	25,046,378,023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）	3,460,365,001円	3,527,778,418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）	3,272,804,444円	2,763,046,809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）	3,915,868,929円	3,871,240,987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）	376,189,808円	369,557,823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）	1,896,584,458円	1,845,546,811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）	15,263,450,249円	12,669,207,175円
2. 受益権の総数	28,185,262,889口	25,046,378,023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

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28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	17,414,028,014	-	17,565,579,557	151,551,543	17,095,949,916	-	16,955,038,859	140,911,057
	売建	16,319,064,829	-	16,448,392,269	129,327,440	3,607,656,135	-	3,590,940,300	16,715,835
	合計	33,733,092,843	-	34,013,971,826	22,224,103	20,703,606,051	-	20,545,979,159	124,195,222

(2) 通貨関連

区分	種類	(平成28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	43,133,785,980	-	42,125,436,326	1,008,349,654	38,072,770,672	-	40,564,243,429	2,491,472,757
	カナダドル	5,697,221,617	-	5,628,564,762	68,656,855	5,131,296,346	-	5,539,025,356	407,729,010
	ユーロ	22,190,248,703	-	21,784,380,072	405,868,631	12,279,448,896	-	12,982,360,838	702,911,942
	英ポンド	5,448,092,949	-	5,316,986,502	131,106,447	3,881,375,017	-	4,322,104,249	440,729,232
	スイスフラン	1,411,223,598	-	1,393,056,415	18,167,183	1,946,540,537	-	2,063,688,897	117,148,360
	スウェーデン クローナ	7,288,944,859	-	7,227,023,622	61,921,237	7,465,662,244	-	7,791,379,662	325,717,418
	ノルウェー クローネ	2,183,071,592	-	2,171,980,324	11,091,268	2,894,299,256	-	3,099,472,427	205,173,171
	デンマーク クローネ	218,601,000	-	219,350,000	749,000	-	-	-	-
	オーストラリ アドル	7,442,303,314	-	7,138,549,013	303,754,301	5,789,154,455	-	6,084,788,295	295,633,840
	ニュージーラ ンドドル	4,139,760,437	-	4,077,111,106	62,649,331	3,697,607,932	-	3,999,887,330	302,279,398
	売建								
	米ドル	31,591,168,603	-	30,704,595,988	886,572,615	27,499,319,517	-	29,644,533,298	2,145,213,781
	カナダドル	16,101,391,011	-	15,976,465,197	124,925,814	6,539,035,300	-	7,058,300,750	519,265,450
	ユーロ	26,211,819,546	-	25,824,002,322	387,817,224	17,512,700,895	-	18,468,543,036	955,842,141
	英ポンド	4,508,008,613	-	4,422,062,827	85,945,786	5,140,249,398	-	5,603,057,177	462,807,779
	スイスフラン	912,631,536	-	893,256,943	19,374,593	1,506,589,203	-	1,621,642,880	115,053,677
	スウェーデン クローナ	7,416,723,266	-	7,345,934,581	70,788,685	5,626,738,137	-	5,982,955,876	356,217,739
	ノルウェー クローネ	2,249,522,834	-	2,213,274,333	36,248,501	2,521,221,397	-	2,723,609,466	202,388,069
	デンマーク クローネ	438,970,175	-	438,700,000	270,175	204,654,887	-	219,885,000	15,230,113
	オーストラリ アドル	5,331,281,492	-	5,136,069,471	195,212,021	6,831,723,463	-	7,086,024,114	254,300,651
	ニュージーラ ンドドル	5,367,090,341	-	5,254,083,801	113,006,540	3,678,978,906	-	3,968,813,766	289,834,860
合計		199,281,861,466	-	195,290,883,605	150,653,953	158,219,366,458	-	168,824,315,846	27,359,132

(3) 金利関連

区分	種類	(平成28年6月7日現在)				(平成28年12月7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	-	-	-	-	9,423,733,374	2,354,804,125	9,422,873,360	860,014
	合計	-	-	-	-	9,423,733,374	2,354,804,125	9,422,873,360	860,014

(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28年6月7日現在)	(平成28年12月7日現在)
1口当たり純資産額	2.1631円	2.1757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28年12月30日現在）

資産総額	4,936,850,123円
負債総額	18,997,682円
純資産総額（ - ）	4,917,852,441円
発行済口数	3,555,622,730口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3831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28年12月30日現在）

資産総額	7,733,807,453円
負債総額	20,142,291円
純資産総額（ - ）	7,713,665,162円
発行済口数	4,329,310,580口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7817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28年12月30日現在）

資産総額	48,877,979,830円
負債総額	3,645,991,118円
純資産総額（ - ）	45,231,988,712円
発行済口数	27,862,094,272口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6234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28年12月30日現在）

資産総額	57,458,469,134円
負債総額	3,299,901,350円
純資産総額（ - ）	54,158,567,784円
発行済口数	24,506,285,534口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2100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12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	110	1,737,270,650,206
合計	110	1,737,270,650,206

[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21期事業年度（平成27年4月1日から平成27年12月31日まで）の財務諸表について、PwC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22期事業年度の中間会計期間（平成28年1月1日から平成28年6月30日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任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PwCあらた監査法人は、公認会計士法に定める監査法人の種類の変更により、平成28年7月1日付をもってPwCあらた有限責任監査法人へ名称変更しております。

(1) 貸借対照表

期別		第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12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			6,748,612			8,541,657	
有価証券			13,297,906			12,097,990	
支払委託金			39			26	
収益分配金		39			26		
前払費用			18			157	
未収委託者報酬			1,842,228			1,527,034	
未収運用受託報酬			1,578,480			1,885,724	
未収収益			368,604			11,848	
繰延税金資産			826,971			1,079,356	
流動資産計			24,662,860	88.5		25,143,796	90.7
固定資産							
投資その他の資産			3,193,568			2,580,738	
投資有価証券		1,596,511			573,290		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,587,056			1,997,448		
固定資産計			3,193,568	11.5		2,580,738	9.3
資産合計			27,856,428	100.0		27,724,534	100.0

期別		第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12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			599			580	
未払金			585,816			538,691	
未払収益分配金		229			242		
未払償還金		72			72		
未払手数料		585,514			538,376		
未払費用			3,406,376			4,518,812	
未払法人税等			957,171			888,102	
未払消費税等			470,936			205,603	
流動負債計			5,420,899	19.5		6,151,789	22.2
固定負債							
長期未払費用			6,285,478			7,097,924	
固定負債計			6,285,478	22.6		7,097,924	25.6
負債合計			11,706,378	42.0		13,249,714	47.8

期別	第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12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			14,867,795			13,545,174	
その他利益剰余金		14,867,795			13,545,174		
繰越利益剰余金		14,867,795			13,545,174		
株主資本合計			15,747,795	56.5		14,425,174	52.0
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		402,254			49,646		
評価・換算差額等合計			402,254	1.4		49,646	0.2
純資産合計			16,150,050	58.0		14,474,820	52.2
負債・純資産合計			27,856,428	100.0		27,724,534	100.0

(2) 損益計算書

期別		第20期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日			第21期 自 平成27年4月1日 至 平成27年12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			14,066,674			11,823,135	
		運用受託報酬	* 2		9,173,012			6,961,333	
		その他営業収益	* 2		5,932,747			4,316,802	
		営業収益計			29,172,434	100.0		23,101,271	100.0
		営業費用							
		支払手数料			6,754,210			5,363,613	
		広告宣伝費			139,448			102,758	
		調査費			6,692,987			5,350,334	
		委託調査費	* 2	6,692,987				5,350,334	
		委託計算費			220,885			159,321	
		営業雑経費			384,844			197,324	
		通信費		205,675				9,974	
		印刷費		147,770				161,506	
		協会費		31,398				25,843	
		営業費用計			14,192,375	48.6		11,173,351	48.4
		一般管理費							
		給料			7,106,650			5,734,984	
		役員報酬		228,309				185,510	
		給料・手当		2,654,259				2,319,237	
		賞与		1,251,694				746,339	
		株式従業員報酬	* 1	1,027,305				797,337	
		その他の報酬		1,945,082				1,686,559	
		交際費			84,594			57,202	
		寄付金			71,518			63,290	
		旅費交通費			234,673			187,482	
		租税公課			83,891			71,744	
		不動産賃借料			416,707			268,044	
		退職給付費用			842,766			698,807	
		事務委託費			376,536			398,407	
		諸経費			998,793			941,860	
一般管理費計			10,216,131	35.0		8,421,824	36.5		
営業利益			4,763,926	16.3		3,506,095	15.2		

期別		第20期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日			第21期 自 平成27年4月1日 至 平成27年12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			49,958			502,884	
	受取利息			18,605			14,231	
	投資有価証券売却益			36,653			66,895	
	株式従業員報酬	* 1		-			59,655	
	為替差益			-			12,446	
	雑益			1,332			-	
	営業外収益計			106,549	0.4		656,114	2.8
	営業外費用							
	支払利息			138			-	
	株式従業員報酬	* 1		434,620			-	
	為替差損			33,391			-	
	投資有価証券売却損			1,065			8	
	営業外費用計			469,216	1.6		8	0.0
経常利益				4,401,260	15.1		4,162,200	18.0
税引前当期純利益				4,401,260	15.1		4,162,200	18.0
法人税、住民税及び事業税				2,267,605	7.8		1,978,986	8.6
法人税等調整額				18,387	0.1		494,163	2.1
当期純利益				2,115,267	7.3		2,677,378	11.6

(3) 株主資本等変動計算書

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

第21期
(自平成27年4月1日 至平成27年12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27年4月1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
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				4,000,000	4,000,000	4,000,000			4,000,000
当期純利益				2,677,378	2,677,378	2,677,378			2,677,378
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							352,608	352,608	352,608
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,322,621	1,322,621	1,322,621	352,608	352,608	1,675,229
平成27年12月31日残高	490,000	390,000	390,000	13,545,174	13,545,174	14,425,174	49,646	49,646	14,474,820

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 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 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ヶ月間となりました。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第20期 (平成27年3月31日現在)	第21期 (平成27年12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20期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第21期 (自 平成27年4月1日 至 平成27年12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。</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;">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	<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;">1,882,545千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">4,175,357千円</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;">5,350,334千円</td> </tr> </table>	営業収益		運用受託報酬	1,882,545千円	その他営業収益	4,175,357千円	営業費用		委託調査費	5,350,334千円
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																				
営業収益																					
運用受託報酬	1,882,545千円																				
その他営業収益	4,175,357千円																				
営業費用																					
委託調査費	5,350,334千円																				

（株主資本等変動計算書関係）

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

第21期（自 平成27年4月1日 至 平成27年12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27年12月18日 臨時株主総会	普通株式	4,000,000	625,000	平成27年12月21日	平成27年12月21日

（リース取引関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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、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	-	-	-	-	-

第21期
（自 平成27年4月1日
至 平成27年12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、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21期
(自 平成27年4月1日
至 平成27年12月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成27年12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	8,541,657	8,541,657	-
有価証券			
其他有価証券	12,097,990	12,097,990	-
未収委託者報酬	1,527,034	1,527,034	-
未収運用受託報酬	1,885,724	1,885,724	-
投資有価証券			
其他投資有価証券	573,290	573,290	-

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	8,541,657	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券のうち満期があるもの	12,100,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,527,034	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,885,724	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）					第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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	1,002,000	1,596,511	594,511	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
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	-	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	12,097,990	12,097,990	-
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）		
285,818	36,653	1,065			568,887	66,895	8		

（デリバティブ取引関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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。	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 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。	2. 退職給付費用に関する事項 同左

（税効果会計関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">735,838千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">67,023</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">24,108</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">826,971</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産（流動資産）</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">826,971</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,710,136</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">69,177</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,779,313</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">192,256</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">192,256</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,587,056千円</td> </tr> </table>	未払費用	735,838千円	未払事業税	67,023	その他	24,108	小計	826,971	繰延税金資産（流動資産）	826,971	長期未払費用	1,710,136	その他	69,177	小計	1,779,313	その他有価証券評価差額金	192,256	小計	192,256		1,587,056千円	<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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">980,373千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">64,201</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">34,781</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,079,356</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産（流動資産）</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,079,356</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,939,534</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">81,558</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,021,092</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">23,644</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">23,644</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,997,448千円</td> </tr> </table>	未払費用	980,373千円	未払事業税	64,201	その他	34,781	小計	1,079,356	繰延税金資産（流動資産）	1,079,356	長期未払費用	1,939,534	その他	81,558	小計	2,021,092	その他有価証券評価差額金	23,644	小計	23,644		1,997,448千円
未払費用	735,838千円																																												
未払事業税	67,023																																												
その他	24,108																																												
小計	826,971																																												
繰延税金資産（流動資産）	826,971																																												
長期未払費用	1,710,136																																												
その他	69,177																																												
小計	1,779,313																																												
その他有価証券評価差額金	192,256																																												
小計	192,256																																												
	1,587,056千円																																												
未払費用	980,373千円																																												
未払事業税	64,201																																												
その他	34,781																																												
小計	1,079,356																																												
繰延税金資産（流動資産）	1,079,356																																												
長期未払費用	1,939,534																																												
その他	81,558																																												
小計	2,021,092																																												
その他有価証券評価差額金	23,644																																												
小計	23,644																																												
	1,997,448千円																																												
<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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率（調整）</td> <td style="text-align: right;">35.64 %</td> </tr> <tr> <td>賞与等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">10.62 %</td> </tr> <tr> <td>法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正</td> <td style="text-align: right;">5.57 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.11 %</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">51.94 %</td> </tr> </table>	法定実効税率（調整）	35.64 %	賞与等永久に損金に算入されない項目	10.62 %	法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	5.57 %	その他	0.11 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	51.94 %	<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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率（調整）</td> <td style="text-align: right;">33.06 %</td> </tr> <tr> <td>賞与等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.02 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.40 %</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">35.67 %</td> </tr> </table>	法定実効税率（調整）	33.06 %	賞与等永久に損金に算入されない項目	3.02 %	その他	0.40 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.67 %																										
法定実効税率（調整）	35.64 %																																												
賞与等永久に損金に算入されない項目	10.62 %																																												
法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	5.57 %																																												
その他	0.11 %																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	51.94 %																																												
法定実効税率（調整）	33.06 %																																												
賞与等永久に損金に算入されない項目	3.02 %																																												
その他	0.40 %																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.67 %																																												

<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 style="text-align: center;">第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12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>	<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 style="text-align: center;">該当事項はありません。</p>

〔セグメント情報等〕

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。

第21期（自 平成27年4月1日 至 平成27年12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	11,823,135	6,961,333	4,316,802	23,101,271

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
19,904,703	3,196,568	23,101,271

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。										
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21期
（自 平成27年4月1日
至 平成27年12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（注1）	4,175,357 1,882,545 5,350,334		

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 （注1）	2,233,594	有価証券	12,097,990
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 （注2）	5,538,780	未払費用 長期未払費用	3,776,015 7,075,447
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	1,344,386

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。

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20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）		第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）	
1株当たり純資産額	2,523,445円38銭	1株当たり純資産額	2,261,690円72銭
1株当たり当期純利益金額	330,510円53銭	1株当たり当期純利益金額	418,340円43銭
損益計算書上の当期純利益	2,115,267千円	損益計算書上の当期純利益	2,677,378千円
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	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	2,677,378千円
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22期中間会計期間末 (平成28年6月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		6,131,137	
有価証券		14,599,975	
支払委託金		13	
未収委託者報酬		1,397,748	
未収運用受託報酬		1,263,462	
未収収益		153,708	
繰延税金資産		707,818	
流動資産計		24,253,863	91.3
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		595,638	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,709,539	
投資その他の資産計		2,315,178	
固定資産計		2,315,178	8.7
資産合計		26,569,042	100.0

区分	注記 番号	第22期中間会計期間末 (平成28年6月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		442	
未払金		465,309	
未払費用		4,171,177	
未払法人税等		165,578	
未払消費税等	* 1	152,019	
流動負債計		4,954,528	18.6
固定負債			
長期未払費用		6,226,542	
固定負債計		6,226,542	23.4
負債合計		11,181,070	42.1
(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		14,452,028	
利益剰余金合計		14,452,028	
株主資本合計		15,332,028	57.7
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		55,943	
評価・換算差額等合計		55,943	
純資産合計		15,387,971	57.9
負債・純資産合計		26,569,042	100.0

(2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第22期中間会計期間 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年 6月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		7,555,676	
運用受託報酬		4,274,521	
その他営業収益		2,358,967	
営業収益計		14,189,164	100.0
営業費用及び一般管理費		12,762,299	89.9
営業利益		1,426,864	10.1
営業外収益	* 1	310,148	2.2
経常利益		1,737,012	12.2
税引前中間純利益		1,737,012	12.2
法人税、住民税及び事業税		171,763	1.2
法人税等調整額		658,395	4.6
中間純利益		906,853	6.4

重要な会計方針

項目	第22期中間会計期間 (自 平成28年1月1日 至 平成28年6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>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第22期中間会計期間末 (平成28年6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22期中間会計期間 (自 平成28年1月1日 至 平成28年6月30日)
* 1 営業外収益のうち主要なもの	株式会社従業員報酬 286,963千円

（リース取引関係）

第22期中間会計期間（自平成28年1月1日 至平成28年6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22期中間会計期間（自平成28年1月1日 至平成28年6月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成28年6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	6,131,137	6,131,137	-
有価証券			
その他有価証券	14,599,975	14,599,975	-
未収委託者報酬	1,397,748	1,397,748	-
未収運用受託報酬	1,263,462	1,263,462	-
投資有価証券			
その他有価証券	595,638	595,638	-

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22期中間会計期間末（平成28年6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	582,140	82,140
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	15,000	13,498	1,501
	コマーシャル・ペーパー	14,599,975	14,599,975	-

（デリバティブ取引関係）

第22期中間会計期間（自平成28年1月1日 至平成28年6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22期中間会計期間（自平成28年1月1日 至平成28年6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	7,555,676	4,274,521	2,358,967	14,189,164

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
12,434,324	1,754,839	14,189,164

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22期 中間会計期間 (自 平成28年 1月 1日 至 平成28年 6月30日)	
1株当たり純資産額	2,404,370円50銭
1株当たり中間純利益金額	141,695円85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	906,853千円
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	906,853千円
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22期中間会計期間（自平成28年 1月 1日 至平成28年 6月30日）

該当事項はありません。

第3【その他】

<訂正前>

(1) 目論見書の表紙等に、委託会社に関する情報を記載し、本ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを表示し、イラストを採用することおよび本ファンドの概略的性格を表示する文言を列挙することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。

(中略)

- ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

(2) 交付目論見書の投資リスクに関するページに、クーリングオフに関する事項を記載することがあります。

(後略)

<訂正後>

(1) 目論見書の表紙等に、委託会社に関する情報を記載し、本ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを表示し、イラストを採用することおよび本ファンドの概略的性格を表示する文言を列挙することがあります。また、以下の内容を記載することがあります。

(中略)

- ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・ 請求目論見書の閲覧、請求に関する事項
- ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

(2) 交付目論見書の投資リスクに関するページに、クーリングオフに関する事項を記載することがあります。

(後略)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年1月18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 あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 佐々木 貴司
指定有限責任社員 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28年6月8日から平成28年12月7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28年12月7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28年6月8日から平成28年12月7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29年1月18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 あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士 佐々木 貴司
指定有限責任社員 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28年6月8日から平成28年12月7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28年12月7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28年6月8日から平成28年12月7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28年3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12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28年9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 あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐々木 貴司指定有限責任社員
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28年1月1日から平成28年12月31日までの第22期事業年度の中間会計期間（平成28年1月1日から平成28年6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28年6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28年1月1日から平成28年6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。