

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年12月10日
【発行者名】	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 土岐 大介
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木六丁目10番1号 六本木ヒルズ森タワー
【事務連絡者氏名】	法務部 山崎 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】	GSグローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成22年6月11日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項に変更が生じ、また、本日、半期報告書を提出いたしましたので、原届出書の関係事項を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下のとおり訂正または更新します。

下線部__が訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(12) その他

<訂正前>

<中略>

(ご参考) ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

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

2010年6月11日現在、委託会社が認識し得る2010年12月未までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

(12) その他

<訂正後>

<中略>

(ご参考) ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

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

2010年12月10日現在、委託会社が認識し得る2011年6月末までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

<訂正前>

（1）ファンドの目的及び基本的性格

<中略>

<ファンドの特徴>

<図略>

2010年6月11日現在

<中略>

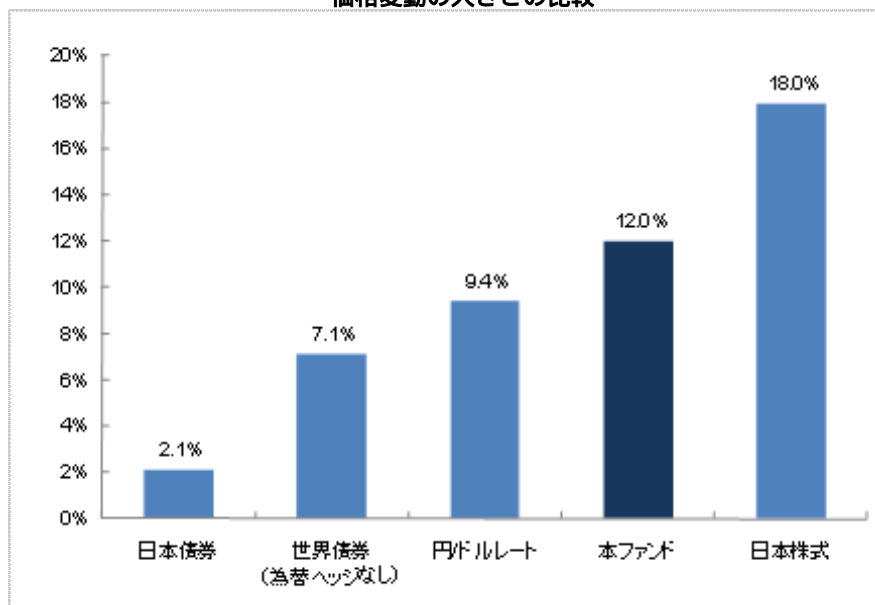
<（ご参考）ファンドのリスク水準について>

<中略>

下図は、各資産の過去10年間（2000年4月から2010年3月まで）のリスク水準（月次リターンの年率標準偏差）と本ファンドの目標リスク水準を比較したものです。トラッキング・エラーが仮に目標値通りとした場合、本ファンドの価格変動の大きさは、日本債券や世界債券（為替ヘッジなし）、円/ドルレートよりは大きく、日本株式よりは小さい水準となります。

<中略>

価格変動の大きさの比較



期間：2000年4月～2010年3月

<中略>

(2) ファンドの仕組み

< 中略 >

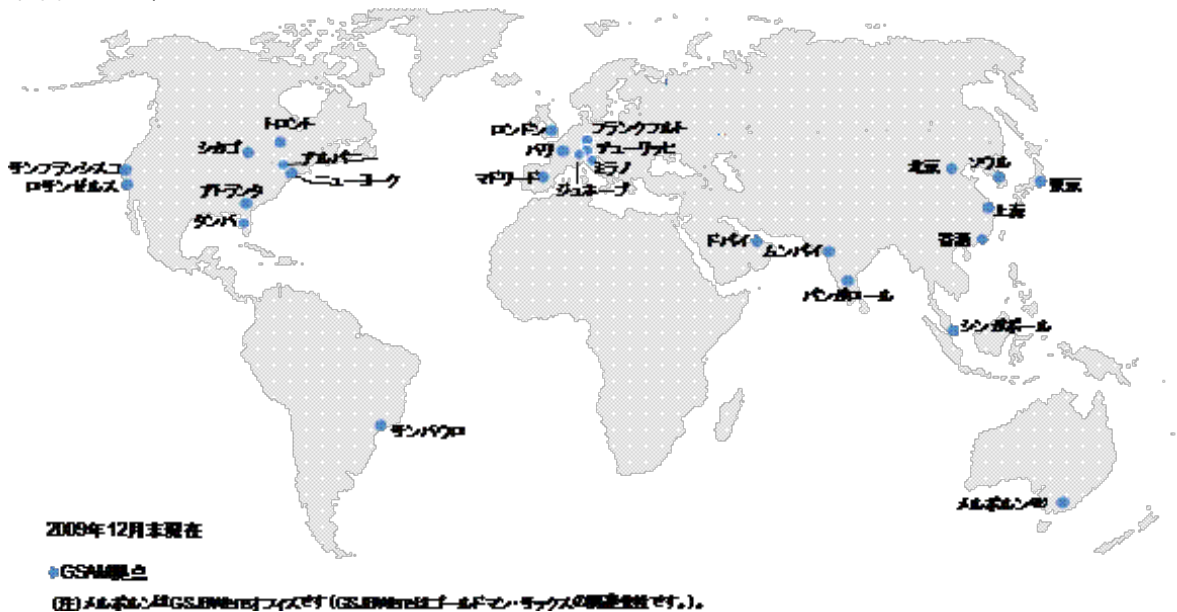
(ご参考) ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)とは

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

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

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

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



< 後略 >

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

<中略>

<ファンドの特徴>

<図略>

2010年12月10日現在

<中略>

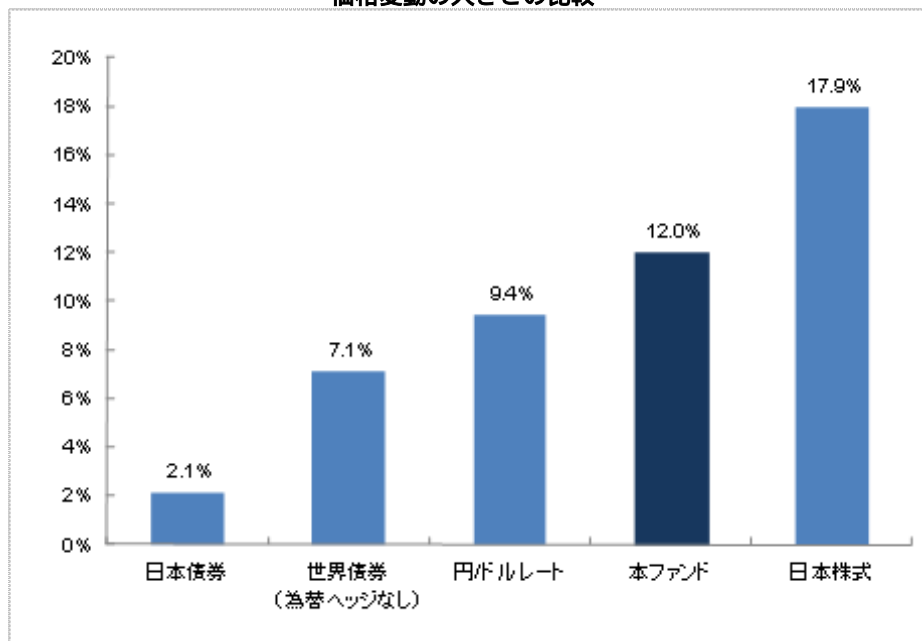
<(ご参考)ファンドのリスク水準について>

<中略>

下図は、各資産の過去10年間（2000年10月から2010年9月まで）のリスク水準（月次リターンの年率標準偏差）と本ファンドの目標リスク水準を比較したものです。トラッキング・エラーが仮に目標値通りとした場合、本ファンドの価格変動の大きさは、日本債券や世界債券（為替ヘッジなし）、円/ドルレートよりは大きく、日本株式よりは小さい水準となります。

<中略>

価格変動の大きさの比較



期間：2000年10月～2010年9月

<中略>

(2) ファンドの仕組み

< 中略 >

(ご参考) ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) とは

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

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

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

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



2010年6月末現在

● GSAM拠点

(注) シドニーは Goldman Sachs & Partners Australia Pty Ltd オフィスです。

< 後略 >

2 投資方針

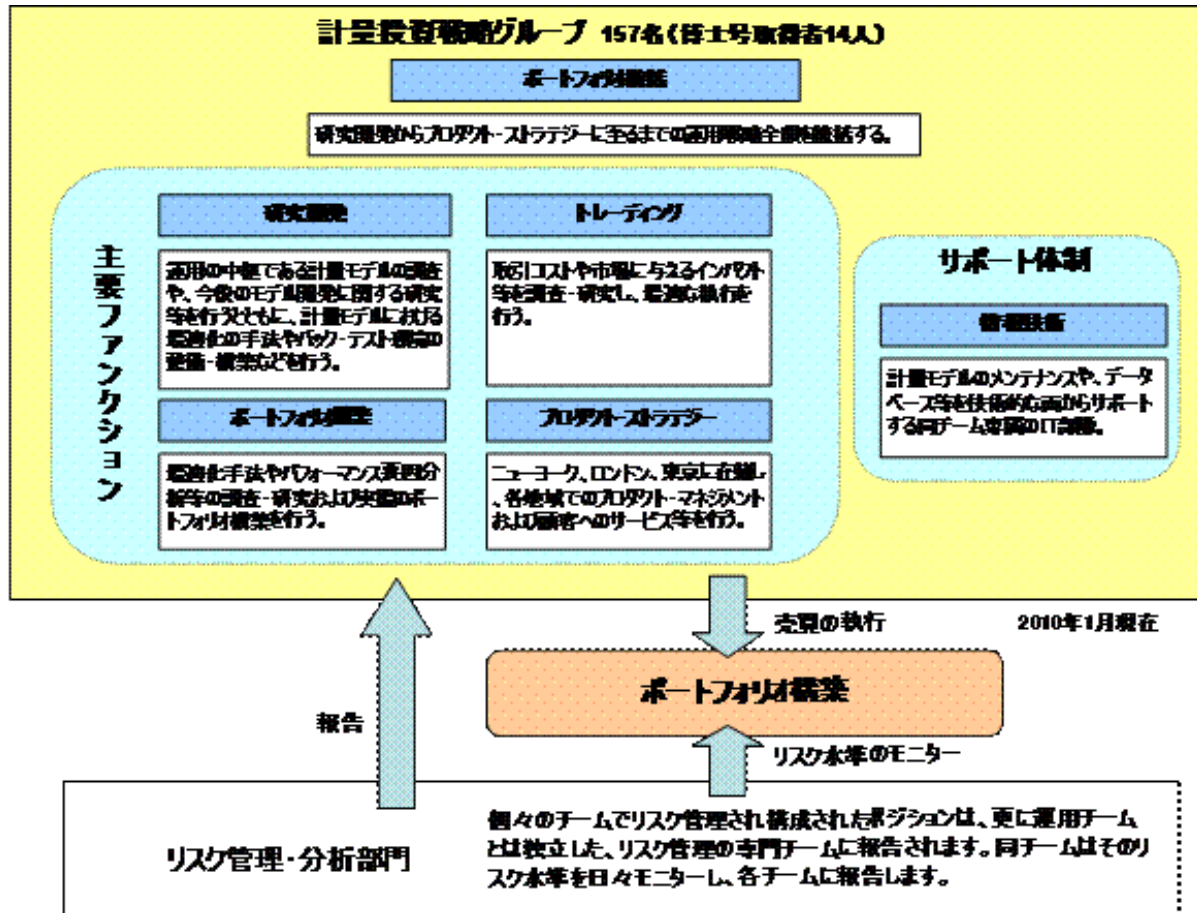
< 訂正前 >

< 前略 >

(3) 運用体制

a. 組織

本ファンドの運用は、GSAMニューヨークの計量投資戦略グループが主として担当します。



< 中略 >

c. 内部管理体制

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

(4) 分配方針

< 中略 >

2 自動けいぞく投資コースをお申込みの場合、収益分配金は、税金を差引いた後、各計算期間終了日の基準価額により無手数料で全額自動的に再投資されます。

(5) 投資制限

< 後略 >

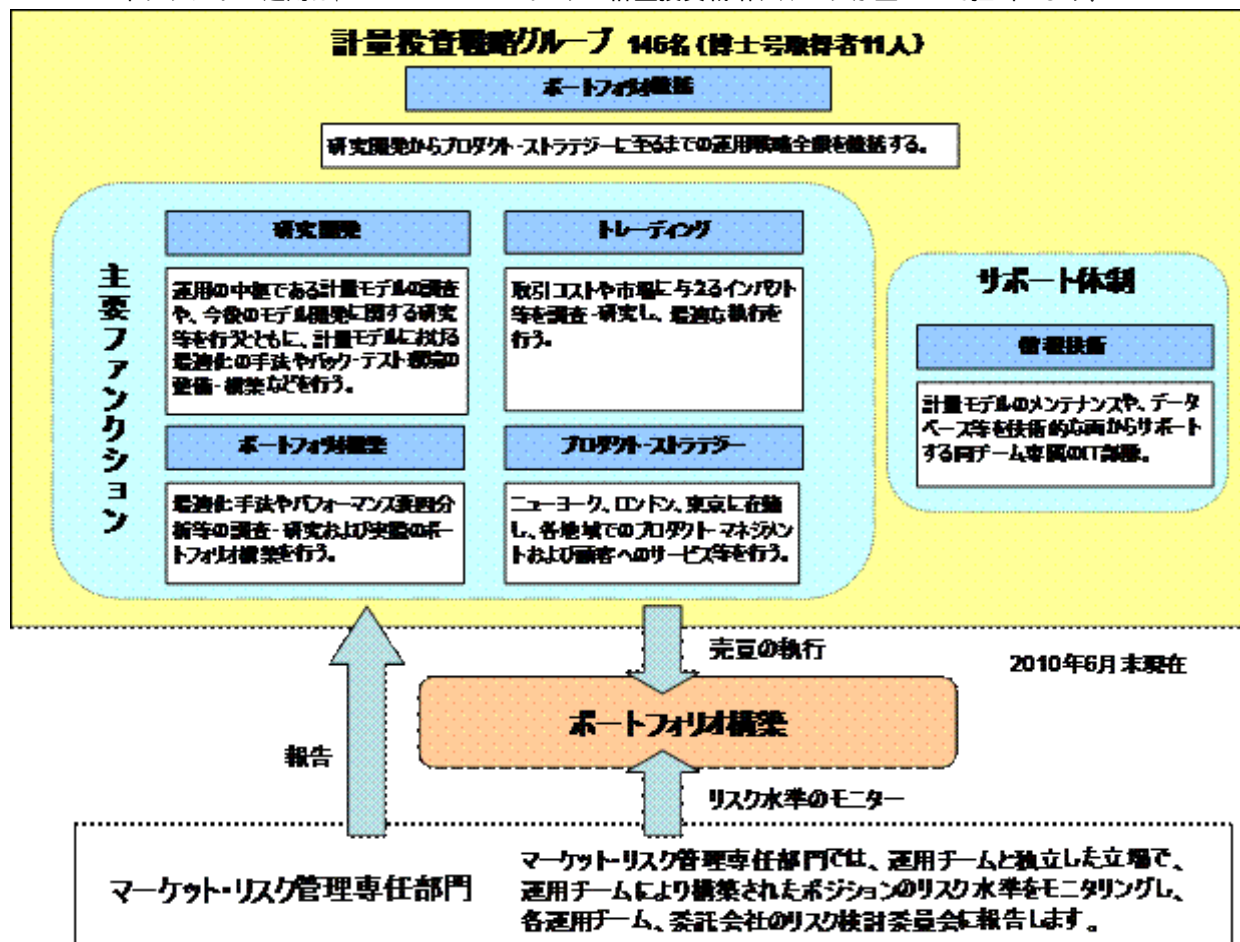
<訂正後>

<前略>

(3) 運用体制

a. 組織

本ファンドの運用は、GSAMニューヨークの計量投資戦略グループが主として担当します。



<中略>

c. 内部管理体制

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

(4) 分配方針

<中略>

2 自動けいぞく投資コースをお申込みの場合、収益分配金は、税金を差引いた後、各計算期間終了日の基準価額により無手数料で全額自動的に再投資されます。

<収益分配金に関わる留意点>

本ファンドは以下の分配原資を分配対象とすることができます。

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

毎決算時に、基準価額水準、市場動向等を勘案して収益を分配します。ただし、基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本（1万円＝1万円）を下回る場合においても分配を行うことがあります。収益分配は、これを行わない場合と比較すると、その金額相当分、基準価額が低くなり、その影響により、換金時・

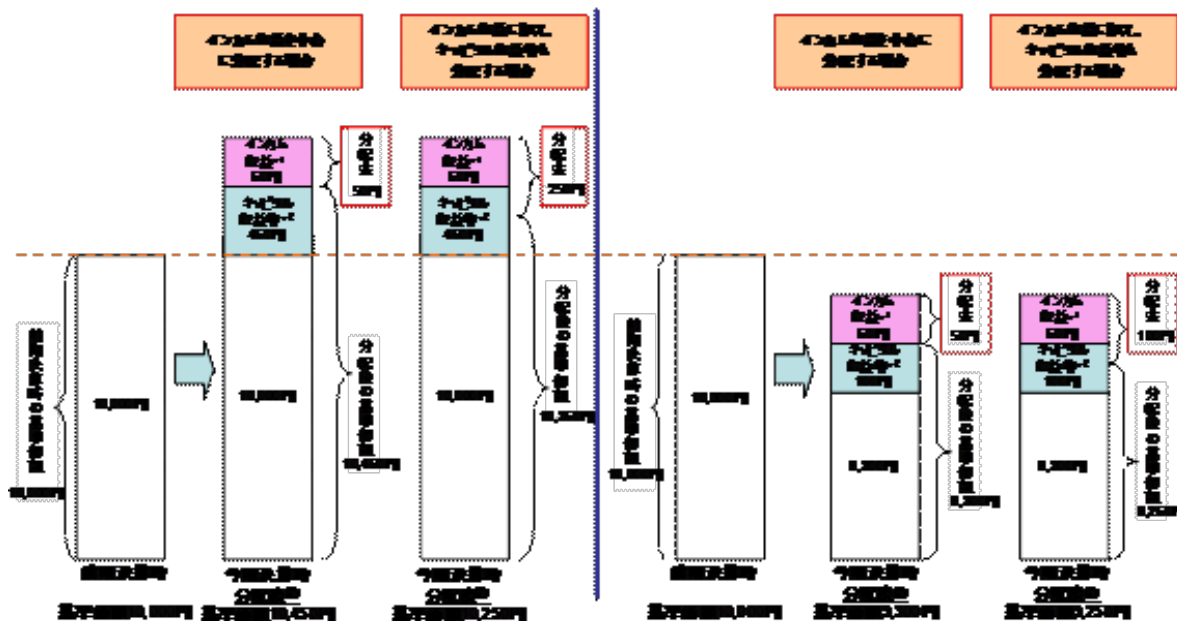
償還時において元本割れとなる可能性があるほか、信託財産の成長性に影響する可能性があります。本ファンドがキャピタル収益から収益分配金を支払う場合には、かかる影響の程度がより大きくなる傾向があります。

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

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

前期末決算から基準価額が上昇した場合

前期末決算から基準価額が下落した場合



- ① インカム収益は分配原資として（図中の①の枠に示したインカム収益および②のインカム収益のうち①の枠に示した部分）を分配します。
 ② インカム収益は分配原資として（図中の②の枠に示したインカム収益および①のインカム収益のうち②の枠に示した部分）を分配します。
 ③ 上記はイメージであり、実際の分配金額は基準価額を考慮して決定されるため、必ずしもこの通りとは限りません。

(5) 投資制限

< 後略 >

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 投資リスク

<中略>

(i) ファミリーファンド方式に関わる留意点

<中略>

(j) 収益分配方針に関わる留意点

本ファンドは、経費控除後の配当等収益および売買損益（評価損益も含まれます。）を分配対象収益とし、年2回の決算時に、基準価額水準、市場動向等を勘案して収益を分配します。基準価額水準、市場動向等によっては分配を行わないこともあります。また、基準価額が当初元本（1万口＝1万円）を下回る場合においても分配を行う場合があります。

期中分配は、これをまったく行わなかったと仮定した場合に比べれば、信託期間終了時の基準価額が低くなる可能性が高いといえます。例えば、期中分配を行った後、解約時・償還時に元本割れしたが、仮に期中分配をまったく行わなかったとすれば元本割れしなかったかもしれない、というような事態が生じる可能性もあります。

上記のように、本ファンドへの投資による運用成果は基準価額の水準によって大きく変動します。従って、収益の分配は本ファンドの投資成果として一定の利回りを保証するものでも、示唆するものでもありません。

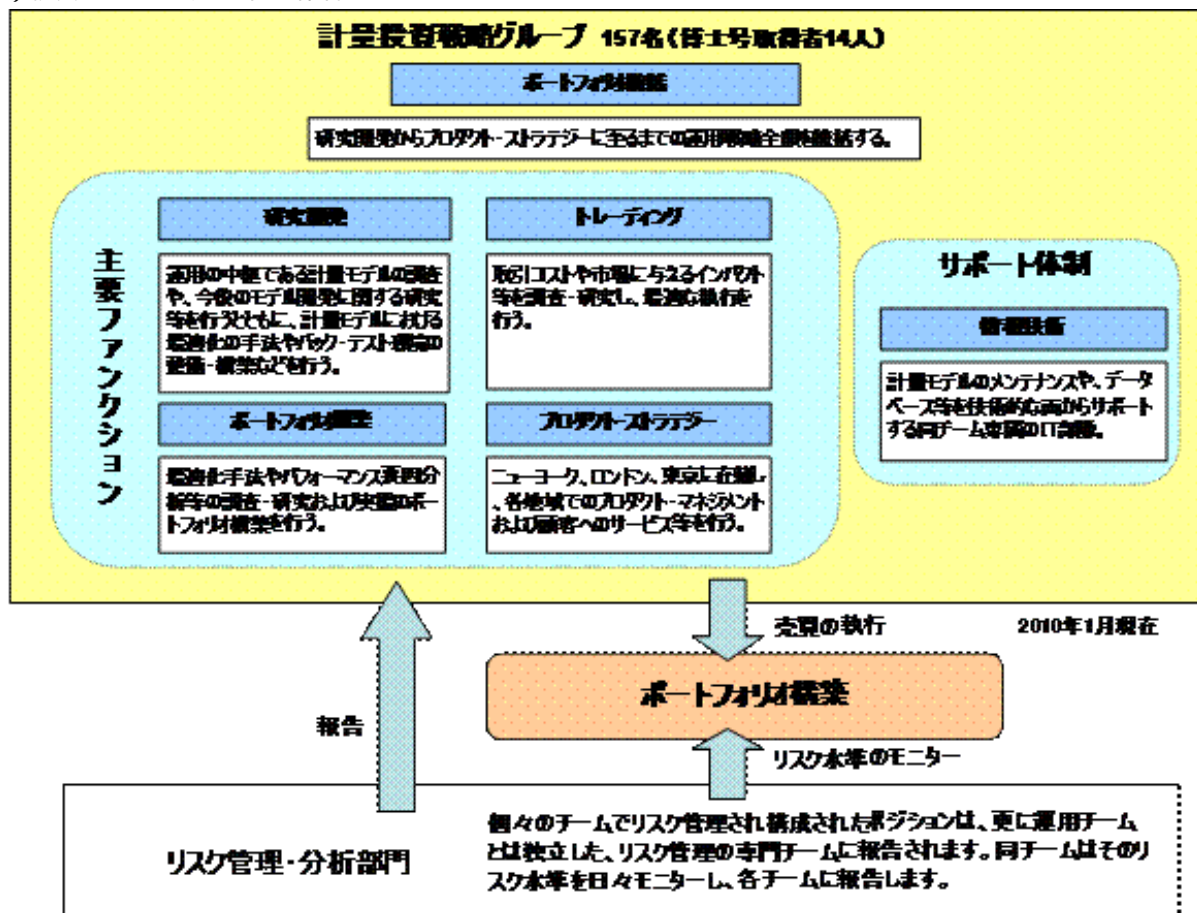
(k) お買付およびご換金の制限に関わる留意点

<中略>

(l) 法令・税制・会計等の変更可能性に関わる留意点

<中略>

(2) 投資リスクに対する管理体制



<後略>

<訂正後>

(1) 投資リスク

<中略>

(i) ファミリーファンド方式に関わる留意点

<中略>

(j) お買付およびご換金の制限に関わる留意点

< 中略 >

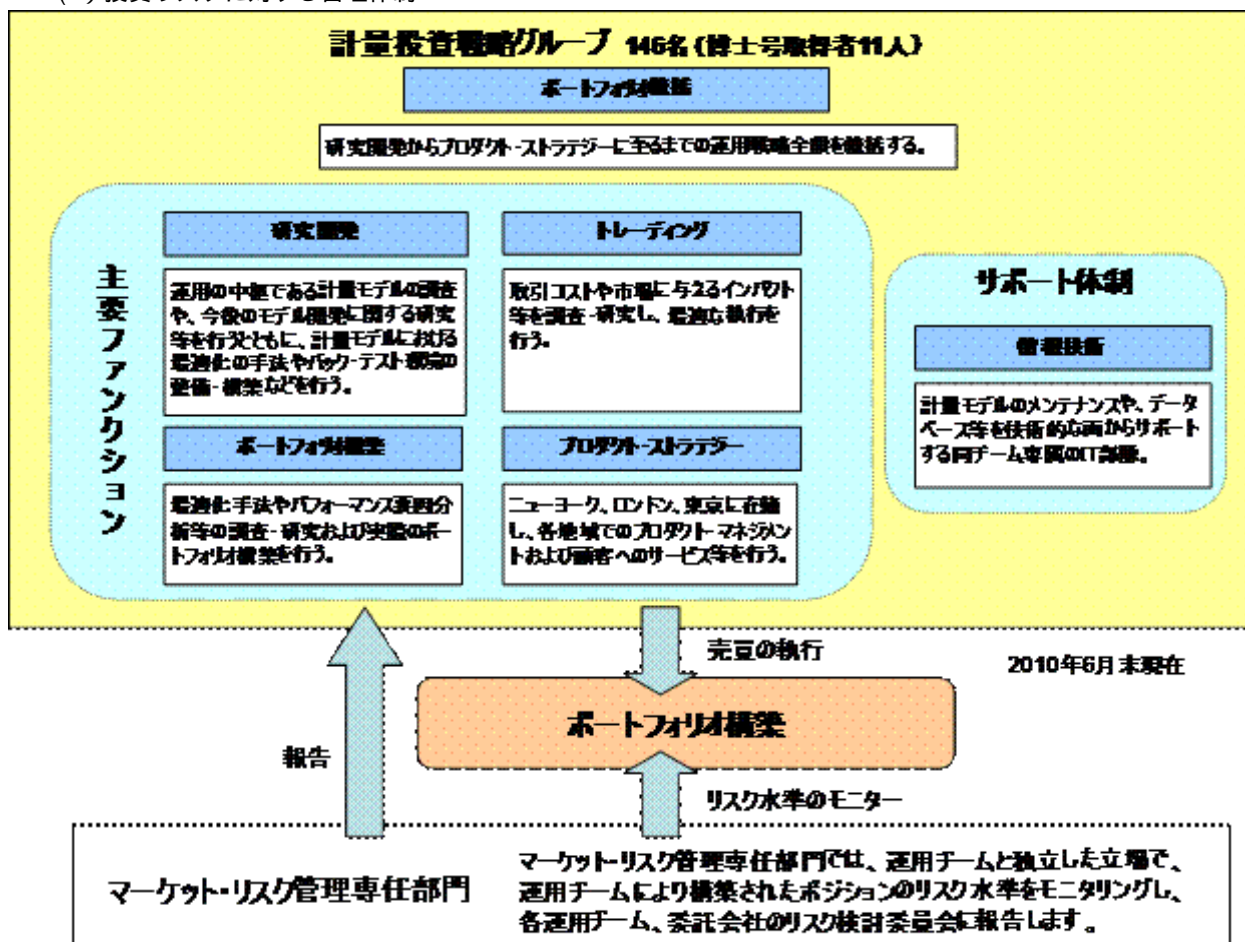
(k) 繰上償還に関わる留意点

本ファンドは、受益権の総口数が30億口を下回ることとなった場合等には、受託銀行と協議のうえ、必要な手続を経て、繰上償還されることがあります。また、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、または正当な理由があるときは、受託銀行と合意のうえ、必要な手続を経て、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。その場合、申込手数料は返還されません。

(l) 法令・税制・会計等の変更可能性に関わる留意点

< 中略 >

(2) 投資リスクに対する管理体制



< 後略 >

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

(b) 成功報酬

< 訂正前 >

< 前略 >

(注1) 1ヵ月円LIBORは、2010年3月末現在、年率0.155%です。ハイ・ウォーターマークの計算において適用される1ヵ月円LIBORは市場動向により変動します。

< 後略 >

< 訂正後 >

< 前略 >

(注1) 1ヵ月円LIBORは、2010年9月末現在、年率0.14%です。ハイ・ウォーターマークの計算において適用される1ヵ月円LIBORは市場動向により変動します。

< 後略 >

[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

(2010年9月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	-	5,225,494,915	100.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	4,645,572	0.09
合計(純資産総額)	-	5,220,849,343	100.00

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

参考情報

<GSグローバル・マーケット・ストラテジー・マザーファンド>

(2010年9月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	アメリカ	8,983,725,426	74.54
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,068,715,977	25.46
合計(純資産総額)	-	12,052,441,403	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

(2010年9月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (口数)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資 信託受 益証券	GSグロー バル・マ ーケット・ス トラテジ ー・マザー ファンド	4,911,641,052	0.9730	4,779,026,744	1.0639	5,225,494,915	100.09

種類別及び業種別投資比率 (2010年9月30日現在)

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.09
合計	100.09

(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

(2010年9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

(2010年9月30日現在)

該当事項はありません。

参考情報

<GSグローバル・マーケット・ストラテジー・マザーファンド>

投資有価証券の主要銘柄

(2010年9月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (券面総額)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	特殊債券	FHLB DISCOUNT NT 0%	46,640,000	8,378.35	3,907,664,226	8,379.91	3,908,391,368	-	2010/12/3	32.43
2	アメリカ	特殊債券	FHLB DISCOUNT NT 0%	36,160,000	8,378.39	3,029,627,899	8,380.40	3,030,355,323	-	2010/11/26	25.14
3	アメリカ	特殊債券	FHLB DISCOUNT NT 0%	18,500,000	8,377.97	1,549,925,247	8,381.53	1,550,583,162	-	2010/10/20	12.87
4	アメリカ	特殊債券	FRE DISCOUNT NT 0%	5,900,000	8,379.50	494,390,600	8,379.58	494,395,573	-	2010/12/13	4.10

種類別及び業種別投資比率 (2010年9月30日現在)

種類	投資比率 (%)
特殊債券	74.54
合計	74.54

(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

（2010年9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
有価証券先物取引等

(2010年9月30日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	その他	Nasdaq Omx Europe	OMXS30	売建	17	スウェーデンクローナ	1,828,789.76	1,846,200	23,022,114	0.19
	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物	売建	2	日本円	16,533,250	16,530,000	16,530,000	0.14
	アメリカ	シカゴ商品取引所	DJIA MINI	売建	593	米ドル	31,007,457.25	31,962,700	2,679,113,514	22.23
	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	607	米ドル	33,314,739.75	34,626,315	2,902,377,723	24.08
	アメリカ	シカゴ商業取引所	NSDQ100 MINI	買建	708	米ドル	26,668,059	28,447,440	2,384,464,420	19.78
	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	RUSSELL MINI	売建	563	米ドル	36,062,077.35	38,036,280	3,188,200,989	26.45
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	売建	194	カナダドル	27,253,442	27,668,280	2,246,110,970	18.64
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DAX DTB	買建	136	ユーロ	21,380,936.9	21,277,200	2,430,707,328	20.17
	イタリア	イタリア証券取引所	S&P/MIB	売建	6	ユーロ	626,673	608,610	69,527,606	0.58
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	売建	445	オーストラリアドル	51,987,669.83	51,987,125	4,234,351,331	35.13
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	692	英ポンド	38,234,670.86	38,381,780	5,092,110,753	42.25
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SWISS MKT	売建	349	スイスフラン	22,626,447.66	22,032,370	1,891,038,317	15.69
	香港	香港先物取引所	HANG SENG	買建	94	香港ドル	105,037,829.2	105,030,900	1,134,333,720	9.41
	シンガポール	シンガポール取引所	MSCI SING	買建	485	シンガポールドル	35,435,644.3	35,608,700	2,265,781,581	18.80
	オランダ	アムステルダム取引所	AEX	買建	459	ユーロ	30,758,516.5	30,844,800	3,523,709,952	29.24
スペイン	スペイン金融先物取引所(マドリード)	IBEX 35	売建	213	ユーロ	22,902,239.25	22,253,175	2,542,202,712	21.09	
その他	Marche des Options Negociables de Paris	CAC40	売建	48	ユーロ	1,812,388.8	1,793,760	204,919,142	1.70	
債券先物取引	日本	東京証券取引所	東証長期国債標準物先物	買建	15,000,000,000	日本円	21,197,050,000	21,513,000,000	21,513,000,000	178.49
	アメリカ	シカゴ商品取引所	CBT 10Y 1012	買建	388	米ドル	48,107,215.96	48,948,625	4,102,873,747	34.04
	カナダ	モントリオール取引所	MON 10Y 1012	売建	663	カナダドル	83,567,357.94	83,823,090	6,804,758,446	56.46
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	BUND10Y 1012	売建	17	ユーロ	2,238,897.85	2,240,770	255,985,564	2.12
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SFE10Y 1012	売建	897	オーストラリアドル	96,359,801.61	96,180,869.85	7,833,931,850	65.00
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	GILT 1012	売建	110	英ポンド	13,639,936.09	13,718,100	1,819,980,327	15.10

(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

2010年9月30日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり純 資産額(円) (分配落)	1口当たり純 資産額(円) (分配付)
第1期	(2005年3月14日)	63,674	63,687	1.0212	1.0214
第2期	(2006年3月13日)	40,685	40,702	1.2139	1.2144
第3期	(2007年3月12日)	42,141	42,141	0.9900	0.9900
第4期	(2008年3月12日)	14,304	14,304	0.7922	0.7922
第5期	(2009年3月12日)	8,433	8,433	0.7479	0.7479
第6期	(2010年3月12日)	5,975	5,975	0.8219	0.8219
	2009年9月末日	6,738	-	0.7982	-
	2009年10月末日	6,620	-	0.8059	-
	2009年11月末日	6,595	-	0.8250	-
	2009年12月末日	6,390	-	0.8219	-
	2010年1月末日	6,315	-	0.8364	-
	2010年2月末日	6,147	-	0.8383	-
	2010年3月末日	5,941	-	0.8274	-
	2010年4月末日	5,721	-	0.8207	-
	2010年5月末日	5,448	-	0.8057	-
	2010年6月末日	5,220	-	0.8011	-
	2010年7月末日	5,182	-	0.8272	-
	2010年8月末日	4,962	-	0.8269	-
	2010年9月末日	5,220	-	0.8893	-

(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

期	計算期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	自 2004年10月28日 至 2005年3月14日	0.0002
第2期	自 2005年3月15日 至 2006年3月13日	0.0005
第3期	自 2006年3月14日 至 2007年3月12日	0.0000
第4期	自 2007年3月13日 至 2008年3月12日	0.0000
第5期	自 2008年3月13日 至 2009年3月12日	0.0000
第6期	自 2009年3月13日 至 2010年3月12日	0.0000

収益率の推移

期	計算期間	収益率(%)
第1期	自 2004年10月28日 至 2005年3月14日	2.1
第2期	自 2005年3月15日 至 2006年3月13日	18.9
第3期	自 2006年3月14日 至 2007年3月12日	18.4
第4期	自 2007年3月13日 至 2008年3月12日	20.0
第5期	自 2008年3月13日 至 2009年3月12日	5.6
第6期	自 2009年3月13日 至 2010年3月12日	9.9
第7期 (中間期)	自 2010年3月13日 至 2010年9月12日	0.0

第2【財務ハイライト情報】

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

<追加>

中間財務諸表

【GSグローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	6,860,850,638	4,919,377,816
未収入金	407,276,905	26,176,613
流動資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429
資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429
負債の部		
流動負債		
未払解約金	438,964,572	26,176,613
未払受託者報酬	2,060,519	1,426,477
未払委託者報酬	72,118,201	49,926,793
その他未払費用	1,920,341	1,329,423
流動負債合計	515,063,633	78,859,306
負債合計	515,063,633	78,859,306
純資産の部		
元本等		
元本	8,675,908,124	5,920,720,973
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,922,844,214	1,054,025,850
（分配準備積立金）	783,821,393	541,865,076
元本等合計	6,753,063,910	4,866,695,123
純資産合計	6,753,063,910	4,866,695,123
負債純資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 自 2009年3月13日 至 2009年9月12日	第7期中間計算期間 自 2010年3月13日 至 2010年9月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	385,134,221	47,893,392
営業収益合計	385,134,221	47,893,392
営業費用		
受託者報酬	2,060,519	1,426,477
委託者報酬	72,118,201	49,926,793
その他費用	1,920,341	1,329,423
営業費用合計	76,099,061	52,682,693
営業利益又は営業損失()	309,035,160	4,789,301
経常利益又は経常損失()	309,035,160	4,789,301
中間純利益又は中間純損失()	309,035,160	4,789,301
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()	44,357,106	4,984,099
期首剰余金又は期首欠損金()	2,843,303,168	1,294,446,099
剰余金増加額又は欠損金減少額	655,780,900	240,649,347
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	655,780,900	240,649,347
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	423,896
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	423,896
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,922,844,214	1,054,025,850

[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)

項目	第6期中間計算期間 自 2009年3月13日 至 2009年9月12日	第7期中間計算期間 自 2010年3月13日 至 2010年9月12日
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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	11,276,823,028円	7,269,914,642円
期中追加設定元本額	- 円	2,362,821円
期中一部解約元本額	2,600,914,904円	1,351,556,490円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	8,675,908,124口	5,920,720,973口
3. 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,922,844,214円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,054,025,850円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

項目	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
1口当たり純資産額	0.7784円	0.8220円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GSグローバル・マーケット・ストラテジー・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。

なお、同親投資信託の状況は以下の通りです。

「GSグローバル・マーケット・ストラテジー・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		43,209	25,157,741
コール・ローン		3,225,769,647	2,496,103,526
特殊債券	1	11,754,435,331	8,520,050,313
派生商品評価勘定		2,371,004,102	953,019,373
未収入金		1,691,826,286	1,154,803,994
未収利息		10,594	7,397
差入委託証拠金		-	198,655,321
流動資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665
資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,498,503,125	597,802,808
前受金		8,895,606	-
未払金		1,512,731,076	1,234,913,929
未払解約金		452,803,092	51,240,334
流動負債合計		3,472,932,899	1,883,957,071
負債合計		3,472,932,899	1,883,957,071

純資産の部			
元本等			
元本		17,059,938,178	11,667,510,530
剰余金			
欠損金		1,489,781,908	203,669,936
剰余金合計		1,489,781,908	203,669,936
元本等合計		15,570,156,270	11,463,840,594
純資産合計		15,570,156,270	11,463,840,594
負債・純資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2009年 3月13日 至 2009年 9月12日	自 2010年 3月13日 至 2010年 9月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>特殊債券</p> <p>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。</p>	<p>特殊債券</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、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>(2) 先物取引</p> <p>個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。</p>	<p>(1) 為替予約取引</p> <p>同左</p> <p>(2) 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)

項目	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)												
1. 元本の推移														
期首元本額	23,508,852,935円	15,001,913,103円												
期中追加設定元本額	725,266,475円	144,980,164円												
期中一部解約元本額	7,174,181,232円	3,479,382,737円												
期末元本額	17,059,938,178円	11,667,510,530円												
元本の内訳														
GSグローバル・マーケット・ストラテジー (年1回決算型)	7,517,092,844円	5,007,000,322円												
野村ファンドラップ オルタナティブ GS グ ローバル・マーケット・ストラテジー	965,696,203円	790,596,759円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジー (年2回決算型)	7,408,692,883円	5,151,690,029円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジー (野村SMA向け)	747,411,176円	617,467,749円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジーF (適格機関投資家専用)	421,045,072円	100,755,671円												
2. 差入委託証拠金代用有価証券(1)	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として、以下の とおり差入を行なっております。	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として、以下の とおり差入を行なっております。												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>特殊債券</td> <td>3,408,363,309円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,408,363,309円</td> </tr> </tbody> </table>	担保資産	金額	特殊債券	3,408,363,309円	合計	3,408,363,309円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>特殊債券</td> <td>2,943,587,132円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>2,943,587,132円</td> </tr> </tbody> </table>	担保資産	金額	特殊債券	2,943,587,132円	合計	2,943,587,132円
担保資産	金額													
特殊債券	3,408,363,309円													
合計	3,408,363,309円													
担保資産	金額													
特殊債券	2,943,587,132円													
合計	2,943,587,132円													
3. 計算期間末日における受益権の総数	17,059,938,178口	11,667,510,530口												
4. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は1,489,781,908円でありま す。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は203,669,936円でありま す。												

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超(円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超(円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価 指数 先物 取引								
	買建	16,784,182,191	-	18,194,373,549	1,410,191,358	21,572,906,548	-	22,289,441,917	716,535,369
	売建	13,406,423,764	-	14,567,117,105	1,160,693,341	18,059,244,430	-	18,259,325,333	200,080,903
合計		30,190,605,955	-	32,761,490,654	249,498,017	39,632,150,978	-	40,548,767,250	516,454,466

(2) 債券関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12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	23,795,146,973	-	23,859,170,498	64,023,525	37,688,921,865	-	37,629,148,242	59,773,623
	売建	30,727,607,546	-	30,826,121,119	98,513,573	13,981,556,400	-	14,081,716,198	100,159,798
合計		54,522,754,519	-	54,685,291,617	34,490,048	51,670,478,265	-	51,710,864,440	159,933,421

(3) 通貨関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12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	7,061,137,000	-	6,969,073,000	92,064,000	3,622,175,700	-	3,604,887,000	17,288,700
	カナダドル	8,534,100	-	8,498,000	36,100	305,520,000	-	308,674,000	3,154,000
	ユーロ	2,685,658,000	-	2,669,800,000	15,858,000	1,457,875,000	-	1,451,198,750	6,676,250
	英ポンド	2,932,692,562	-	2,935,047,500	2,354,938	2,791,916,000	-	2,799,140,000	7,224,000
	スウェーデンクローナ	1,676,864,000	-	1,675,520,000	1,344,000	7,105,824,000	-	7,084,000,000	21,824,000
	ノルウェークローネ	2,733,984,000	-	2,703,360,000	30,624,000	297,050,600	-	297,000,000	50,600
	オーストラリアドル	5,887,571,200	-	5,856,092,000	31,479,200	-	-	-	-
	ニュージーランドドル	3,385,463,100	-	3,393,621,000	8,157,900	101,847,000	-	102,850,000	1,003,000
	シンガポールドル	2,343,310,200	-	2,333,727,000	9,583,200	-	-	-	-
	売建								
	米ドル	20,629,348,670	-	19,847,841,200	781,507,470	9,805,363,920	-	9,774,442,000	30,921,920
	カナダドル	2,354,839,600	-	2,345,448,000	9,391,600	838,288,500	-	852,915,000	14,626,500
	ユーロ	5,879,952,000	-	5,856,873,750	23,078,250	2,058,688,000	-	2,023,690,000	34,998,000
	英ポンド	4,699,545,500	-	4,707,511,250	7,965,750	-	-	-	-
	スイスフラン	2,011,133,599	-	2,007,915,000	3,218,599	4,682,086,250	-	4,666,722,500	15,363,750
	スウェーデンクローナ	3,106,704,000	-	3,089,240,000	17,464,000	-	-	-	-
	ノルウェークローネ	-	-	-	-	709,748,000	-	702,000,000	7,748,000
	オーストラリアドル	220,595,200	-	219,212,000	1,383,200	2,428,389,900	-	2,462,391,000	34,001,100
ニュージーランドドル	50,941,600	-	51,128,000	186,400	749,000,000	-	756,250,000	7,250,000	
シンガポールドル	19,364,700	-	19,287,000	77,700	-	-	-	-	

合計	67,687,639,031	-	66,689,194,700	657,493,007	36,953,772,870	-	36,886,160,250	1,304,480
----	----------------	---	----------------	-------------	----------------	---	----------------	-----------

(注) 時価の算定方法

・先物取引

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

・為替予約取引

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - (1) 計算期間末日において予約為替の受渡し日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
 - (2) 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値により評価しております。

(1口当たり情報)

項目	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)
1口当たり純資産額	0.9127円	0.9825円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

第三部【ファンドの詳細情報】

第4【ファンドの経理状況】

1 財務諸表

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

<追加>

(1) 本ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、中間財務諸表に掲載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 本ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間（2009年3月13日から2009年9月12日まで）及び第7期中間計算期間（2010年3月13日から2010年9月12日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

【GSグローバル・マーケット・ストラテジー(年1回決算型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	6,860,850,638	4,919,377,816
未収入金	407,276,905	26,176,613
流動資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429
資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429
負債の部		
流動負債		
未払解約金	438,964,572	26,176,613
未払受託者報酬	2,060,519	1,426,477
未払委託者報酬	72,118,201	49,926,793
その他未払費用	1,920,341	1,329,423
流動負債合計	515,063,633	78,859,306
負債合計	515,063,633	78,859,306
純資産の部		
元本等		
元本	8,675,908,124	5,920,720,973
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,922,844,214	1,054,025,850
(分配準備積立金)	783,821,393	541,865,076
元本等合計	6,753,063,910	4,866,695,123
純資産合計	6,753,063,910	4,866,695,123
負債純資産合計	7,268,127,543	4,945,554,429

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第 6 期中間計算期間 自 2009年 3 月13日 至 2009年 9 月12日	第 7 期中間計算期間 自 2010年 3 月13日 至 2010年 9 月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	385,134,221	47,893,392
営業収益合計	385,134,221	47,893,392
営業費用		
受託者報酬	2,060,519	1,426,477
委託者報酬	72,118,201	49,926,793
その他費用	1,920,341	1,329,423
営業費用合計	76,099,061	52,682,693
営業利益又は営業損失()	309,035,160	4,789,301
経常利益又は経常損失()	309,035,160	4,789,301
中間純利益又は中間純損失()	309,035,160	4,789,301
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()	44,357,106	4,984,099
期首剰余金又は期首欠損金()	2,843,303,168	1,294,446,099
剰余金増加額又は欠損金減少額	655,780,900	240,649,347
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	655,780,900	240,649,347
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	423,896
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	423,896
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,922,844,214	1,054,025,850

[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)

項目	第6期中間計算期間 自 2009年3月13日 至 2009年9月12日	第7期中間計算期間 自 2010年3月13日 至 2010年9月12日
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

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	11,276,823,028円	7,269,914,642円
期中追加設定元本額	- 円	2,362,821円
期中一部解約元本額	2,600,914,904円	1,351,556,490円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	8,675,908,124口	5,920,720,973口
3. 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,922,844,214円であります。	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,054,025,850円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

項目	第6期中間計算期間 (2009年9月12日現在)	第7期中間計算期間 (2010年9月12日現在)
1口当たり純資産額	0.7784円	0.8220円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GSグローバル・マーケット・ストラテジー・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。

なお、同親投資信託の状況は以下の通りです。

「GSグローバル・マーケット・ストラテジー・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		43,209	25,157,741
コール・ローン		3,225,769,647	2,496,103,526
特殊債券	1	11,754,435,331	8,520,050,313
派生商品評価勘定		2,371,004,102	953,019,373
未収入金		1,691,826,286	1,154,803,994
未収利息		10,594	7,397
差入委託証拠金		-	198,655,321
流動資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665
資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,498,503,125	597,802,808
前受金		8,895,606	-
未払金		1,512,731,076	1,234,913,929
未払解約金		452,803,092	51,240,334
流動負債合計		3,472,932,899	1,883,957,071
負債合計		3,472,932,899	1,883,957,071

純資産の部			
元本等			
元本		17,059,938,178	11,667,510,530
剰余金			
欠損金		1,489,781,908	203,669,936
剰余金合計		1,489,781,908	203,669,936
元本等合計		15,570,156,270	11,463,840,594
純資産合計		15,570,156,270	11,463,840,594
負債・純資産合計		19,043,089,169	13,347,797,665

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2009年 3月13日 至 2009年 9月12日	自 2010年 3月13日 至 2010年 9月12日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	<p>特殊債券 個別法に基づき、法令及び社団法人投資 信託協会規則に従い、時価評価してありま す。</p>	<p>特殊債券 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 における計算期間末日の対顧客先物売 買相場の仲値によって計算してありま す。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投 資信託協会規則に従い、時価評価してあ ります。</p>	<p>(1) 為替予約取引 同左 (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。 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）

項目	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)												
1. 元本の推移														
期首元本額	23,508,852,935円	15,001,913,103円												
期中追加設定元本額	725,266,475円	144,980,164円												
期中一部解約元本額	7,174,181,232円	3,479,382,737円												
期末元本額	17,059,938,178円	11,667,510,530円												
元本の内訳														
GSグローバル・マーケット・ストラテジー （年1回決算型）	7,517,092,844円	5,007,000,322円												
野村ファンドラップ オルタナティブ GS グ ローバル・マーケット・ストラテジー	965,696,203円	790,596,759円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジー （年2回決算型）	7,408,692,883円	5,151,690,029円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジー （野村SMA向け）	747,411,176円	617,467,749円												
GSグローバル・マーケット・ストラテジーF （適格機関投資家専用）	421,045,072円	100,755,671円												
2. 差入委託証拠金代用有価証券（ 1 ）	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として、以下の とおり差入を行なっております。	先物取引に係る差入委託証拠 金代用有価証券として、以下の とおり差入を行なっております。												
	<table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>特殊債券</td> <td>3,408,363,309円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>3,408,363,309円</td> </tr> </tbody> </table>	担保資産	金額	特殊債券	3,408,363,309円	合計	3,408,363,309円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>特殊債券</td> <td>2,943,587,132円</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>2,943,587,132円</td> </tr> </tbody> </table>	担保資産	金額	特殊債券	2,943,587,132円	合計	2,943,587,132円
担保資産	金額													
特殊債券	3,408,363,309円													
合計	3,408,363,309円													
担保資産	金額													
特殊債券	2,943,587,132円													
合計	2,943,587,132円													
3. 計算期間末日における受益権の総数	17,059,938,178口	11,667,510,530口												
4. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は1,489,781,908円でありま す。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は203,669,936円でありま す。												

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超(円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超(円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	株価 指数 先物 取引								
	買建	16,784,182,191	-	18,194,373,549	1,410,191,358	21,572,906,548	-	22,289,441,917	716,535,369
	売建	13,406,423,764	-	14,567,117,105	1,160,693,341	18,059,244,430	-	18,259,325,333	200,080,903
合計		30,190,605,955	-	32,761,490,654	249,498,017	39,632,150,978	-	40,548,767,250	516,454,466

(2) 債券関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12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	23,795,146,973	-	23,859,170,498	64,023,525	37,688,921,865	-	37,629,148,242	59,773,623
	売建	30,727,607,546	-	30,826,121,119	98,513,573	13,981,556,400	-	14,081,716,198	100,159,798
合計		54,522,754,519	-	54,685,291,617	34,490,048	51,670,478,265	-	51,710,864,440	159,933,421

(3) 通貨関連

区分	種類	(2009年9月12日現在)				(2010年9月12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	7,061,137,000	-	6,969,073,000	92,064,000	3,622,175,700	-	3,604,887,000	17,288,700
	カナダドル	8,534,100	-	8,498,000	36,100	305,520,000	-	308,674,000	3,154,000
	ユーロ	2,685,658,000	-	2,669,800,000	15,858,000	1,457,875,000	-	1,451,198,750	6,676,250
	英ポンド	2,932,692,562	-	2,935,047,500	2,354,938	2,791,916,000	-	2,799,140,000	7,224,000
	スウェーデンクローナ	1,676,864,000	-	1,675,520,000	1,344,000	7,105,824,000	-	7,084,000,000	21,824,000
	ノルウェークローネ	2,733,984,000	-	2,703,360,000	30,624,000	297,050,600	-	297,000,000	50,600
	オーストラリアドル	5,887,571,200	-	5,856,092,000	31,479,200	-	-	-	-
	ニュージーランドドル	3,385,463,100	-	3,393,621,000	8,157,900	101,847,000	-	102,850,000	1,003,000
	シンガポールドル	2,343,310,200	-	2,333,727,000	9,583,200	-	-	-	-
	売建								
	米ドル	20,629,348,670	-	19,847,841,200	781,507,470	9,805,363,920	-	9,774,442,000	30,921,920
	カナダドル	2,354,839,600	-	2,345,448,000	9,391,600	838,288,500	-	852,915,000	14,626,500
	ユーロ	5,879,952,000	-	5,856,873,750	23,078,250	2,058,688,000	-	2,023,690,000	34,998,000
	英ポンド	4,699,545,500	-	4,707,511,250	7,965,750	-	-	-	-
	スイスフラン	2,011,133,599	-	2,007,915,000	3,218,599	4,682,086,250	-	4,666,722,500	15,363,750
	スウェーデンクローナ	3,106,704,000	-	3,089,240,000	17,464,000	-	-	-	-
	ノルウェークローネ	-	-	-	-	709,748,000	-	702,000,000	7,748,000
	オーストラリアドル	220,595,200	-	219,212,000	1,383,200	2,428,389,900	-	2,462,391,000	34,001,100
ニュージーランドドル	50,941,600	-	51,128,000	186,400	749,000,000	-	756,250,000	7,250,000	
シンガポールドル	19,364,700	-	19,287,000	77,700	-	-	-	-	

合計	67,687,639,031	-	66,689,194,700	657,493,007	36,953,772,870	-	36,886,160,250	1,304,480
----	----------------	---	----------------	-------------	----------------	---	----------------	-----------

(注) 時価の算定方法

・先物取引

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

・為替予約取引

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - (1) 計算期間末日において予約為替の受渡し日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
 - (2) 計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。

計算期間末日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値により評価しております。

(1口当たり情報)

項目	(2009年9月12日現在)	(2010年9月12日現在)
1口当たり純資産額	0.9127円	0.9825円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

2 ファンドの現況

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

<訂正・更新後>

純資産額計算書

(2010年9月30日現在)

資産総額	5,229,983,328円
負債総額	9,133,985円
純資産総額(-)	5,220,849,343円
発行済口数	5,870,903,023口
1口当たり純資産額(/)	0.8893円

参考情報

<GSグローバル・マーケット・ストラテジー・マザーファンド>

純資産額計算書

(2010年9月30日現在)

資産総額	13,474,360,848円
負債総額	1,421,919,445円
純資産総額(-)	12,052,441,403円
発行済口数	11,328,794,059口
1口当たり純資産額(/)	1.0639円

第5【設定及び解約の実績】

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

<訂正・更新後>

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

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期	自 2004年10月28日 至 2005年3月14日	63,593,458,871 (0)	1,241,446,658 (0)	62,352,012,213 (0)
第2期	自 2005年3月15日 至 2006年3月13日	20,554,063,240 (0)	49,388,519,802 (0)	33,517,555,651 (0)
第3期	自 2006年3月14日 至 2007年3月12日	33,792,499,454 (0)	24,744,263,469 (0)	42,565,791,636 (0)
第4期	自 2007年3月13日 至 2008年3月12日	637,736,307 (0)	25,147,817,263 (0)	18,055,710,680 (0)
第5期	自 2008年3月13日 至 2009年3月12日	15,459,355 (0)	6,794,347,007 (0)	11,276,823,028 (0)
第6期	自 2009年3月13日 至 2010年3月12日	1,155,360 (0)	4,008,063,746 (0)	7,269,914,642 (0)
第7期 (中間期)	自 2010年3月13日 至 2010年9月12日	2,362,821 (0)	1,351,556,490 (0)	5,920,720,973 (0)

（注1）（ ）内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。

（注2）設定口数には当初募集期間中の設定口数を含みます。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

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

<訂正・更新後>

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額：金 4 億9,000万円

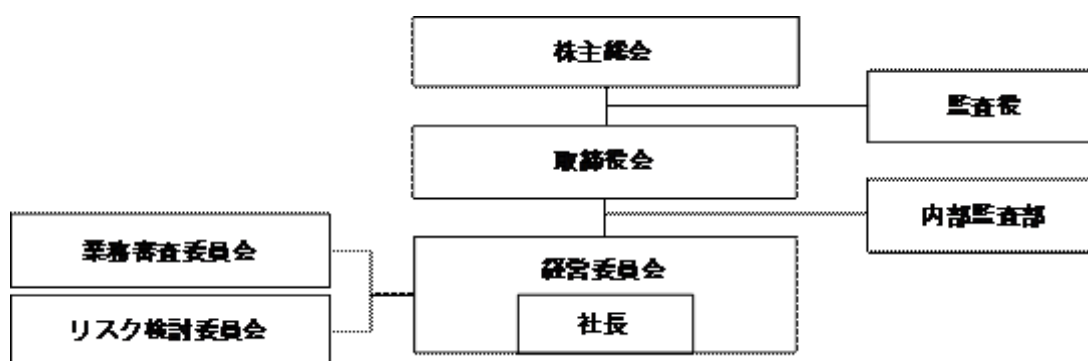
発行する株式の総数：8,000株

発行済株式の総数：6,400株

最近5年間における主な資本の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社等の機構

委託会社の業務運営の組織体系は以下の通りです。



経営の意思決定機関として取締役会をおきます。取締役会は、委託会社の業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務を監督します。代表取締役である社長は、委託会社を代表し、全般の業務執行について指揮統括します。取締役は、委嘱された業務の執行にあたり、また、社長に事故あるときにその職務を代行します。

委託会社の業務執行にかかる重要事項を審議する機関として経営委員会をおきます。経営委員会は、取締役会に直属し、定時取締役会が開催されない期間においては、委託会社の業務執行に関して法令により認められる限度で取締役会が有する一切の権限を保持し、執行します（取締役の専権事項を除きます。）。

委託会社の一切の活動における法令遵守、内部統制、オペレーショナル・リスク、システム・リスク等のリスク、および関連するレピュテーション上の問題を管理監督する機関として業務審査委員会をおきます。業務審査委員会は、経営委員会に直属し、委託会社の経営理念に沿った各種規定および業務手順が整備されていることを確保するため、法律により許可されているすべての権限を行使することができます。

リスク検討委員会は、経営委員会に直属し、適用法令、協会規則、投資信託約款、顧客との運用ガイドラインを遵守するとともに、善良なる管理者としての注意義務および忠実義務の観点から受託者としての責任を遵守するため（議決権行使に関する方針を含みます。）、必要な報告徴収、調査、検討、決定等を行うことができます。

監査役は、委託会社の会計監査および業務監査を行います。業務の執行は、取締役が行います。

投資運用の意思決定機構

委託会社における投資運用の意思決定は運用本部所属の各部において行われます。運用本部は以下のような部によって構成されています。運用本部の各部では株式運用部長、計量運用部長および債券通貨運用部長がその所属員を指揮監督し、部の業務を統括しています。株式運用部は、日本株の運用を、計量運用部は、計量運用によるタイミング戦略、株式国別配分、債券国別配分および通貨配分などの各戦略をはじめとする多資産クラスの運用ならびに計量運用手法による株式の運用を、債券通貨運用部は、債券および通貨の運用をそれぞれ担当します。それぞれの運用部は各資産クラスの運用について独立した責任と権限をもち、投資運用に関する意思決定を行います。また、運用本部には、上記のほかに、戦略株式運用部、運用投資戦略部、マルチプロダクト・ファンド室およびオルタナティブ投資室があります。



投資運用の意思決定には、委託会社が属するゴールドマン・サックスの資産運用グループのリソースが活用されます。委託会社の運用本部はゴールドマン・サックスの資産運用グループのポートフォリオ・マネージメント・チームの構成員として、他の構成員たる様々な地域のポートフォリオ・マネージメント・チームとグローバルな情報交換を行っています。

2 事業の内容及び営業の概況

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

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

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

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2. 監査証明について

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

(1) 貸借対照表

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

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

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

(2) 損益計算書

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

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

第14期
(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

(単位：千円)

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

第15期
(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)

(単位：千円)

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

重要な会計方針

区分	第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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する方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>	<p>その他有価証券 同左</p>
2. 固定資産の減価償却の方法	<p>無形固定資産 定額法により償却しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法により償却しております。</p>	<p>無形固定資産 同左</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支出に備えて、社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。</p> <p>(3) 貸倒引当金 貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(4) 金融商品取引責任準備金 金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>	<p>(1) 役員賞与引当金 同左</p> <p>(2) 役員退職慰労引当金 同左</p> <p>(3) 貸倒引当金 同左</p> <p>(4) 金融商品取引責任準備金 同左</p>

区分	第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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 tock・オプション等に関する会計基 準の適用指針」に準じて、権利付与日 公正価値及び付与された株数に基づき 計算される費用を権利確定計算期間に わたり人件費(営業費用及び一般管理 費)として処理しております。また、ザ ・ゴールドマン・サックス・グループ ・インクおよびゴールドマン・サック ス・ジャパン・ホールディングス有限 会社との契約に基づき当社が負担す る、権利付与日以降の株価の変動によ り発生する損益については営業外損益 として処理しております。</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>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 同左</p> <p>(2) 消費税等の会計処理 同左</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

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

（損益計算書関係）

第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<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> <p>営業収益</p> <p>運用受託報酬 1,147,752千円</p> <p>その他営業収益 1,221,154千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 1,550,484千円</p> <p>株式従業員報酬 10,698千円</p> <p>営業外収益</p> <p>株式従業員報酬 221,263千円</p> <p>営業外費用</p> <p>支払利息 35,664千円</p>	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <p>営業収益</p> <p>運用受託報酬 275,256千円</p> <p>その他営業収益 2,755,632千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 3,125,049千円</p> <p>株式従業員報酬 108,229千円</p> <p>営業外費用</p> <p>株式従業員報酬 175,228千円</p>

（株主資本等変動計算書関係）

第14期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

第15期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

（リース取引関係）

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

（金融商品に関する注記）

第15期
（自 平成21年4月1日
至 平成22年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

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、当社は、効率的なリスク管理が極めて重要であると考えており、職務の分掌と経営陣による監督は、当社リスク管理手続の重要な要素であります。

信用リスク

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

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

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

市場リスク

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

流動性および資金調達リスク

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：千円)

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

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権の償還予定額

(単位：千円)

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

（有価証券関係）

第14期 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）					第15期 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）				
1. その他有価証券で時価のあるもの					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	投資信託受益証券	1,008,026	1,039,779	31,752	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	1,008,026	1,080,100	72,073
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託受益証券	145,079	145,079	-					
合計		1,153,105	1,184,859	31,752					
（注）当事業年度において、投資有価証券について、 189,050千円減損処理を行っております。									
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券					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）		
1,942,487	10,044	416,399			205,415	60,336	-		
3. 時価評価されていない主な有価証券の内容									
		貸借対照表計上額（千円）							
その他有価証券 コマーシャル・ペーパー		5,000,000							
4. その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の今後の償還予定額									
	1年以内 （千円）	1年超5 年以内 （千円）	5年超10 年以内 （千円）	10年超 （千円）					
コマーシャル・ペーパー	5,000,000	-	-	-					

（デリバティブ取引関係）

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

（退職給付関係）

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

（税効果会計関係）

第14期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第15期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<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 240,294千円</p> <p>その他 50,980</p> <p style="text-align: right;">小計 291,274</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p>未収事業税 82,091</p> <p style="text-align: right;">小計 82,091</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 209,183</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 827,893</p> <p>役員退職慰労引当金 315,022</p> <p>投資有価証券評価減 76,931</p> <p>その他 47,648</p> <p style="text-align: right;">小計 1,267,494</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 12,920</p> <p style="text-align: right;">小計 12,920</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 1,254,574</p> <p style="text-align: right;">1,463,757千円</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 542,061千円</p> <p>未払事業税 69,035</p> <p>その他 17,214</p> <p style="text-align: right;">小計 628,311</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 628,311</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,106,725</p> <p>役員退職慰労引当金 356,410</p> <p>その他 24,188</p> <p style="text-align: right;">小計 1,487,324</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 29,326</p> <p style="text-align: right;">小計 29,326</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 1,457,997千円</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 40.69 %</p> <p>（調整）</p> <p>役員賞与等永久に損金に算入されない項目 3.12</p> <p>その他 0.06</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.49 %</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 40.69 %</p> <p>（調整）</p> <p>役員賞与等永久に損金に算入されない項目 49.38</p> <p>その他 1.33</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 88.75 %</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>該当事項はありません。</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>該当事項はありません。</p>
<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合その内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>	<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合その内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>

(関連当事者との取引)

第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)											
親会社及び法人主要株主等											
属性	会社等の 名称	住所	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社	ザ・ゴール ドマン・サ ックス・グ ループ・イ ンク	アメリ カ合衆国 ニュー ヨーク 市	25,762 百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	-	株式従 業員報 酬の配 賦 資金の 援助	営業費用及び 一般管理費 (注1) 株式従業員報 酬(注1) 資金の借入の 償還(注2) 利息の支払 (注2)	10,698 221,263 5,000,000 35,664	未払費 用 長期未 払費用 立替金	217,717 86,468 77,798
親会社	ゴール ドマン・サ ックス・ア セット・マ ネジメン ト・エル・ ビー	アメリ カ合衆国 ニュー ヨーク 市	255 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	-	投資助 言	運用受託報酬 (注3) その他営業収 益(注3) 委託調査費の 支払(注3)	1,147,752 1,221,154 1,550,484	未収収 益	98,024
取引条件及び取引条件の決定方針等											
(注1) 持株会社の株価及び付与された株数に基づき、算出し配賦されております。											
(注2) 親会社からの資金の借入れについては、市場金利を勘案して決定しており、返済条件は期間2年としておりましたが、2009年1月に期限前返済を行いました。 なお担保は差し入れておりませんでした。											
(注3) 運用受託報酬、その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき、決定しております。											
役員及び個人主要株主等											
該当事項はありません。											

第14期
(自平成20年4月1日
至平成21年3月31日)

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社(以下GSJH)または、ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・リミテッド(以下GS2L)より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はGSJH、GS2Lより行われております。

但し、これらの費用はGSJH、GS2Lより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはGSJH、GS2Lに対する債務として処理しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク(ニューヨーク証券取引所に上場)
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)

第15期
(自平成21年4月1日
至平成22年3月31日)

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	ザ・ゴールド マン・サ ックス・ グループ ・インク	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク市	6,965 百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	株式従業 員報酬の 配賦	営業費用及び 一般管理費 (注1)	108,229	未払費用	84,101
							株式従業員報 酬(注1)	175,228	長期未払 費用	241,783
親会社	ゴールドマ ン・サッ クス・ア セット・ マネジ メント・ エル・ ピー	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク市	206 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	運用受託報酬 (注2)	275,256	未収収益	156,637
							その他営業収 益(注2)	2,755,632		
							委託調査費の 支払(注2)	3,125,049		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第15期
(自平成21年4月1日
至平成22年3月31日)

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社 の子会 社	ゴールドマ ン・サック ス証券株式 会社	東京都港 区	83,616 百万円	金融商品取 引業	-	業務委託 役員の兼 任	支払手数料 兼務従業員の 人件費等の支 払(注1) 有価証券の償 還 受取利息	198,634 2,511,001 5,000,000 958	未払手数 料 未払費用 立替金	23,069 362,141 1,398
親会社 の子会 社	ゴールドマ ン・サック ス・ジャパ ン・ホール ディングス 有限会社	東京都港 区	100,000 千円	ゴールドマ ン・サック ス・グルー プ人事・総 務・施設管 理業務受託	-	従業員出 向受入等 役員の兼 任	出向者に関 する人件費等 の負担金 (注2) 営業費用及 び一般管理 費 株式従業員 報酬	6,525,884 361,419	未払費用 立替金 長期未払 費用	1,121,537 30,417 2,899,556
親会社 の子会 社	ゴールドマ ン・サック ス・バンク ・USA	アメリカ 合衆国ユ タ州	2 百万ドル	銀行業	-	現金の預 入	受取利息	958	現金・預 金	876,973
親会社 の子会 社	ゴールドマ ン・サック ス・インベ ストメント ・ストラテ ジー・LL C	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク州	69 百万ドル	投資顧問業	-	投資助言	運用受託報酬 (注3)	2,031,894	未収収益	59,844
親会社 の子会 社	ゴールドマ ン・サック ス・グロー バル・サー ビス・リ ミテッド	ケイマン 諸島	21 百万ドル	ゴールドマ ン・サック ス・グルー プ人事業務 受託	-	従業員出 向受入	出向者に関 する人件費等 の負担金 (注2) 営業費用及 び一般管理 費 株式従業員 報酬	100,709 19,604	未払費用 長期未払 費用	136,305 3,202

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社(以下GSJH)または、ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・リミテッド(以下GS2L)より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はGSJH、GS2Lより行われております。

但し、これらの費用はGSJH、GS2Lより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはGSJH、GS2Lに対する債務として処理しております。

(注3) 運用受託報酬に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)

（1株当たり情報）

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

4 利害関係人との取引制限

委託会社は、金融商品取引法の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5 その他

- (1) 委託会社に関し、定款の変更、営業譲渡および営業譲受、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。
- (2) 本書提出日現在の前1年以内において、訴訟事件その他委託会社等に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実は存在しておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第四部 特別情報 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

(2009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・エル・ピー (G S A Mニューヨーク)	206.4百万米ドル (19,008百万円 1米ドル=92.10円)	G S A M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。

(2) 受託銀行

(2010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

(2010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ニューヨークは本ファンドの投資顧問会社であり、本ファンドに関し、委託会社より信託財産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っています。

3 資本関係

(1) 投資顧問会社

G S A Mニューヨーク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。G S A Mニューヨークは、委託会社の発行済株式総数の99%を所有する親会社です。

(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21年10月21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 大畑 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているGS グローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）の平成21年3月13日から平成21年9月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、GS グローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）の平成21年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成21年3月13日から平成21年9月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注1）上記は、当社が、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XBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年5月27日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
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20年4月1日から平成21年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成22年10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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているGS グローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）の平成22年3月13日から平成22年9月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、GS グローバル・マーケット・ストラテジー（年1回決算型）の平成22年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成22年3月13日から平成22年9月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注1）上記は、当社が、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XBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年 5月26日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
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21年4月1日から平成22年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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