

【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25年 6月20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】	G S日本株式インデックス・プラス
【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24年12月20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、有価証券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】

< 訂正前 >

（前略）

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

本ファンドは、投資信託委託会社であるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社（以下「委託会社」または「当社」といいます。）を委託者とする投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、その後の改正を含みます。以下「投資信託法」といいます。）に基づく追加型証券投資信託です。

（中略）

(4) 発行（売出）価格

（中略）

* 本ファンドの「基準価額」とは、信託財産の純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）をその時の受益権総口数で除した1万口当たりの金額をいいます。基準価額は、組入有価証券等の値動きにより日々変動します。

（後略）

< 訂正後 >

（前略）

(2) 内国投資信託受益証券の形態等

本ファンドは、投資信託委託会社であるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社（以下「委託会社」または「当社」といいます。）を委託者とする投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号、その後の改正を含みます。以下「投資信託法」といいます。）に基づく追加型証券投資信託です。

（中略）

(4) 発行（売出）価格

（中略）

* 本ファンドの「基準価額」とは、信託財産の純資産総額（信託財産に属する資産（受入担保代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）をその時の受益権総口数で除した1万口当たりの金額をいいます。基準価額は、組入有価証券等の値動きにより日々変動します。

（後略）

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)

上記は、社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。商品分類および属性区分の内容につきましては、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

(中略)

<ファンドのポイント>

(中略)

本ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。委託会社は、本ファンドおよびマザーファンドの運用を、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（投資顧問会社、以下「GSAMニューヨーク」といいます。）に委託します。GSAMニューヨークは運用の権限の委託を受けて、日本株式の運用を行います。

<ファンドの特徴>

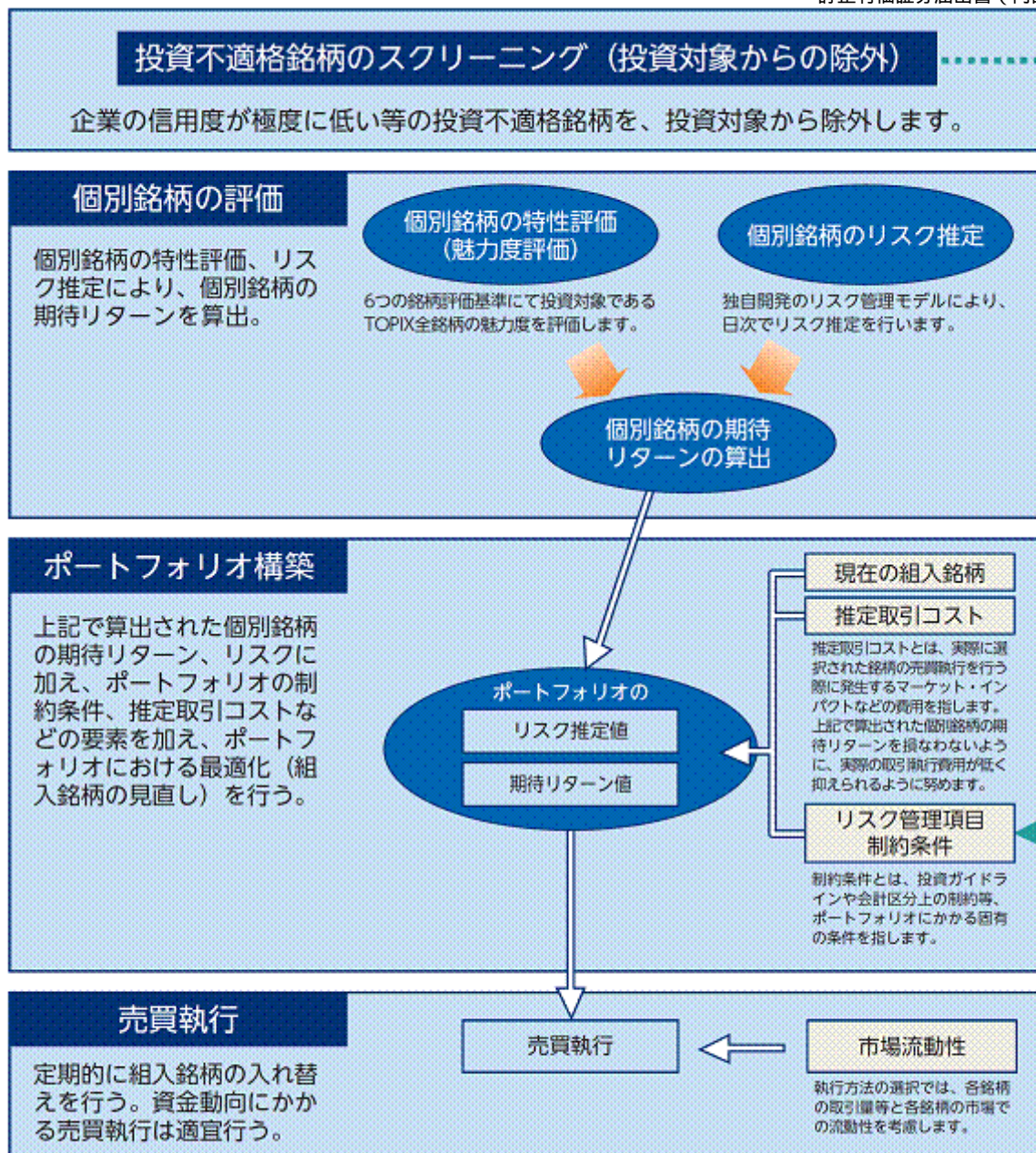
(中略)

<ファンドの運用プロセス>

経済理論や金融理論を背景とした経済合理性を追求した計量モデルを採用しています。

計量モデルを用いることで、約1,700銘柄に及ぶ多数の銘柄を、複数の銘柄評価基準を用いて分析し、これらを基に最も魅力的と思われるポートフォリオを構築します。

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当なし）を上回る収益を追求します。



上記は現行モデルに基づくものであり、計量モデルの改良・更新は継続的、恒常的に行われています。上記がその目的を達成できる保証はありません。

（中略）

(3) 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、2012年6月末現在、グループ全体で7,161億米ドル（約56.8兆円^{*}）の資産を運用しています。

^{*}米ドルの円貨換算は便宜上、2012年6月29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=79.31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)

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。商品分類および属性区分の内容につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご参照ください。

(中略)

<ファンドのポイント>

(中略)

本ファンドはファミリーファンド方式で運用を行います。委託会社は、本ファンドおよびマザーファンドの運用を、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（投資顧問会社、以下「GSAMニューヨーク」といいます。）に委託します。GSAMニューヨークは運用の権限の委託を受けて、日本株式の運用を行います。

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全体を「ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント」といいます。

<ファンドの特徴>

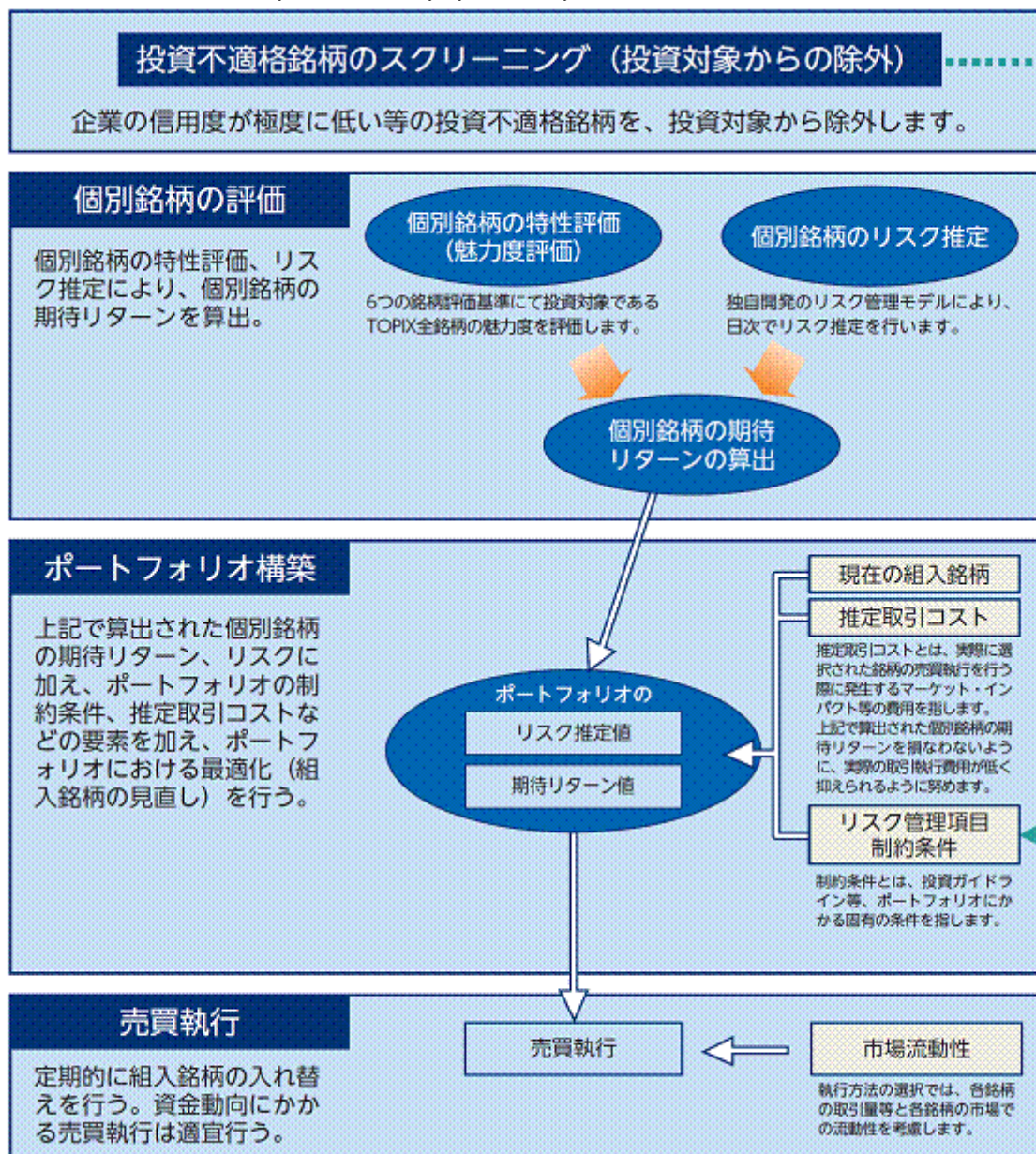
(中略)

<ファンドの運用プロセス>

経済理論や金融理論を背景とした経済合理性を追求した計量モデルを採用しています。

計量モデルを用いることで、約1,700銘柄に及び多数の銘柄を、複数の銘柄評価基準を用いて分析し、これらを基に最も魅力的と思われるポートフォリオを構築します。

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当なし）を上回る収益を追求します。



上記は現行モデルに基づくものであり、計量モデルの改良・更新は継続的、恒常的に行われています。上記がその目的を達成でき

る保証はありません。

（中略）

(3) 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、2012年12月末現在、グループ全体で7,424億米ドル（約64.3兆円^{*}）の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2012年12月28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＝86.58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 >

(前略)

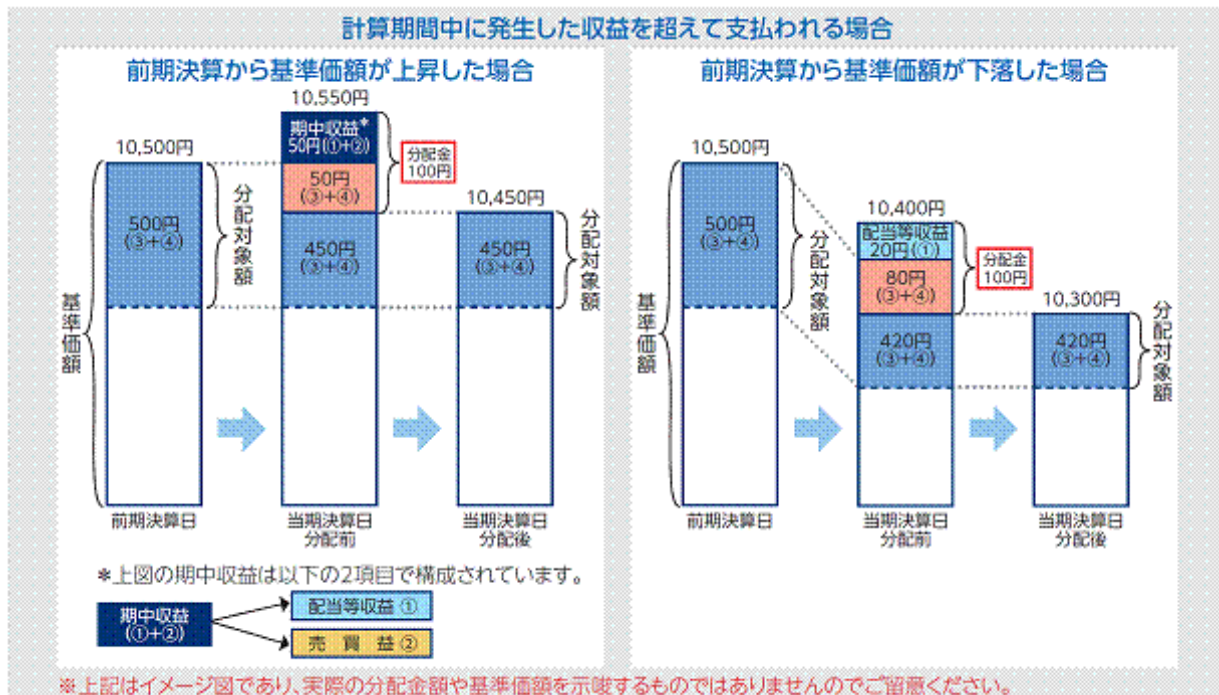
(4) 配分方針

(中略)

< 収益分配金に関わる留意点 >

(中略)

分配金は、配分方針に基づき、分配対象額から支払われます。分配対象額とは、経費控除後の配当等収益、経費控除後の評価益を含む売買益、分配準備積立金（当該計算期間よりも前に累積した配当等収益および売買益）、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）です。



上記のとおり、分配金は計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合がありますので、元本の保全性を追求される投資家の場合には、市場の変動等に伴う組み入れ資産の価値の減少だけでなく、収益分配金の支払いによる元本の払戻しにより、本ファンドの基準価額が減価することに十分ご注意ください。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

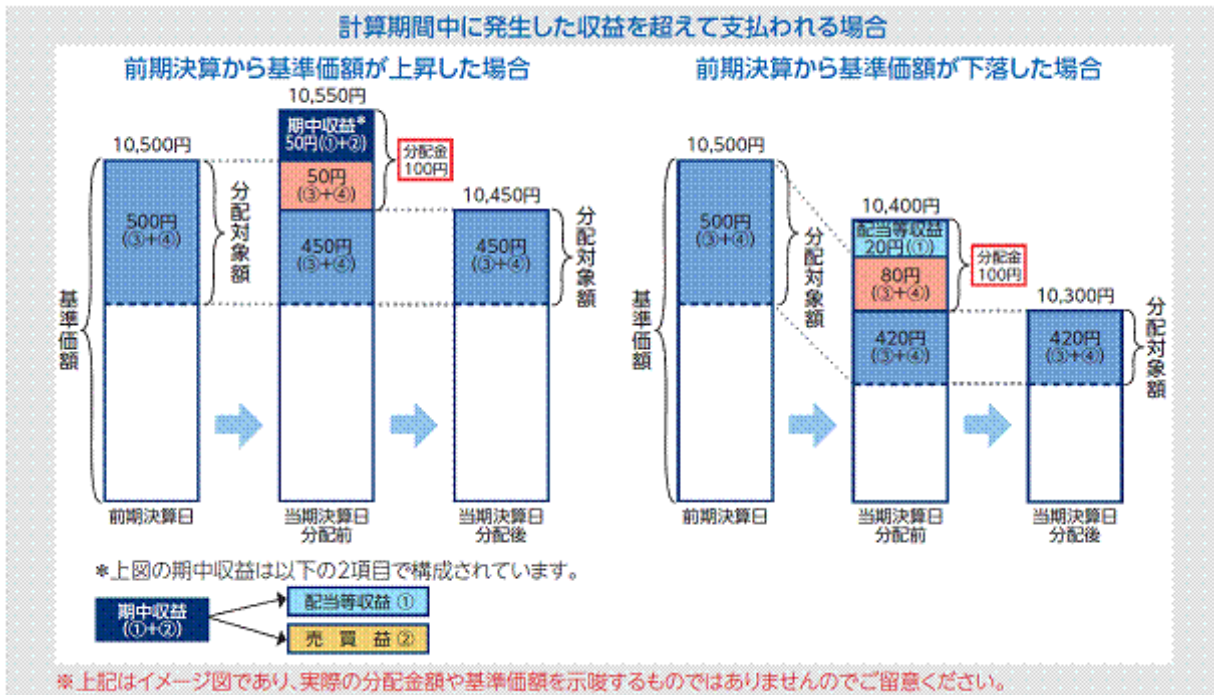
(4) 配分方針

(中略)

< 収益分配金に関わる留意点 >

(中略)

分配金は、配分方針に基づき、分配対象額から支払われます。分配対象額とは、経費控除後の配当等収益、経費控除後の評価益を含む売買益、分配準備積立金（当該計算期間よりも前に累積した配当等収益および売買益）、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）です。



上記のとおり、分配金は計算期間中に発生した収益を超過して支払われる場合がありますので、元本の安全性を追求される投資家の場合には、市場の変動等に伴う組み入れ資産の価値の減少だけでなく、収益分配金の支払いによる元本の払戻しにより、本ファンドの基準価額が減価することに十分ご注意ください。

(後略)

[次へ](#)

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 投資リスク

(中略)

(g) 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30億口を下回る事となった場合等には、受託銀行と協議のうえ、必要な手続きを経て、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、必要な手続きを経て、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。繰上償還された場合には、申込手数料は返還されません。

(後略)

<訂正後>

(1) 投資リスク

(中略)

(g) 繰上償還に関わる留意点

委託会社は、受益権の総口数が30億口を下回る事となった場合等には、受託銀行と協議のうえ、必要な手続きを経て、この信託を終了させることができます。また、信託契約を解約することが受益者のため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、必要な手続きを経て、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。繰上償還された場合には、申込手数料は返還されません。

(後略)

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

< 訂正前 >

(前略)

(5) 課税上の取扱い

(中略)

個人の受益者の場合^{*1}

時期	項目	税金
収益分配時	所得税および地方税	普通分配金 × 10% ^{*2}
換金時 (解約請求による場合)	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*2}
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*2}

*1 法人の受益者の場合については、後記「収益分配金の課税について」「換金時および償還時の課税について」をご覧ください。

*2 2013年1月1日以降は、10.147%（所得税7.147%、地方税3%）となる予定です。詳しくは、後記「収益分配金の課税について」「換金時および償還時の課税について」をご覧ください。

(中略)

< 収益分配金の課税について >

(中略)

個人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・2012年12月31日まで：10%（所得税7%、地方税3%）
- ・2013年1月1日以後：10.147%（所得税7.147%、地方税3%）
- ・2014年1月1日以後2037年12月31日まで：20.315%（所得税15.315%、地方税5%）

(中略)

法人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・2012年12月31日まで：7%（所得税7%）
- ・2013年1月1日以後：7.147%（所得税7.147%）
- ・2014年1月1日以後2037年12月31日まで：15.315%（所得税15.315%）

(中略)

< 換金時および償還時の課税について >

個人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・2012年12月31日まで：10%（所得税7%、地方税3%）
- ・2013年1月1日以後：10.147%（所得税7.147%、地方税3%）
- ・2014年1月1日以後2037年12月31日まで：20.315%（所得税15.315%、地方税5%）

(中略)

法人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・2012年12月31日まで：7%（所得税7%）
- ・2013年1月1日以後：7.147%（所得税7.147%）
- ・2014年1月1日以後2037年12月31日まで：15.315%（所得税15.315%）

< 訂正後 >

(前略)

(5) 課税上の取扱い

(中略)

個人の受益者の場合^{*1}

時期	項目	税金
収益分配時	所得税および地方税	普通分配金 × 10.147% ^{*2}
換金時 (解約請求による場合)	所得税および地方税	譲渡益 × 10.147% ^{*2}
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 10.147% ^{*2}

*1 法人の受益者の場合については、後記「収益分配金の課税について」、「換金時および償還時の課税について」をご覧ください。

*2 2014年1月1日以降は、20.315% (所得税15.315%、地方税5%) となる予定です。詳しくは、後記「収益分配金の課税について」、「換金時および償還時の課税について」をご覧ください。

(中略)

< 収益分配金の課税について >

(中略)

個人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・ 2013年1月1日以後：10.147% (所得税7.147%、地方税3%)
- ・ 2014年1月1日以後2037年12月31日まで：20.315% (所得税15.315%、地方税5%)

(中略)

法人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・ 2013年1月1日以後：7.147% (所得税7.147%)
- ・ 2014年1月1日以後2037年12月31日まで：15.315% (所得税15.315%)

(中略)

< 換金時および償還時の課税について >

個人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・ 2013年1月1日以後：10.147% (所得税7.147%、地方税3%)
- ・ 2014年1月1日以後2037年12月31日まで：20.315% (所得税15.315%、地方税5%)

(中略)

法人の受益者に対する課税

(中略)

なお、以下の期間においては適用される税率が異なります。

- ・ 2013年1月1日以後：7.147% (所得税7.147%)
- ・ 2014年1月1日以後2037年12月31日まで：15.315% (所得税15.315%)

[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

(2013年3月29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		12,477,413,484	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,013,680	0.02
合計(純資産総額)		12,474,399,804	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日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

(2013年3月29日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	63,157,798,450	96.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,398,324,396	3.66
合計(純資産総額)		65,556,122,846	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

(2013年3月29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日本株計量運用ポート フォリオ マザーファンド	11,279,527,648	1.1200	12,634,137,726	1.1062	12,477,413,484	100.02

種類別及び業種別投資比率

(2013年3月29日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

(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

(2013年3月29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

(2013年3月29日現在)

該当事項はありません。

参考情報

<GS日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

投資有価証券の主要銘柄

(2013年3月29日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量 (株式数)	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	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,471,900	577.00	3,157,286,300	558.00	3,053,320,200	4.66
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	641,200	4,000.00	2,564,800,000	3,775.00	2,420,530,000	3.69
3	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	383,200	4,990.00	1,912,168,000	4,860.00	1,862,352,000	2.84
4	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	578,600	3,075.00	1,779,195,000	3,115.00	1,802,339,000	2.75
5	日本	株式	三井物産	卸売業	1,242,000	1,393.00	1,730,106,000	1,313.00	1,630,746,000	2.49
6	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	157,400	10,140.00	1,596,036,000	9,920.00	1,561,408,000	2.38
7	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,774,400	212.00	1,648,172,800	199.00	1,547,105,600	2.36
8	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	440,200	3,200.00	1,408,640,000	3,300.00	1,452,660,000	2.22
9	日本	株式	オリックス	その他金融業	1,131,200	1,196.00	1,352,915,200	1,191.00	1,347,259,200	2.06
10	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	908,000	1,501.00	1,362,908,000	1,461.00	1,326,588,000	2.02
11	日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	2,554	515,000.00	1,315,310,000	500,000.00	1,277,000,000	1.95
12	日本	株式	丸紅	卸売業	1,498,000	751.00	1,124,998,000	703.00	1,053,094,000	1.61
13	日本	株式	東京建物	不動産業	1,568,000	625.00	980,000,000	659.00	1,033,312,000	1.58
14	日本	株式	アイシン精機	輸送用機器	295,400	3,540.00	1,045,716,000	3,450.00	1,019,130,000	1.55
15	日本	株式	第一三共	医薬品	560,200	1,890.00	1,058,778,000	1,815.00	1,016,763,000	1.55
16	日本	株式	住友商事	卸売業	830,600	1,252.00	1,039,911,200	1,178.00	978,446,800	1.49
17	日本	株式	いすゞ自動車	輸送用機器	1,710,000	596.00	1,019,160,000	555.00	949,050,000	1.45
18	日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	208,700	4,530.00	945,411,000	4,515.00	942,280,500	1.44
19	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	228,200	4,250.00	969,850,000	4,105.00	936,761,000	1.43
20	日本	株式	東急不動産	不動産業	1,060,000	877.00	929,620,000	877.00	929,620,000	1.42
21	日本	株式	三菱ケミカルホールディングス	化学	2,058,000	479.00	985,782,000	435.00	895,230,000	1.37
22	日本	株式	ダイハツ工業	輸送用機器	427,000	1,933.00	825,391,000	1,952.00	833,504,000	1.27
23	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,377,800	591.00	814,279,800	577.00	794,990,600	1.21
24	日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	1,746,000	449.00	783,954,000	443.00	773,478,000	1.18
25	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	172,300	3,850.00	663,355,000	4,340.00	747,782,000	1.14
26	日本	株式	川崎汽船	海運業	3,725,000	223.00	830,675,000	199.00	741,275,000	1.13
27	日本	株式	コニカミノルタホールディングス	電気機器	1,065,500	782.00	833,221,000	688.00	733,064,000	1.12
28	日本	株式	日野自動車	輸送用機器	677,000	1,092.00	739,284,000	1,010.00	683,770,000	1.04
29	日本	株式	ファミリーマート	小売業	154,300	4,280.00	660,404,000	4,350.00	671,205,000	1.02
30	日本	株式	住友重機械工業	機械	1,739,000	395.00	686,905,000	381.00	662,559,000	1.01

種類別及び業種別投資比率

国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
国内	鉱業	1.98
	建設業	1.12
	食料品	0.77
	繊維製品	0.86
	パルプ・紙	0.10
	化学	5.27
	医薬品	7.35
	石油・石炭製品	0.42
	ゴム製品	1.19
	ガラス・土石製品	1.64
	鉄鋼	0.30
	非鉄金属	0.63
	金属製品	0.30
	機械	3.48
	電気機器	5.12
	輸送用機器	12.39
	精密機器	0.04
	その他製品	1.28
	電気・ガス業	1.44
	陸運業	5.72
	海運業	1.13
	空運業	1.00
	倉庫・運輸関連業	0.16
	情報・通信業	7.96
	卸売業	6.92
	小売業	5.98
	銀行業	11.89
	証券、商品先物取引業	1.40
	保険業	0.50
	その他金融業	3.21
不動産業	3.62	
サービス業	1.14	
合計		96.34

(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

(2013年3月29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

(2013年3月29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	日本	東京証券取引所	東証株価指数先物	買建	199	日本円	2,066,142,506	2,066,615,000	2,066,615,000	3.15

(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

2013年3月29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	(2006年3月20日)	8,210	8,809	1.0964	1.1764
第2期	(2006年9月20日)	22,535	22,667	1.0226	1.0286
第3期	(2007年3月20日)	23,466	24,771	1.0789	1.1389
第4期	(2007年9月20日)	22,366	22,412	0.9715	0.9735
第5期	(2008年3月21日)	17,867	17,878	0.7530	0.7535
第6期	(2008年9月22日)	17,040	17,052	0.7187	0.7192
第7期	(2009年3月23日)	11,650	11,662	0.4802	0.4807
第8期	(2009年9月24日)	14,077	14,089	0.5721	0.5726
第9期	(2010年3月23日)	14,118	14,130	0.5760	0.5765
第10期	(2010年9月21日)	12,537	12,549	0.5199	0.5204
第11期	(2011年3月22日)	12,338	12,350	0.5298	0.5303
第12期	(2011年9月20日)	10,459	10,470	0.4653	0.4658
第13期	(2012年3月21日)	11,432	11,443	0.5353	0.5358
第14期	(2012年9月20日)	9,714	9,724	0.4759	0.4764
第15期	(2013年3月21日)	12,611	12,620	0.6702	0.6707
	2012年3月末日	11,516	-	0.5413	-
	2012年4月末日	10,797	-	0.5106	-
	2012年5月末日	9,665	-	0.4585	-
	2012年6月末日	10,258	-	0.4889	-
	2012年7月末日	9,799	-	0.4707	-
	2012年8月末日	9,546	-	0.4633	-
	2012年9月末日	9,601	-	0.4717	-
	2012年10月末日	9,522	-	0.4748	-
	2012年11月末日	9,816	-	0.4970	-
	2012年12月末日	10,625	-	0.5442	-
	2013年1月末日	11,435	-	0.5951	-
	2013年2月末日	11,843	-	0.6179	-
	2013年3月末日	12,474	-	0.6614	-

(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 2005年10月3日 至 2006年3月20日	0.0800
第2期	自 2006年3月21日 至 2006年9月20日	0.0060
第3期	自 2006年9月21日 至 2007年3月20日	0.0600
第4期	自 2007年3月21日 至 2007年9月20日	0.0020
第5期	自 2007年9月21日 至 2008年3月21日	0.0005
第6期	自 2008年3月22日 至 2008年9月22日	0.0005
第7期	自 2008年9月23日 至 2009年3月23日	0.0005
第8期	自 2009年3月24日 至 2009年9月24日	0.0005
第9期	自 2009年9月25日 至 2010年3月23日	0.0005
第10期	自 2010年3月24日 至 2010年9月21日	0.0005
第11期	自 2010年9月22日 至 2011年3月22日	0.0005
第12期	自 2011年3月23日 至 2011年9月20日	0.0005
第13期	自 2011年9月21日 至 2012年3月21日	0.0005
第14期	自 2012年3月22日 至 2012年9月20日	0.0005
第15期	自 2012年9月21日 至 2013年3月21日	0.0005

収益率の推移

期	計算期間	収益率(%)
第1期	自 2005年10月3日 至 2006年3月20日	17.6
第2期	自 2006年3月21日 至 2006年9月20日	6.2
第3期	自 2006年9月21日 至 2007年3月20日	11.4
第4期	自 2007年3月21日 至 2007年9月20日	9.8
第5期	自 2007年9月21日 至 2008年3月21日	22.4
第6期	自 2008年3月22日 至 2008年9月22日	4.5
第7期	自 2008年9月23日 至 2009年3月23日	33.1
第8期	自 2009年3月24日 至 2009年9月24日	19.2
第9期	自 2009年9月25日 至 2010年3月23日	0.8
第10期	自 2010年3月24日 至 2010年9月21日	9.7
第11期	自 2010年9月22日 至 2011年3月22日	2.0
第12期	自 2011年3月23日 至 2011年9月20日	12.1
第13期	自 2011年9月21日 至 2012年3月21日	15.2
第14期	自 2012年3月22日 至 2012年9月20日	11.0
第15期	自 2012年9月21日 至 2013年3月21日	40.9

(4) 設定及び解約の実績

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 2005年10月3日 至 2006年3月20日	7,646,888,852 (0)	158,656,531 (0)	7,488,232,321 (0)
第2期	自 2006年3月21日 至 2006年9月20日	15,044,119,859 (0)	495,204,431 (0)	22,037,147,749 (0)
第3期	自 2006年9月21日 至 2007年3月20日	3,361,059,645 (0)	3,647,886,508 (0)	21,750,320,886 (0)
第4期	自 2007年3月21日 至 2007年9月20日	3,531,266,852 (0)	2,259,605,622 (0)	23,021,982,116 (0)
第5期	自 2007年9月21日 至 2008年3月21日	1,588,391,874 (0)	882,703,830 (0)	23,727,670,160 (0)
第6期	自 2008年3月22日 至 2008年9月22日	820,237,718 (0)	837,745,568 (0)	23,710,162,310 (0)
第7期	自 2008年9月23日 至 2009年3月23日	6,466,556,491 (0)	5,914,360,955 (0)	24,262,357,846 (0)
第8期	自 2009年3月24日 至 2009年9月24日	4,595,853,532 (0)	4,250,502,181 (0)	24,607,709,197 (0)
第9期	自 2009年9月25日 至 2010年3月23日	2,608,652,487 (0)	2,705,357,039 (0)	24,511,004,645 (0)
第10期	自 2010年3月24日 至 2010年9月21日	576,179,662 (0)	972,072,259 (0)	24,115,112,048 (0)
第11期	自 2010年9月22日 至 2011年3月22日	592,169,053 (0)	1,420,104,780 (0)	23,287,176,321 (0)
第12期	自 2011年3月23日 至 2011年9月20日	552,002,985 (0)	1,361,764,931 (0)	22,477,414,375 (0)
第13期	自 2011年9月21日 至 2012年3月21日	479,114,420 (0)	1,597,801,075 (0)	21,358,727,720 (0)
第14期	自 2012年3月22日 至 2012年9月20日	454,069,436 (0)	1,402,025,367 (0)	20,410,771,789 (0)
第15期	自 2012年9月21日 至 2013年3月21日	869,771,200 (0)	2,462,107,087 (0)	18,818,435,902 (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。

[次へ](#)

(参考)運用実績

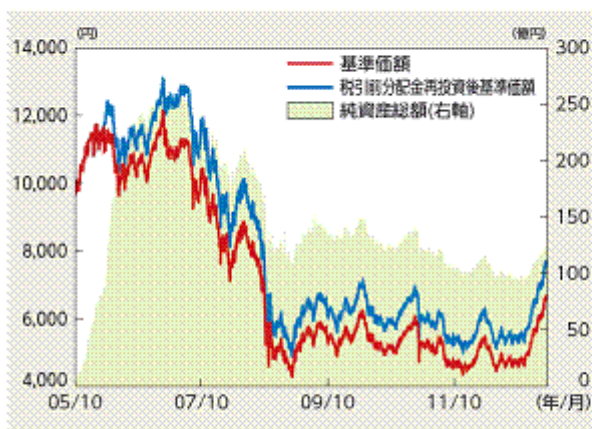
最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

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。

2013年3月29日現在

基準価額・純資産の推移

2005年10月3日(設定日)～2013年3月29日



基準価額・純資産総額

基準価額	6,614円
純資産総額	124.7億円

期間別騰落率(%) (税引前分配金再投資)

期間	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	7.12	21.63	40.32	22.41	11.05	-11.08	-23.75

分配の推移(円)(1万口当たり、税引前)

決算日	11/3/22	11/9/20	12/3/21	12/9/20	13/3/21	設定来累計
分配金	5	5	5	5	5	1,535

●税引前分配金再投資後基準価額および期間別騰落率(税引前分配金再投資)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。

●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

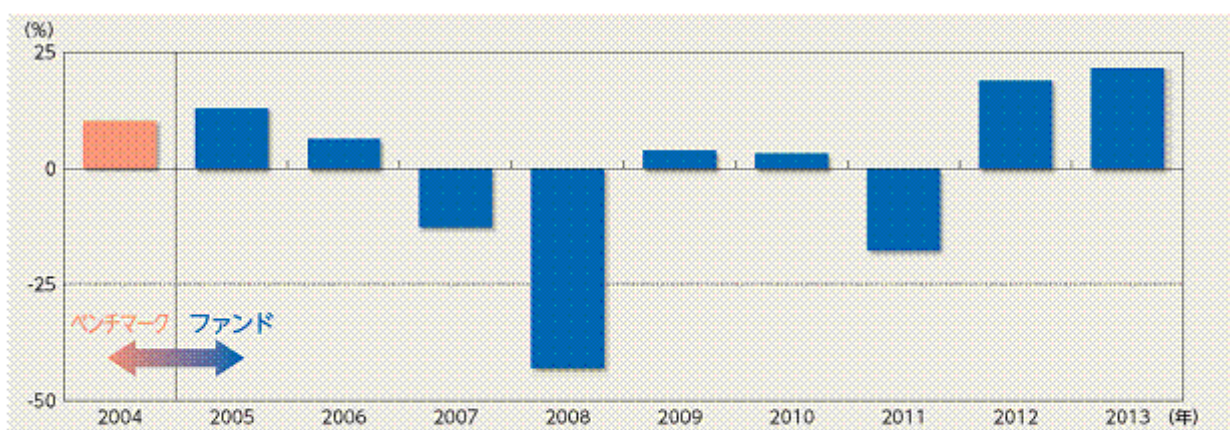
組入上位銘柄

	銘柄	市場	業種	比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	東証1部	銀行業	4.7%
2	三井住友フィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	3.7%
3	トヨタ自動車	東証1部	輸送用機器	2.8%
4	セブン&アイ・ホールディングス	東証1部	小売業	2.7%
5	三井物産	東証1部	卸売業	2.5%
6	東海旅客鉄道	東証1部	陸運業	2.4%
7	みずほフィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.4%
8	大塚ホールディングス	東証1部	医薬品	2.2%
9	オリックス	東証1部	その他金融業	2.1%
10	富士重工業	東証1部	輸送用機器	2.0%

上位10業種

	業種	比率
1	輸送用機器	12.4%
2	銀行業	11.9%
3	情報・通信業	8.0%
4	医薬品	7.4%
5	卸売業	6.9%
6	小売業	6.0%
7	陸運業	5.7%
8	化学	5.3%
9	電気機器	5.1%
10	不動産業	3.6%

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。

●2004年はベンチマークの収益率を表示しています。

●2005年は設定日(10月3日)から年末までの騰落率、2013年は1月から3月末までの騰落率を表示しています。

●ベンチマークはあくまで参考情報であり、本ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

3 資産管理等の概要

<訂正前>

(1) 資産の評価

本ファンド1万口当たりの純資産総額（以下「基準価額」といいます。）は、本ファンドの信託財産の純資産総額をその時の受益権総口数で除して得た額の1万口当たりの額です。「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（後略）

<訂正後>

(1) 資産の評価

本ファンド1万口当たりの純資産総額（以下「基準価額」といいます。）は、本ファンドの信託財産の純資産総額をその時の受益権総口数で除して得た額の1万口当たりの額です。「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

（後略）

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」については、以下の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

- (1) 本ファンドの財務諸表は、「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）並びに同規則第2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、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) 本ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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15期計算期間（2012年9月21日から2013年3月21日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【GS日本株式インデックス・プラス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第14期 (2012年9月20日現在)	第15期 (2013年3月21日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	9,780,308,849	12,678,201,014
未収入金	34,340,099	27,989,634
流動資産合計	9,814,648,948	12,706,190,648
資産合計	9,814,648,948	12,706,190,648
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	10,205,385	9,409,217
未払解約金	34,340,099	27,989,634
未払受託者報酬	2,671,313	2,750,154
未払委託者報酬	50,754,881	52,252,839
その他未払費用	2,390,035	2,612,050
流動負債合計	100,361,713	95,013,894
負債合計	100,361,713	95,013,894
純資産の部		
元本等		
元本	20,410,771,789	18,818,435,902
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,696,484,554	6,207,259,148
（分配準備積立金）	675,684,929	715,684,612
元本等合計	9,714,287,235	12,611,176,754
純資産合計	9,714,287,235	12,611,176,754
負債純資産合計	9,814,648,948	12,706,190,648

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期 自 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	第15期 自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,191,062,757	3,819,708,785
営業収益合計	1,191,062,757	3,819,708,785
営業費用		
受託者報酬	2,671,313	2,750,154
委託者報酬	50,754,881	52,252,839
その他費用	2,390,035	2,612,050
営業費用合計	55,816,229	57,615,043
営業利益又は営業損失()	1,246,878,986	3,762,093,742
経常利益又は経常損失()	1,246,878,986	3,762,093,742
当期純利益又は当期純損失()	1,246,878,986	3,762,093,742
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	68,208,070	169,671,124
期首剰余金又は期首欠損金()	9,926,379,262	10,696,484,554
剰余金増加額又は欠損金減少額	652,308,907	1,287,824,960
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	652,308,907	1,287,824,960
剰余金減少額又は欠損金増加額	233,537,898	381,612,955
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	233,537,898	381,612,955
分配金	10,205,385	9,409,217
期末剰余金又は期末欠損金()	10,696,484,554	6,207,259,148

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	第14期 自 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	第15期 自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21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 2012年 3月20日が休業日のため、当計算期間期首は2012年 3月22日としております。	計算期間の取扱い 2013年 3月20日が休業日のため、当計算期間末日は2013年 3月21日としております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第14期 (2012年 9月20日現在)	第15期 (2013年 3月21日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	21,358,727,720円	20,410,771,789円
期中追加設定元本額	454,069,436円	869,771,200円
期中一部解約元本額	1,402,025,367円	2,462,107,087円
2. 受益権の総数	20,410,771,789口	18,818,435,902口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は10,696,484,554円です。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,207,259,148円です。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第14期 自 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	第15期 自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21日
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	94,635,086円	129,405,730円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	129,323,952円	147,074,177円
分配準備積立金額	591,255,228円	595,688,099円
本ファンドの分配対象収益額	815,214,266円	872,168,006円
本ファンドの期末残存口数	20,410,771,789口	18,818,435,902口
1口当たり収益分配対象額	0.039940円	0.046346円
1口当たり分配金額	0.0005円	0.0005円
収益分配金金額	10,205,385円	9,409,217円

(注) 上記の費用控除後の配当等収益額は本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含んでおります。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	第14期 自 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	第15期 自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	本ファンドは証券投資信託として、有価証券等への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	本ファンドが保有する主な金融資産は親投資信託受益証券であり、売買目的で保有しております。 投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	コンプライアンス部門ならびにオペレーション部門では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則っているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。 マーケット・リスク管理専任部門では、運用チームとは独立した立場で、運用チームにより構築されたポジションのリスク水準をモニタリングし、各運用チーム、リスク検討委員会に報告します。 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。	同左

金融商品の時価等に関する事項

区分	第14期 自 2012年3月22日 至 2012年9月20日	第15期 自 2012年9月21日 至 2013年3月21日
1. 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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第14期 (2012年9月20日現在)	第15期 (2013年3月21日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	999,108,276	3,701,247,508
合計	999,108,276	3,701,247,508

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	第14期 (2012年9月20日現在)	第15期 (2013年3月21日現在)
1口当たり純資産額	0.4759円	0.6702円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

該当事項はありません。

(イ) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
日本円	親投資信託 受益証券	G S 日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド	11,313,761,391	12,678,201,014	
合計			11,313,761,391	12,678,201,014	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GS日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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	(2012年9月20日現在)	(2013年3月21日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,463,439,271	1,968,626,696
株式		56,498,543,495	74,109,676,900
派生商品評価勘定		28,470,000	43,531,000
未収入金		1,151,873,447	2,721,278,207
未収配当金		19,360,400	97,071,800
未収利息		3,173	4,310
差入委託証拠金		7,485,809	43,719,687
流動資産合計		59,169,175,595	78,983,908,600
資産合計		59,169,175,595	78,983,908,600
負債の部			
流動負債			
未払金		1,001,269,693	1,548,210,717
未払解約金		37,350,099	964,461,360
流動負債合計		1,038,619,792	2,512,672,077
負債合計		1,038,619,792	2,512,672,077
純資産の部			
元本等			
元本		73,419,799,685	68,238,885,183
剰余金			
剰余金又は欠損金()		15,289,243,882	8,232,351,340
元本等合計		58,130,555,803	76,471,236,523
純資産合計		58,130,555,803	76,471,236,523
負債純資産合計		59,169,175,595	78,983,908,600

(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 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、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。	株式 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、法令及び一般社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	先物取引 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2012年 9月20日現在)	(2013年 3月21日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	76,136,638,852円	73,419,799,685円
期中追加設定元本額	893,239,834円	3,776,322,761円
期中一部解約元本額	3,610,079,001円	8,957,237,263円
期末元本額	73,419,799,685円	68,238,885,183円
元本の内訳		
G S 日本株式インデックス・プラス	12,351,994,001円	11,313,761,391円
G S 日本株計量運用ポートフォリオ2(適格機関投資家専用)	7,758,297,872円	3,903,794,452円
G S グローバル・バランス・ファンド2 (適格機関投資家専用)	8,918,254,125円	7,617,436,417円
G S グローバル・ダイバーシファイド V A (適格機関投資家専用)	606,973,702円	552,860,564円
V A インデックス・プラス G S 日本株計量運用ポートフォリオ	42,277,675,949円	44,219,135,478円
G S 日本株計量運用ポートフォリオ3	1,506,604,036円	631,896,881円
2. 受益権の総数	73,419,799,685口	68,238,885,183口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は15,289,243,882円であります。	

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2012年 3月22日 至 2012年 9月20日	自 2012年 9月21日 至 2013年 3月21日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>本ファンドは証券投資信託として、有価証券等への投資ならびにデリバティブ取引を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	<p>本ファンドが保有する主な金融資産は株式であり、売買目的で保有しております。</p> <p>デリバティブ取引には、株式関連では先物取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。</p> <p>投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。</p>	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>コンプライアンス部門ならびにオペレーション部門では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則っているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。</p> <p>マーケット・リスク管理専任部門では、運用チームとは独立した立場で、運用チームにより構築されたポジションのリスク水準をモニタリングし、各運用チーム、リスク検討委員会に報告します。</p> <p>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。</p>	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(2012年9月20日現在)	(2013年3月21日現在)
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	5,212,358,873	14,942,278,415
合計	5,212,358,873	14,942,278,415

(注) 当親投資信託の計算期間は、原則として、3月21日から翌年3月20日までとなっており、計算期末が休日の場合はその翌営業日となります。上記の当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の期首日から開示対象ファンドの期末日までの期間に対応するものとなっております。

(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

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種類	(2012年9月20日現在)				(2013年3月21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	1,057,770,000	-	1,086,240,000	28,470,000	1,821,164,000	-	1,864,695,000	43,531,000
	合計	1,057,770,000	-	1,086,240,000	28,470,000	1,821,164,000	-	1,864,695,000	43,531,000

(注) 時価の算定方法

・先物取引

1. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
2. 先物取引の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段又は証拠金算定基準値段を用いております。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

区分	(2012年9月20日現在)	(2013年3月21日現在)
1口当たり純資産額	0.7918円	1.1206円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(ア) 株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
日鉄鉱業	46,000	501.00	23,046,000	
国際石油開発帝石	2,858	515,000.00	1,471,870,000	
東建コーポレーション	11,560	5,980.00	69,128,800	
大東建託	82,500	8,220.00	678,150,000	
N I P P O	33,000	1,172.00	38,676,000	
日揮	22,000	2,509.00	55,198,000	
千代田化工建設	105,000	1,084.00	113,820,000	
アサヒグループホールディングス	130,300	2,267.00	295,390,100	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	42,500	1,223.00	51,977,500	
フジッコ	6,000	1,143.00	6,858,000	
日本たばこ産業	64,200	3,060.00	196,452,000	
わらべや日洋	34,000	1,539.00	52,326,000	
グンゼ	435,000	260.00	113,100,000	
富士紡ホールディングス	251,000	287.00	72,037,000	
日清紡ホールディングス	463,000	691.00	319,933,000	
倉敷紡績	182,000	182.00	33,124,000	
ホギメディカル	6,200	5,110.00	31,682,000	
オンワードホールディングス	125,000	776.00	97,000,000	
旭化成	686,000	646.00	443,156,000	
日本曹達	425,000	475.00	201,875,000	
セントラル硝子	88,000	307.00	27,016,000	
東亜合成	614,000	413.00	253,582,000	
堺化学工業	268,000	311.00	83,348,000	
日本触媒	27,000	863.00	23,301,000	
カネカ	98,000	562.00	55,076,000	
東京応化工業	34,400	2,016.00	69,350,400	
三菱ケミカルホールディングス	2,058,000	479.00	985,782,000	
日本合成化学工業	148,000	867.00	128,316,000	
積水化学工業	615,000	1,011.00	621,765,000	
日本化薬	41,000	1,158.00	47,478,000	
A D E K A	135,100	858.00	115,915,800	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
日油	172,000	484.00	83,248,000	
日本ペイント	155,000	935.00	144,925,000	
D I C	1,793,000	215.00	385,495,000	
サカタインクス	40,000	569.00	22,760,000	
東洋インキ S C ホールディングス	191,000	480.00	91,680,000	
ファンケル	28,400	1,084.00	30,785,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	68,400	3,020.00	206,568,000	
J S P	56,900	1,441.00	81,992,900	
協和発酵キリン	117,000	1,079.00	126,243,000	
アステラス製薬	4,200	5,200.00	21,840,000	
大日本住友製薬	19,300	1,719.00	33,176,700	
塩野義製薬	77,700	2,044.00	158,818,800	
日本新薬	131,000	1,359.00	178,029,000	
エーザイ	131,100	4,380.00	574,218,000	
小野薬品工業	20,100	5,390.00	108,339,000	
久光製薬	32,700	5,150.00	168,405,000	
キッセイ薬品工業	32,600	1,993.00	64,971,800	
第一三共	575,400	1,890.00	1,087,506,000	
キョーリン製薬ホールディングス	196,000	2,323.00	455,308,000	
大塚ホールディングス	440,200	3,200.00	1,408,640,000	
出光興産	34,300	8,460.00	290,178,000	
J X ホールディングス	524,200	545.00	285,689,000	
横浜ゴム	360,000	1,039.00	374,040,000	
東洋ゴム工業	824,000	443.00	365,032,000	
三ツ星ベルト	86,000	505.00	43,430,000	
旭硝子	1,516,000	656.00	994,496,000	
日本電気硝子	1,269,000	445.00	564,705,000	
住友大阪セメント	486,000	291.00	141,426,000	
太平洋セメント	1,096,000	231.00	253,176,000	
合同製鐵	303,000	173.00	52,419,000	
大阪製鐵	39,000	1,599.00	62,361,000	
淀川製鋼所	62,000	352.00	21,824,000	
東洋鋼鈹	109,000	298.00	32,482,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
住友鋼管	58,400	786.00	45,902,400	
古河スカイ	190,000	284.00	53,960,000	
フジクラ	1,030,000	312.00	321,360,000	
リョービ	248,000	219.00	54,312,000	
SUMCO	53,700	1,098.00	58,962,600	
LIXILグループ	80,200	1,958.00	157,031,600	
東プレ	50,400	967.00	48,736,800	
日本製鋼所	527,000	520.00	274,040,000	
東芝機械	373,000	452.00	168,596,000	
アマダ	1,338,000	671.00	897,798,000	
住友重機械工業	1,739,000	395.00	686,905,000	
新東工業	67,800	860.00	58,308,000	
小森コーポレーション	100,200	911.00	91,282,200	
椿本チエイン	152,000	468.00	71,136,000	
ダイフク	43,000	773.00	33,239,000	
アマノ	30,400	905.00	27,512,000	
グローリー	127,200	2,316.00	294,595,200	
大和冷機工業	54,000	558.00	30,132,000	
大豊工業	41,600	1,197.00	49,795,200	
ジェイテクト	284,900	935.00	266,381,500	
三菱重工業	65,000	539.00	35,035,000	
コニカミノルタホールディングス	1,065,500	782.00	833,221,000	
ブラザー工業	396,400	1,021.00	404,724,400	
日立製作所	1,765,000	568.00	1,002,520,000	
東芝テック	166,000	586.00	97,276,000	
JVCケンウッド	80,000	257.00	20,560,000	
日本電気	837,000	245.00	205,065,000	
富士通	118,000	413.00	48,734,000	
TDK	69,700	3,440.00	239,768,000	
アズビル	10,900	2,046.00	22,301,400	
日立メディコ	40,000	1,469.00	58,760,000	
ウシオ電機	98,900	986.00	97,515,400	
図研	29,300	677.00	19,836,100	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
カシオ計算機	150,200	780.00	117,156,000	
ローム	85,600	3,545.00	303,452,000	
新光電気工業	194,800	829.00	161,489,200	
京セラ	4,500	9,020.00	40,590,000	
キヤノン	9,400	3,535.00	33,229,000	
リコー	376,000	1,047.00	393,672,000	
東京エレクトロン	72,100	4,230.00	304,983,000	
東海理化電機製作所	59,100	1,785.00	105,493,500	
佐世保重工業	271,000	127.00	34,417,000	
日産自動車	320,400	975.00	312,390,000	
いすゞ自動車	1,710,000	596.00	1,019,160,000	
トヨタ自動車	430,700	4,990.00	2,149,193,000	
日野自動車	677,000	1,092.00	739,284,000	
新明和工業	169,000	687.00	116,103,000	
日信工業	18,500	1,564.00	28,934,000	
トピー工業	301,000	223.00	67,123,000	
カルソニックカンセイ	296,000	427.00	126,392,000	
アイシン精機	295,400	3,540.00	1,045,716,000	
ダイハツ工業	427,000	1,933.00	825,391,000	
本田技研工業	140,500	3,770.00	529,685,000	
スズキ	217,700	2,203.00	479,593,100	
富士重工業	908,000	1,501.00	1,362,908,000	
ショーワ	94,400	1,014.00	95,721,600	
豊田合成	131,700	2,201.00	289,871,700	
ヨロズ	37,600	1,686.00	63,393,600	
タカタ	14,600	1,883.00	27,491,800	
テイ・エス テック	11,600	2,559.00	29,684,400	
バンダイナムコホールディングス	160,300	1,688.00	270,586,400	
大日本印刷	632,000	943.00	595,976,000	
イトーキ	94,600	629.00	59,503,400	
任天堂	22,300	10,560.00	235,488,000	
中部電力	193,100	1,134.00	218,975,400	
関西電力	261,000	800.00	208,800,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
中国電力	101,900	1,173.00	119,528,700	
北陸電力	58,900	1,150.00	67,735,000	
東北電力	111,900	699.00	78,218,100	
九州電力	90,300	899.00	81,179,700	
沖縄電力	12,800	3,155.00	40,384,000	
電源開発	174,900	2,481.00	433,926,900	
東日本旅客鉄道	68,200	7,940.00	541,508,000	
西日本旅客鉄道	208,700	4,530.00	945,411,000	
東海旅客鉄道	163,300	10,140.00	1,655,862,000	
山九	274,000	437.00	119,738,000	
センコー	61,000	517.00	31,537,000	
日本梱包運輸倉庫	137,800	1,497.00	206,286,600	
セイノーホールディングス	311,000	820.00	255,020,000	
日立物流	127,400	1,447.00	184,347,800	
川崎汽船	3,725,000	223.00	830,675,000	
日本航空	125,100	4,655.00	582,340,500	
全日本空輸	937,000	211.00	197,707,000	
住友倉庫	27,000	653.00	17,631,000	
上組	121,000	873.00	105,633,000	
NECネットエスアイ	23,000	1,860.00	42,780,000	
新日鉄住金ソリューションズ	33,000	1,826.00	60,258,000	
ITホールディングス	154,800	1,204.00	186,379,200	
フジ・メディア・ホールディングス	3,714	162,100.00	602,039,400	
伊藤忠テクノソリューションズ	25,900	4,720.00	122,248,000	
大塚商会	31,000	10,260.00	318,060,000	
ネットワンシステムズ	249,600	863.00	215,404,800	
日本テレビホールディングス	341,400	1,489.00	508,344,600	
テレビ朝日	23,100	1,873.00	43,266,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,196	45,050.00	53,879,800	
日本電信電話	261,900	4,250.00	1,113,075,000	
KDDI	98,300	7,500.00	737,250,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	3,068	148,400.00	455,291,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	516	316,000.00	163,056,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
D T S	62,400	1,497.00	93,412,800	
S C S K	13,900	1,957.00	27,202,300	
T K C	13,900	1,723.00	23,949,700	
N S D	19,400	1,073.00	20,816,200	
コナミ	30,400	1,905.00	57,912,000	
ソフトバンク	195,000	3,850.00	750,750,000	
伊藤忠食品	8,500	3,800.00	32,300,000	
アルフレッサ ホールディングス	98,800	4,905.00	484,614,000	
あい ホールディングス	31,700	891.00	28,244,700	
メディカルホールディングス	21,100	1,257.00	26,522,700	
伊藤忠商事	210,600	1,213.00	255,457,800	
丸紅	1,498,000	751.00	1,124,998,000	
豊田通商	21,300	2,522.00	53,718,600	
三井物産	1,264,600	1,393.00	1,761,587,800	
住友商事	1,207,700	1,252.00	1,512,040,400	
サンゲツ	12,100	2,446.00	29,596,600	
リョーサン	26,200	1,854.00	48,574,800	
三信電気	33,300	668.00	22,244,400	
トラスコ中山	34,600	1,899.00	65,705,400	
オートバックスセブン	28,300	4,470.00	126,501,000	
カワチ薬品	45,900	1,984.00	91,065,600	
アスクル	101,300	1,276.00	129,258,800	
ゲオホールディングス	571	119,500.00	68,234,500	
アルペン	15,200	1,724.00	26,204,800	
ドトール・日レスホールディングス	49,700	1,350.00	67,095,000	
マツモトキヨシホールディングス	62,200	2,704.00	168,188,800	
セブン&アイ・ホールディングス	626,700	3,075.00	1,927,102,500	
ファミリーマート	173,600	4,280.00	743,008,000	
島忠	55,600	2,124.00	118,094,400	
チヨダ	11,900	2,218.00	26,394,200	
A O K Iホールディングス	76,500	2,382.00	182,223,000	
オークワ	16,000	1,072.00	17,152,000	
青山商事	89,800	2,227.00	199,984,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
イオン	143,000	1,101.00	157,443,000	
ユニグループ・ホールディングス	299,500	689.00	206,355,500	
アークランドサカモト	39,900	1,575.00	62,842,500	
アークス	69,000	1,967.00	135,723,000	
あおぞら銀行	2,250,000	292.00	657,000,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,295,600	577.00	3,632,561,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	3,805,000	449.00	1,708,445,000	
三井住友フィナンシャルグループ	650,500	4,000.00	2,602,000,000	
みずほフィナンシャルグループ	7,774,400	212.00	1,648,172,800	
大和証券グループ本社	105,000	691.00	72,555,000	
野村ホールディングス	1,377,800	591.00	814,279,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	53,000	675.00	35,775,000	
T&Dホールディングス	287,000	1,141.00	327,467,000	
芙蓉総合リース	84,100	3,610.00	303,601,000	
興銀リース	44,600	2,935.00	130,901,000	
東京センチュリーリース	72,900	2,389.00	174,158,100	
日本証券金融	37,100	749.00	27,787,900	
リコーリース	28,600	2,649.00	75,761,400	
日立キャピタル	36,100	1,949.00	70,358,900	
オリックス	113,120	11,960.00	1,352,915,200	
野村不動産ホールディングス	126,800	2,009.00	254,741,200	
東京建物	1,568,000	625.00	980,000,000	
東急不動産	1,128,000	877.00	989,256,000	
大京	209,000	327.00	68,343,000	
アーネストワン	79,900	1,746.00	139,505,400	
アコーディア・ゴルフ	1,180	96,400.00	113,752,000	
タケエイ	9,200	3,395.00	31,234,000	
NECフィールディング	26,700	1,228.00	32,787,600	
ディー・エヌ・エー	40,500	2,437.00	98,698,500	
ダスキン	50,900	1,896.00	96,506,400	
ラウンドワン	316,600	705.00	223,203,000	
リゾートトラスト	21,800	2,566.00	55,938,800	
もしもしホットライン	48,200	1,422.00	68,540,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
東急コミュニティー	6,800	4,035.00	27,438,000	
エイチ・アイ・エス	33,000	3,905.00	128,865,000	
東京ドーム	165,000	563.00	92,895,000	
ベネッセホールディングス	57,300	3,990.00	228,627,000	
合計			74,109,676,900	

(イ) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」の「取引の時価等に関する事項」に記載されております。

[次へ](#)

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(2013年3月29日現在)

資産総額	12,531,931,310円
負債総額	57,531,506円
純資産総額(-)	12,474,399,804円
発行済口数	18,861,204,744口
1口当たり純資産額(/)	0.6614円

参考情報

<GS日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

純資産額計算書

(2013年3月29日現在)

資産総額	65,611,843,553円
負債総額	55,720,707円
純資産総額(-)	65,556,122,846円
発行済口数	59,260,564,067口
1口当たり純資産額(/)	1.1062円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

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」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

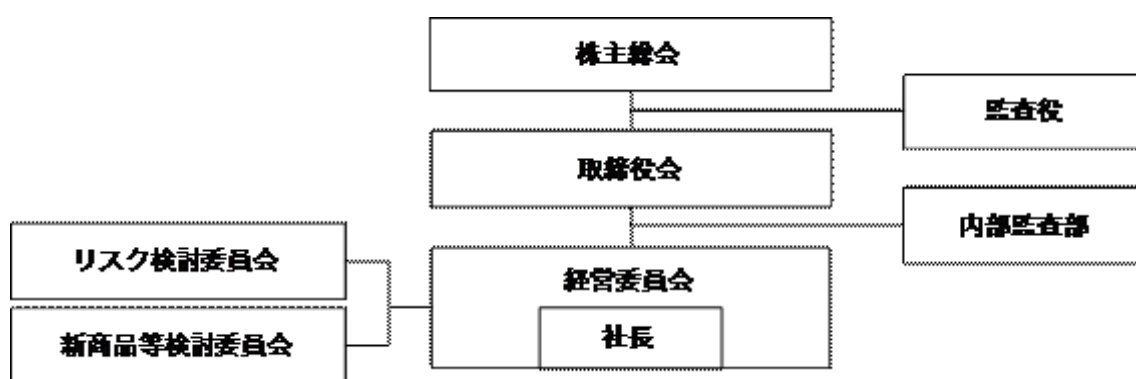
発行する株式の総数：8,000株

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（取締役会の専権事項を除きます。）。

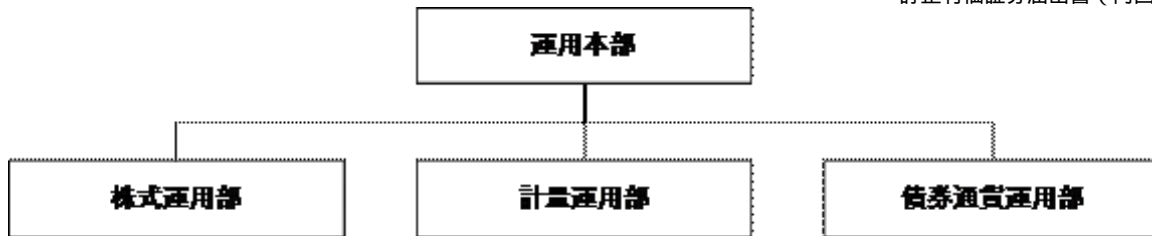
リスク検討委員会は、経営委員会の監督の下に、当社の一切の活動における法令遵守、内部統制、オペレーショナル・リスク、システム・リスク等のリスク、及び関連するレピュテーション上の問題を監視・監督し、当社の経営理念に沿った各種規定及び業務手順が整備されていることを確保するため、権限を行使することができます。また、リスク検討委員会は、適用法令、協会規則、投資信託約款、顧客との運用ガイドラインを遵守するとともに、善良なる管理者としての注意義務および忠実義務の観点から受託者としての責任を遵守するため（議決権行使に関する方針を含みます。）、必要な報告徴収、調査、検討、決定等を行うことができます。

新商品等検討委員会は、経営委員会の監督の下に、新商品等検討委員会規則に基づき、新商品等に関する正式な検討プロセスを維持することに責任を持ちます。

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、オルタナティブ・インベストメンツ・アンド・マネージャー・セレクション部、不動産運用部およびマルチプロダクト・ファンド室があります。



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

2013年4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	96	1,483,175,857,497
合計	96	1,483,175,857,497

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

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17期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人の中間監査を受けております。

(1) 貸借対照表

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24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			5,260,116			3,285,446	
有価証券			11,996,812			11,797,976	
支払委託金			26			25	
収益分配金		26			25		
前払費用			12,310			468	
未収入金	* 1		-			406,284	
未収委託者報酬			1,179,339			1,064,467	
未収運用受託報酬			974,480			1,026,201	
未収収益	* 1		503,943			159,925	
立替金			84,372			34,566	
繰延税金資産			441,173			489,782	
流動資産計			20,452,575	87.7		18,265,146	90.9
固定資産							
無形固定資産			133,057			694	
ソフトウェア		132,362			-		
その他の無形固定資産		694			694		
投資その他の資産			2,748,369			1,830,583	
投資有価証券		1,087,459			684,540		
長期差入保証金		-			10,000		
繰延税金資産		1,636,928			1,135,876		
その他の投資等		23,981			166		
固定資産計			2,881,426	12.3		1,831,278	9.1
資産合計			23,334,002	100.0		20,096,424	100.0

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24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			305			82	
未払金			500,286			853,668	
未払収益分配金		125			151		
未払償還金		72			72		
未払手数料		500,088			447,157		
その他未払金		-			406,287		
未払費用	* 1		2,176,374			1,998,271	
未払法人税等			629,052			190,726	
未払消費税等			32,752			30,533	
流動負債計			3,338,771	14.3		3,073,282	15.3
固定負債							
長期未払費用	* 1		3,631,711			2,945,495	
役員退職慰労引当金			875,845			222,911	
その他固定負債			650			650	
固定負債計			4,508,207	19.3		3,169,057	15.8
特別法上の準備金							
金融商品取引責任準備金			0			-	
特別法上の準備金計			0	0.0		-	0.0
負債合計			7,846,979	33.6		6,242,339	31.1

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24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			14,559,911			12,921,678	
その他利益剰余金		14,559,911			12,921,678		
繰越利益剰余金		14,559,911			12,921,678		
株主資本合計			15,439,911	66.2		13,801,678	68.7
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		47,111			52,406		
評価・換算差額等合計			47,111	0.2		52,406	0.3
純資産合計			15,487,022	66.4		13,854,085	68.9
負債・純資産合計			23,334,002	100.0		20,096,424	100.0

(2) 損益計算書

期別		第16期 自平成22年4月1日 至平成23年3月31日			第17期 自平成23年4月1日 至平成24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
		千円	千円	%	千円	千円	%
営業収益							
委託者報酬			11,155,324			9,262,739	
運用受託報酬	* 2		6,524,566			5,636,349	
その他営業収益	* 2		5,720,903			5,514,145	
営業収益計			23,400,795	100.0		20,413,234	100.0
営業費用							
支払手数料			5,811,677			4,702,587	
広告宣伝費			77,931			165,456	
調査費			4,138,815			4,318,795	
調査費		0				-	
委託調査費	* 2	4,138,814			4,318,795		
委託計算費			200,594			163,984	
営業雑経費			435,984			365,639	
通信費		247,413			212,981		
印刷費		160,208			130,935		
協会費		28,362			21,722		
営業費用計			10,665,004	45.6		9,716,463	47.6
一般管理費							
給料			6,888,334			5,308,793	
役員報酬		161,011			163,438		
給料・手当		3,004,836			2,866,902		
賞与		1,029,476			488,900		
株式従業員報酬	* 1,2	778,541			199,573		
その他の報酬		1,914,468			1,589,978		
交際費			39,406			26,547	
寄付金			44,518			92,237	
旅費交通費			217,421			204,386	
租税公課			47,335			60,314	
不動産賃借料			576,617			458,251	
退職給付費用			811,570			635,720	
固定資産減価償却費			49,760			24,336	
事務委託費			313,451			386,181	
諸経費			1,218,027			1,284,675	
一般管理費計			10,206,444	43.6		8,481,445	41.5
営業利益			2,529,346	10.8		2,215,325	10.9

期別		第16期 自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日			第17期 自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24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			16,136			-	
	受取利息			21,964			21,224	
	投資有価証券売却益			-			77,795	
	株式従業員報酬	* 1,2		55,488			251,012	
	雑益			165			2,903	
	営業外収益計			93,755	0.4		352,935	1.7
	営業外費用							
	支払利息			-			0	
	為替差損			-			22,648	
	雑損			0			0	
	営業外費用計			0	0.0		22,649	0.1
経常利益				2,623,101	11.2		2,545,612	12.5

期別		第16期 自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日			第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24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						
	金融商品取引責任準備 金戻入額		-			0	
	特別利益計		-	0.0		0	0.0
	特別損失						
	特別損失計		-	0.0		-	0.0
税引前当期純利益			2,623,101	11.2		2,545,613	12.5
法人税、住民税及び事業税			1,158,841	5.0		731,215	3.6
法人税等調整額			5,213	0.0		452,629	2.2
当期純利益			1,459,046	6.2		1,361,767	6.7

(3) 株主資本等変動計算書

第16期
(自平成22年 4 月 1 日 至平成23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
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				2,500,000	2,500,000	2,500,000			2,500,000
当期純利益				1,459,046	1,459,046	1,459,046			1,459,046
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							4,364	4,364	4,364
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,040,953	1,040,953	1,040,953	4,364	4,364	1,036,588
平成23年 3 月31日残高	490,000	390,000	390,000	14,559,911	14,559,911	15,439,911	47,111	47,111	15,487,022

第17期
(自平成23年 4 月 1 日 至平成24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23年 4 月 1 日残高	490,000	390,000	390,000	14,559,911	14,559,911	15,439,911	47,111	47,111	15,487,022
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				1,361,767	1,361,767	1,361,767			1,361,767
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							5,294	5,294	5,294
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,638,232	1,638,232	1,638,232	5,294	5,294	1,632,937
平成24年 3 月31日残高	490,000	390,000	390,000	12,921,678	12,921,678	13,801,678	52,406	52,406	13,854,085

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>
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>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。</p> <p>(2) 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>(3) 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>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>	<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>
-----------------------------------	--

表示方法の変更

<p>その他の報酬に関する表示方法の変更</p>	<p>従来、関係会社から振替えられる兼職職 員関連の費用は、全て「一般管理費」の 「その他の報酬」に含めておりました が、人件費以外の費用も一部含まれてい ることから、当会計年度より、当該人件費 以外の金額を財務諸表により明瞭に反映 させるため、「一般管理費」の「諸経 費」に含めることとしました。</p> <p>この表示方法の変更を反映させるため、 前会計年度の財務諸表の組替えを行って おります。</p> <p>この結果、前会計年度の損益計算書にお いて、「一般管理費」の「給料」及び 「その他の報酬」並びに「諸経費」に表 示していた7,651,162千円、2,677,296千 円及び455,198千円は、それぞれ、 6,888,334千円、1,914,468千円及び 1,218,027千円に組替えられております。</p>
--------------------------	--

注記事項

（貸借対照表関係）

第16期 (平成23年3月31日現在)	第17期 (平成24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 138,806千円</p> <p>流動負債</p> <p>未払費用 40,141千円</p> <p>固定負債</p> <p>長期未払費用 116,408千円</p>	<p>* 1 関係会社項目 同左</p> <p>流動資産</p> <p>未収入金 404,033千円</p>

（損益計算書関係）

第16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第17期 (自平成23年4月1日 至平成24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 1,154,351千円</p> <p>その他営業収益 5,677,633千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 4,138,814千円</p> <p>株式従業員報酬 119,593千円</p> <p>営業外費用</p> <p>株式従業員報酬 124,855千円</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>その他営業収益 5,452,985千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 4,318,795千円</p> <p>営業外収益</p> <p>株式従業員報酬 56,181千円</p>

（株主資本等変動計算書関係）

第16期（自 平成22年 4月 1日 至 平成23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

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22年 9月27日 臨時株主総会	普通株式	2,500,000	390,625	平成22年 9月30日	平成22年 9月30日

第17期（自 平成23年 4月 1日 至 平成24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24年 3月12日 臨時株主総会	普通株式	3,000,000	468,750	平成24年 3月22日	平成24年 3月22日

（リース取引関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24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16期
（自 平成22年4月1日
至 平成23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、未収委託者報酬及び未収運用受託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、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

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

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

また、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬に関しては、過去に回収できなかったケースは無く、特に未収委託者報酬に関しては、受託者たる信託銀行で分別管理されている当社が運用する信託財産から受領するため、リスクは非常に低いものと考えております。

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内にて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70%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第16期
(自 平成22年4月1日
至 平成23年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成23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	5,260,116	5,260,116	-
有価証券			
其他有価証券	11,996,812	11,996,812	-
未収委託者報酬	1,179,339	1,179,339	-
未収運用受託報酬	974,480	974,480	-

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	5,260,116	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券のうち満期があるもの	12,000,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,179,339	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	974,480	-	-	-	-	-

第17期
（自 平成23年4月1日
至 平成24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、未収委託者報酬及び未収運用受託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、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

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

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

また、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬に関しては、過去に回収できなかったケースは無く、特に未収委託者報酬に関しては、受託者たる信託銀行で分別管理されている当社が運用する信託財産から受領するため、リスクは非常に低いものと考えております。

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内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%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第17期
(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成24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	3,285,446	3,285,446	-
有価証券			
其他有価証券	11,797,976	11,797,976	-
未収委託者報酬	1,064,467	1,064,467	-
未収運用受託報酬	1,026,201	1,026,201	-

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	3,285,446	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券の うち満期があるもの	11,800,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,064,467	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,026,201	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）					第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24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	1,087,459	79,432	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	600,000	684,540	84,540
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	11,996,812	11,996,812	-	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	11,797,976	11,797,976	-
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。					2. 当事業年度中に売却したその他有価証券				
					売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）		
					1,095,821	77,795	-		

（デリバティブ取引関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24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16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24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。	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16期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第17期 （自平成23年4月1日 至平成24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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">371,686千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">48,985</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">20,502</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">441,173</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">小計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">441,173</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;">1,275,508</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">356,412</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">37,328</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,669,249</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;">32,321</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">32,321</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,636,928千円</td> </tr> </table>	未払費用	371,686千円	未払事業税	48,985	その他	20,502	小計	441,173	小計	-	繰延税金資産の純額	441,173	長期未払費用	1,275,508	役員退職慰労引当金	356,412	その他	37,328	小計	1,669,249	その他有価証券評価差額金	32,321	小計	32,321	繰延税金資産の純額	1,636,928千円	<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;">456,569千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">15,881</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">17,331</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">489,782</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">小計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">489,782</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;">1,033,933</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">81,558</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">52,518</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,168,010</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;">32,133</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">32,133</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,135,876千円</td> </tr> </table>	未払費用	456,569千円	未払事業税	15,881	その他	17,331	小計	489,782	小計	-	繰延税金資産の純額	489,782	長期未払費用	1,033,933	役員退職慰労引当金	81,558	その他	52,518	小計	1,168,010	その他有価証券評価差額金	32,133	小計	32,133	繰延税金資産の純額	1,135,876千円
未払費用	371,686千円																																																				
未払事業税	48,985																																																				
その他	20,502																																																				
小計	441,173																																																				
小計	-																																																				
繰延税金資産の純額	441,173																																																				
長期未払費用	1,275,508																																																				
役員退職慰労引当金	356,412																																																				
その他	37,328																																																				
小計	1,669,249																																																				
その他有価証券評価差額金	32,321																																																				
小計	32,321																																																				
繰延税金資産の純額	1,636,928千円																																																				
未払費用	456,569千円																																																				
未払事業税	15,881																																																				
その他	17,331																																																				
小計	489,782																																																				
小計	-																																																				
繰延税金資産の純額	489,782																																																				
長期未払費用	1,033,933																																																				
役員退職慰労引当金	81,558																																																				
その他	52,518																																																				
小計	1,168,010																																																				
その他有価証券評価差額金	32,133																																																				
小計	32,133																																																				
繰延税金資産の純額	1,135,876千円																																																				
<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> <p>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差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.69 %</td> </tr> <tr> <td>（調整）</td> <td></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;">6.24 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">- 0.42 %</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;">46.51 %</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.69 %	（調整）		法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	6.24 %	その他	- 0.42 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.51 %																																										
法定実効税率	40.69 %																																																				
（調整）																																																					
法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	6.24 %																																																				
その他	- 0.42 %																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.51 %																																																				

<p style="text-align: center;">第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）</p>	<p style="text-align: center;">第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）</p>
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正 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 「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以降に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることになりました。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40.69%から、平成24年4月1日に開始する事業年度以降、平成27年3月31日までに終了する事業年度までに解消が見込まれる一時差異については38.01%、平成27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35.64%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は156,460千円減少し、その他有価証券評価差額金が2,268千円、法人税等調整額が158,728千円それぞれ増加しております。</p>
<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響 該当事項はありません。</p>	<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合のその内容及び影響 該当事項はありません。</p>

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第16期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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]

第16期（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

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	11,155,324	6,524,566	5,720,903	23,400,795

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
20,628,449	2,772,345	23,400,795

海外の外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める地域はありません。

(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17期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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]

第17期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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	9,262,739	5,636,349	5,514,145	20,413,234

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
18,556,174	1,857,060	20,413,234

海外の外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める地域はありません。

(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。

(関連当事者との取引)

第16期
(自 平成22年 4 月 1 日
至 平成23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 ヨーク州	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)	119,593	未払費用	40,141
							株式従業員報 酬(注1)	124,855	長期未払 費用	116,408
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	22 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)	1,154,351	未収収益	138,806
							その他営業収 益(注2)	5,677,633		
							委託調査費の 支払(注2)	4,138,814		

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16期
(自平成22年4月1日
至平成23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 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	149,454 2,565,003 21,114	未払手数料 未払費用 有価証券 立替金	17,326 474,311 11,996,812 38
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 株式従業員 報酬	7,056,607 11,019	未払費用 立替金 長期未払 費用	862,578 43,759 3,791,077
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	41 百万ドル	投資顧問業		投資助言	運用受託報酬 (注3)	1,617,993	未収収益	365,104
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	33 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	434,078 63,231	未払費用 長期未払 費用	495,731 43,158

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)

第17期
 (自平成23年4月1日
 至平成24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 ニューヨーク州	3,108 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	株式従業員報酬(注1)	56,181		
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	316 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2) 委託調査費の支払(注2)	5,452,985 4,318,795	未収入金	393,727

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) 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17期
(自平成23年4月1日
至平成24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 有価証券 の購入	兼務従業員の 人件費等の支 払(注1)	2,304,783	有価証券	11,797,976
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 株式従業 員報酬	5,339,280 171,617	未払費用 長期未払 費用	1,111,143 3,017,713
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	19,214 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	360,145
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	32 百万ドル	投資顧問 業		投資助言			未払費用	212,193

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)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

(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16期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)		第17期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	
1株当たり純資産額	2,419,847円31銭	1株当たり純資産額	2,164,700円82銭
1株当たり当期純利益金額	227,976円06銭	1株当たり当期純利益金額	212,776円18銭
損益計算書上の当期純利益	1,459,046千円	損益計算書上の当期純利益	1,361,767千円
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	1,459,046千円	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	1,361,767千円
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18期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		2,254,055	
有価証券		8,198,673	
支払委託金		38	
未収入金		4,896	
未収委託者報酬		1,452,209	
未収運用受託報酬		1,474,882	
未収収益		164,140	
立替金		94,352	
繰延税金資産		405,374	
流動資産計		14,048,625	68.9
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		5,015,540	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,325,987	
その他		66	
投資その他の資産計		6,351,594	
固定資産計		6,351,594	31.1
資産合計		20,400,220	100.0

区分	注記 番号	第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		328	
未払金		476,081	
未払費用		1,186,141	
未払法人税等		557,382	
その他	* 1	62,788	
流動負債計		2,282,722	11.2
固定負債			
長期未払費用		3,403,146	
役員退職慰労引当金		222,911	
その他固定負債		650	
固定負債計		3,626,708	17.8
負債合計		5,909,430	29.0

区分	注記 番号	第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
		金額	構成比
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		490,000	
資本剰余金			
資本準備金		390,000	
資本剰余金合計		390,000	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		13,601,156	
利益剰余金合計		13,601,156	
株主資本合計		14,481,156	71.0
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		9,633	
評価・換算差額等合計		9,633	
純資産合計		14,490,789	71.0
負債・純資産合計		20,400,220	100.0

(2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第18期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		4,773,984	
運用受託報酬		2,887,405	
その他営業収益		2,479,576	
営業収益計		10,140,966	100.0
営業費用及び一般管理費		9,078,365	89.5
営業利益		1,062,601	10.5
営業外収益	* 1	77,171	0.8
営業外費用		26	0.0
経常利益		1,139,746	11.2
税引前中間純利益		1,139,746	11.2
法人税、住民税及び事業税		539,744	5.3
法人税等調整額		79,476	0.8
中間純利益		679,477	6.7

重要な会計方針

項目	第18期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 時価をもって中間貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。</p> <p>時価のないもの 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) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく当中間会計期間末要支給見積額を計上しております。</p> <p>(2) 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>(3) 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) 株式報酬の会計処理方法 役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第18期中間会計期間末 (平成24年9月30日)
* 1 消費税等の取扱い	控除対象の仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債の「その他」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第18期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)				
* 1 営業外収益のうち主要なもの	<table><tr><td data-bbox="614 304 1023 338">株式報酬</td><td data-bbox="1023 304 1362 338">67,996千円</td></tr><tr><td data-bbox="614 338 1023 371">受取利息</td><td data-bbox="1023 338 1362 371">8,994千円</td></tr></table>	株式報酬	67,996千円	受取利息	8,994千円
株式報酬	67,996千円				
受取利息	8,994千円				

（リース取引関係）

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。

（金融商品関係）

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、中間貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	2,254,055	2,254,055	-
有価証券			
其他有価証券	8,198,673	8,198,673	-
未収委託者報酬	1,452,209	1,452,209	-
未収運用受託報酬	1,474,882	1,474,882	-
投資有価証券	5,015,540	5,015,540	-

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18期中間会計期間末（平成24年9月30日）

其他有価証券

区分	種類	取得原価 （千円）	中間貸借対照表 計上額（千円）	差額 （千円）
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	600,000	615,540	15,540
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	4,400,000	4,400,000	-
	コマーシャル・ペーパー	8,198,673	8,198,673	-

（デリバティブ取引関係）

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

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〕

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

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	4,773,984	2,887,405	2,479,576	10,140,966

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
9,260,912	880,054	10,140,966

海外の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%以上を占める地域はありません。

(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18期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,264,185円88銭
1株当たり中間純利益金額	106,168円35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 おりません。	
(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	679,477千円
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	679,477千円
差 額	-
期中平均株式数	
普通株式	6,400株

(重要な後発事象)

第18期中間会計期間（自平成24年4月1日 至平成24年9月30日）

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) 通常の取引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（委託者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。

独立監査人の監査報告書

平成25年4月24日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているG S日本株式インデックス・プラスの平成24年9月21日から平成25年3月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、G S日本株式インデックス・プラスの平成25年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況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

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24年5月29日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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23年4月1日から平成24年3月31日までの第17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24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月3日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第18期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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