

## 【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26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25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】

### (5) 申込手数料

#### < 訂正前 >

2.625%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ定める申込手数料率を取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。

消費税率が8%になった場合は、上限2.7%（税抜2.5%）となります。

詳しくは、販売会社または上記(4)の照会先までお問い合わせください。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

（後略）

#### < 訂正後 >

2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ定める申込手数料率を取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。詳しくは、販売会社または上記(4)の照会先までお問い合わせください。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

（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

##### (3) ファンドの仕組み

<訂正前>

(前略)

#### 2. ファンドの関係法人

(中略)

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

(中略)

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2013年6月末現在、グループ全体で7,395億米ドル (約72.9兆円<sup>\*</sup>) の資産を運用しています。

\*米ドルの円貨換算は便宜上、2013年6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 = 98.59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>

(前略)

#### 2. ファンドの関係法人

(中略)

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

(中略)

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント (GSAM) は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2013年12月末現在、グループ全体で8,076億米ドル (約85.1兆円<sup>\*</sup>) の資産を運用しています。

\*米ドルの円貨換算は便宜上、2013年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値 (1米ドル = 105.39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](#)

### 3 投資リスク

#### (1) 投資リスク

<訂正前>

(前略)

(新設)

(h) 法令・税制・会計等の変更可能性に関わる留意点

(中略)

(i) その他の留意点

(後略)

<訂正後>

(前略)

(h) 外国口座税務コンプライアンス法（FATCA）に関わる留意点

2014年6月30日より後に行われる米国源泉の利子または配当（および同様の支払い）の本ファンドに対する支払いおよび2016年12月31日より後に行われる米国源泉の利子もしくは配当を生じうる財産の売却その他の処分による総受取額の本ファンドに対する一定の支払いは、30%の源泉徴収税の対象となります。ただし、本ファンドが米国内国債入庁（以下「IRS」といいます。）との間で源泉徴収契約を締結すること、本ファンドが一定の受益者から一定の情報を取得すること、本ファンドがかかる情報のうち一定の情報をIRSに開示すること等の要件が満たされる場合には、源泉徴収税の対象とはなりません。本ファンドがかかる源泉徴収税の対象とならない保証はありません。受益者は、この源泉徴収税について考えられる影響についてご自身の税務顧問にご相談ください。

<外国口座税務コンプライアンス法（FATCA）について>

外国口座税務コンプライアンス法（Foreign Account Tax Compliance Act）（以下「FATCA」といいます。）として知られる米国の源泉徴収規定により、外国金融機関またはその他の外国事業体に対する（i）2014年6月30日より後に行われる、定額または確定可能額の米国源泉の所得の1年に一度または定期的な一定の支払い、（ii）2016年12月31日より後に行われる、米国源泉の利子または配当を生じうる財産の売却その他の処分による総受取額に帰せられる一定の支払い、および（iii）2016年12月31日より後に行われる、外国金融機関による一定の支払い（またはその一部）は、本ファンドがFATCAにおける各種報告要件を充足しない限り、30%の源泉徴収税の対象となります。米国は、日本の金融機関によるFATCAの実施に関して、日本政府との間で政府間協定（以下「日米政府間協定」といいます。）を締結しています。FATCAおよび日米政府間協定の下で、本ファンドは、この目的上、「外国金融機関」として扱われることが予想されます。本ファンドは、外国金融機関として、FATCAを遵守するには、IRSに登録して、IRSとの間で、特に以下の要件を本ファンドに義務付ける内容の契約（以下「FFI契約」といいます。）を締結する必要があります。

1. 受益者が「特定米国人」（すなわち、免税事業体および一定のその他の者を除く米国連邦所得税法上の米国人）および（一定の場合）特定米国人により所有される非米国人（以下「米国所有外国事業体」といいます。）に該当するか否かを判断するために、一定の受益者に関する情報を取得し、確認すること
2. FATCAを遵守していない受益者（まとめて）の情報、特定米国人の情報および米国所有外国事業体の情報を1年に一度IRSに報告すること
3. 特定米国人、米国所有外国事業体またはFATCAを遵守していない外国金融機関であって、本ファンドから報告義務のある額の支払いを受ける既存の口座保有者からの同意の取得を試み、一定の当該保有者の口座情報をIRSに報告すること、新規口座については、かかる同意の取得を口座開設の条件とすること

本ファンドがFFI契約を締結してこれを遵守することができる保証はなく、本ファンドがこの30%の源泉徴収税を免除される保証もありません。

各受益者は、本ファンドへの投資により、当該受益者の税務上の居住国・地域の税務当局が、本ファンドから、直接または間接的かを問わず、条約、政府間協定等の規定に従い、当該受益者に関する情報の提供を受ける可能性があることをご認識ください。これに関し、本ファンドが特定米国人および米国所有外国事業体である受益者に関する情報を1年に一度報告する義務に加えて、IRSは、日米租税条約に基づき、FATCAを遵守していない受益者に関する情報を日本の財務大臣に請求することができます。

受益者は、この源泉徴収税について考えられる影響についてご自身の税務顧問にご相談ください。

(i) 法令・税制・会計等の変更可能性に関わる留意点

（中略）

(j) その他の留意点

（後略）

[次へ](#)

## 4 手数料等及び税金

<訂正前>

### (1) 申込手数料

(a) 2.625%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ定める申込手数料率を取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。

消費税率が8%になった場合は、上限2.7%（税抜2.5%）となります。

詳しくは、販売会社または下記の照会先までお問い合わせください。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

電話 : 03 (6437) 6000（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

ホームページ・アドレス : www.gsam.co.jp

（中略）

### (3) 信託報酬等

以下の支払先が行う本ファンドに関する業務の対価として本ファンドから支払われる信託報酬は、本ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、本ファンドの信託財産の純資産総額に年率1.05%（税抜1.0%）を乗じて得た額とします。委託会社、受託銀行および販売会社間の配分については以下のとおりとします。なお、販売会社の間における配分については、販売会社の取扱いにかかる純資産総額に応じて決められます。

消費税率が8%になった場合は、年率1.08%（税抜1.0%）となります。なお、下記の配分についても相応分上がります。

委託会社	販売会社	受託銀行
年率0.4725%（税抜0.45%）	年率0.5250%（税抜0.5%）	年率0.0525%（税抜0.05%）

（中略）

### (5) 課税上の取扱い

（中略）

個人の受益者の場合<sup>\*1</sup>

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% <sup>*2</sup>
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% <sup>*2</sup>
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 10.147% <sup>*2</sup>

\*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）

本ファンドは、課税上、株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は、2014年1月1日以降、少額投資非課税制度（NISA）の適用対象です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、2014年1月1日以降の非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（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）

・ 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)

・ 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)

・ 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)

・ 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%)



## &lt;訂正後&gt;

## (1) 申込手数料

- (a) 2.7%（税抜2.5%）を上限として販売会社がそれぞれ定める申込手数料率を取得申込日の基準価額に乗じて得た額が申込手数料となります。詳しくは、販売会社または下記の照会先までお問い合わせください。申込手数料は、お申込時にご負担いただきます。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

電話 : 03 (6437) 6000 (受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで)

ホームページ・アドレス : www.gsam.co.jp

(中略)

## (3) 信託報酬等

以下の支払先が行う本ファンドに関する業務の対価として本ファンドから支払われる信託報酬は、本ファンドの信託財産の計算期間を通じて毎日、本ファンドの信託財産の純資産総額に年率1.08%（税抜1.0%）を乗じて得た額とします。委託会社、受託銀行および販売会社間の配分については以下のとおりとします。なお、販売会社の間における配分については、販売会社の取扱いにかかる純資産総額に応じて決められます。

委託会社	販売会社	受託銀行
年率0.486%（税抜0.45%）	年率0.540%（税抜0.5%）	年率0.0540%（税抜0.05%）

(中略)

## (5) 課税上の取扱い

(中略)

個人の受益者の場合<sup>\*1</sup>

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 × 20.315% <sup>*2</sup>
換金時 (解約請求による場合)	所得税および地方税	譲渡益 × 20.315% <sup>*2</sup>
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 20.315% <sup>*2</sup>

\*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 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)

本ファンドは、課税上、株式投資信託として取扱われます。公募株式投資信託は、少額投資非課税制度（NISA）の適用対象です。

## 少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(中略)

## &lt;収益分配金の課税について&gt;

(中略)

## 個人の受益者に対する課税

(中略)

- ・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)

- ・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)

## &lt; 換金時および償還時の課税について &gt;

## 個人の受益者に対する課税

( 中略 )

- ・ 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 )

- ・ 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

(2014年3月31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		12,211,367,094	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,881,988	0.03
合計(純資産総額)		12,207,485,106	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>

(2014年3月31日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	54,691,661,600	95.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,432,366,560	4.26
合計(純資産総額)		57,124,028,160	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

(2014年3月31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	9,378,930,180	1.2380	11,611,144,649	1.3020	12,211,367,094	100.03

## 種類別及び業種別投資比率

(2014年3月31日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.03
合計	100.03

(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

## &lt;GS日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド&gt;

(2014年3月31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	トヨタ自動車	輸送用機器	569,800	5,425.00	3,091,165,000	5,826.00	3,319,654,800	5.81
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	3,567,900	546.00	1,948,073,400	567.00	2,022,999,300	3.54
3	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	371,400	4,220.00	1,567,308,000	4,409.00	1,637,502,600	2.87
4	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	7,183,100	201.00	1,443,803,100	204.00	1,465,352,400	2.57
5	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	391,300	3,030.00	1,185,639,000	3,240.00	1,267,812,000	2.22
6	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	144,100	8,212.00	1,183,349,200	7,800.00	1,123,980,000	1.97
7	日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	1,484,500	641.00	951,564,500	662.00	982,739,000	1.72
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	153,200	5,619.00	860,830,800	5,619.00	860,830,800	1.51
9	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	268,500	2,999.00	805,231,500	3,087.00	828,859,500	1.45
10	日本	株式	京セラ	電気機器	177,600	4,415.00	784,104,000	4,653.00	826,372,800	1.45
11	日本	株式	オリックス	その他金融業	558,900	1,399.00	781,901,100	1,453.00	812,081,700	1.42
12	日本	株式	第一三共	医薬品	436,000	1,645.00	717,220,000	1,738.00	757,768,000	1.33
13	日本	株式	マツダ	輸送用機器	1,649,000	440.13	725,775,428	458.00	755,242,000	1.32
14	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	149,400	4,871.00	727,727,400	4,892.00	730,864,800	1.28
15	日本	株式	旭硝子	ガラス・土石製品	1,137,000	545.00	619,665,000	598.00	679,926,000	1.19
16	日本	株式	富士フィルムホールディングス	化学	238,500	2,647.00	631,309,500	2,771.00	660,883,500	1.16
17	日本	株式	住友商事	卸売業	484,200	1,273.00	616,386,600	1,313.00	635,754,600	1.11
18	日本	株式	太平洋セメント	ガラス・土石製品	1,698,000	357.00	606,186,000	372.00	631,656,000	1.11
19	日本	株式	スタートトゥデイ	小売業	235,100	2,600.00	611,260,000	2,643.00	621,369,300	1.09
20	日本	株式	日本電気硝子	ガラス・土石製品	1,151,000	468.00	538,668,000	531.00	611,181,000	1.07
21	日本	株式	川崎汽船	海運業	2,714,000	208.00	564,512,000	223.00	605,222,000	1.06
22	日本	株式	商船三井	海運業	1,479,000	382.00	564,978,000	402.00	594,558,000	1.04
23	日本	株式	大日本印刷	その他製品	598,000	930.00	556,140,000	989.00	591,422,000	1.04
24	日本	株式	富士通	電気機器	938,000	575.00	539,350,000	624.00	585,312,000	1.02
25	日本	株式	塩野義製薬	医薬品	305,200	1,906.00	581,711,200	1,913.00	583,847,600	1.02
26	日本	株式	住友重機械工業	機械	1,365,000	419.00	571,935,000	419.00	571,935,000	1.00
27	日本	株式	第一生命保険	保険業	369,000	1,428.00	526,932,000	1,500.00	553,500,000	0.97
28	日本	株式	T&Dホールディングス	保険業	443,600	1,196.00	530,545,600	1,227.00	544,297,200	0.95
29	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	374,000	1,303.00	487,322,000	1,430.00	534,820,000	0.94
30	日本	株式	アマダ	機械	717,000	719.00	515,523,000	726.00	520,542,000	0.91

## 種類別及び業種別投資比率

(2014年3月31日現在)

国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
国内	鉱業	0.04
	建設業	2.88
	食料品	4.58
	繊維製品	0.66
	パルプ・紙	0.65
	化学	4.60
	医薬品	6.93
	石油・石炭製品	0.29
	ゴム製品	0.94
	ガラス・土石製品	3.94
	鉄鋼	0.88
	非鉄金属	1.26
	金属製品	0.19
	機械	6.83
	電気機器	9.83
	輸送用機器	10.10
	精密機器	1.23
	その他製品	1.85
	電気・ガス業	1.40
	陸運業	1.68
	海運業	2.42
	空運業	0.76
	情報・通信業	7.19
	卸売業	2.77
	小売業	2.18
	銀行業	9.18
	証券、商品先物取引業	2.81
	保険業	1.92
	その他金融業	2.03
	不動産業	1.78
サービス業	1.93	
合計		95.74

(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  
 (2014年3月31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>  
 (2014年3月31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  
 (2014年3月31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>  
 有価証券先物取引等

(2014年3月31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	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	107	日本円	1,216,590,000	1,287,210,000	1,287,210,000	2.25

(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

2014年3月31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
第16期	(2013年9月20日)	14,116	14,125	0.7819	0.7824
第17期	(2014年3月20日)	11,649	11,657	0.7314	0.7319
	2013年3月末日	12,474	-	0.6614	-
	2013年4月末日	13,851	-	0.7512	-
	2013年5月末日	13,460	-	0.7304	-
	2013年6月末日	13,560	-	0.7325	-
	2013年7月末日	13,297	-	0.7315	-
	2013年8月末日	12,886	-	0.7104	-
	2013年9月末日	13,993	-	0.7711	-
	2013年10月末日	13,898	-	0.7704	-
	2013年11月末日	14,142	-	0.8151	-
	2013年12月末日	13,796	-	0.8433	-
	2014年1月末日	12,702	-	0.7856	-
	2014年2月末日	12,488	-	0.7768	-
	2014年3月末日	12,207	-	0.7689	-

(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
第16期	自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	0.0005
第17期	自 2013年9月21日 至 2014年3月20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
第16期	自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	16.7
第17期	自 2013年9月21日 至 2014年3月20日	6.4

## (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)
第16期	自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	2,050,112,532 (0)	2,814,563,457 (0)	18,053,984,977 (0)
第17期	自 2013年9月21日 至 2014年3月20日	1,306,694,148 (0)	3,432,211,496 (0)	15,928,467,629 (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

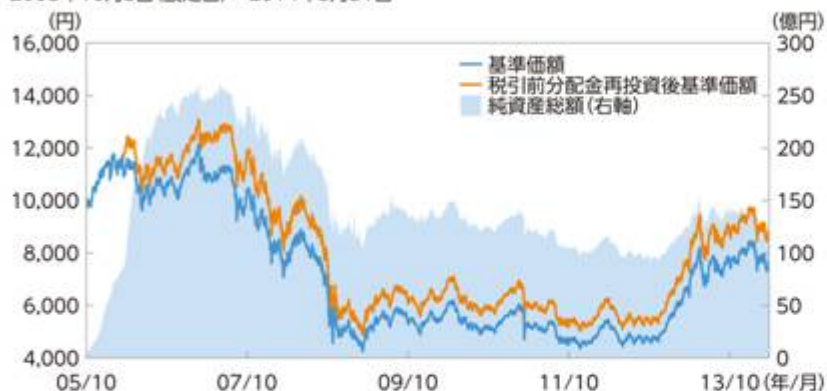
最新の運用実績は委託会社のホームページまたは販売会社でご確認いただけます。

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。

2014年3月31日現在

## 基準価額・純資産の推移

2005年10月3日(設定日)～2014年3月31日



●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。

## 基準価額・純資産総額

基準価額	7,689円
純資産総額	122.1億円

## 期間別騰落率

(税引前分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	-0.95%
3ヵ月	-8.76%
6ヵ月	-0.22%
1年	16.41%
3年	44.51%
5年	63.75%
設定来	-11.23%

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	12/3/21	12/9/20	13/3/21	13/9/20	14/3/20	設定来累計
分配金	5円	5円	5円	5円	5円	1,545円

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

## 主要な資産の状況

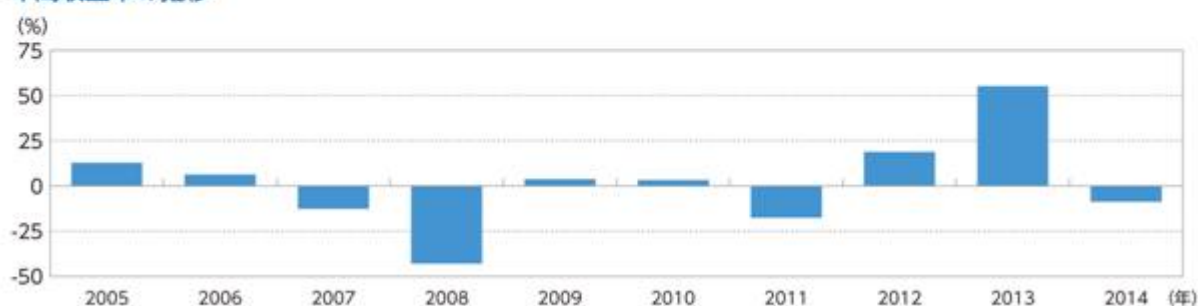
## 組入上位銘柄

	銘柄	市場	業種	比率
1	トヨタ自動車	東証1部	輸送用機器	5.8%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	東証1部	銀行業	3.5%
3	三井住友フィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.9%
4	みずほフィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.6%
5	日本たばこ産業	東証1部	食料品	2.2%
6	ソフトバンク	東証1部	情報・通信業	2.0%
7	野村ホールディングス	東証1部	証券・商品先物取引業	1.7%
8	日本電信電話	東証1部	情報・通信業	1.5%
9	大塚ホールディングス	東証1部	医薬品	1.5%
10	京セラ	東証1部	電気機器	1.4%

## 上位10業種

	業種	比率
1	輸送用機器	10.1%
2	電気機器	9.8%
3	銀行業	9.2%
4	情報・通信業	7.2%
5	医薬品	6.9%
6	機械	6.8%
7	化学	4.6%
8	食料品	4.6%
9	ガラス・土石製品	3.9%
10	建設業	2.9%

## 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。

●2005年は設定日(10月3日)から年末までの騰落率、2014年は1月から3月末までの騰落率を表示しています。

### 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17期計算期間（2013年9月21日から2014年3月20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16期 (2013年9月20日現在)	第17期 (2014年3月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	14,199,101,298	11,730,096,490
未収入金	30,029,824	24,274,803
流動資産合計	14,229,131,122	11,754,371,293
資産合計	14,229,131,122	11,754,371,293
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	9,026,992	7,964,233
未払解約金	30,029,824	24,274,803
未払受託者報酬	3,562,702	3,505,331
未払委託者報酬	67,691,286	66,601,222
その他未払費用	2,677,828	2,302,548
流動負債合計	112,988,632	104,648,137
負債合計	112,988,632	104,648,137
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	18,053,984,977	15,928,467,629
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,937,842,487	4,278,744,473
(分配準備積立金)	745,972,972	643,297,375
元本等合計	14,116,142,490	11,649,723,156
純資産合計	14,116,142,490	11,649,723,156
負債純資産合計	14,229,131,122	11,754,371,293

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期 自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	第17期 自 2013年9月21日 至 2014年3月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,171,375,972	676,457,026
営業収益合計	2,171,375,972	676,457,026
営業費用		
受託者報酬	3,562,702	3,505,331
委託者報酬	67,691,286	66,601,222
その他費用	2,677,828	2,302,548
営業費用合計	73,931,816	72,409,101
営業利益又は営業損失( )	2,097,444,156	748,866,127
経常利益又は経常損失( )	2,097,444,156	748,866,127
当期純利益又は当期純損失( )	2,097,444,156	748,866,127
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( )	191,449,484	64,680,206
期首剰余金又は期首欠損金( )	6,207,259,148	3,937,842,487
剰余金増加額又は欠損金減少額	920,591,530	747,402,147
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	920,591,530	747,402,147
剰余金減少額又は欠損金増加額	548,142,549	266,793,567
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	548,142,549	266,793,567
分配金	9,026,992	7,964,233
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,937,842,487	4,278,744,473

[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16期	第17期
	自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	自 2013年9月21日 至 2014年3月20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 2013年3月20日が休業日のため、当計算期間期首は2013年3月22日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

区分	第16期	第17期
	(2013年9月20日現在)	(2014年3月20日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	18,818,435,902円	18,053,984,977円
期中追加設定元本額	2,050,112,532円	1,306,694,148円
期中一部解約元本額	2,814,563,457円	3,432,211,496円
2. 受益権の総数	18,053,984,977口	15,928,467,629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3,937,842,487円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,278,744,473円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第16期	第17期
	自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	自 2013年9月21日 至 2014年3月20日
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	140,638,785円	41,295,482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	215,840,400円	240,837,826円
分配準備積立金額	614,361,179円	609,966,126円
本ファンドの分配対象収益額	970,840,364円	892,099,434円
本ファンドの期末残存口数	18,053,984,977口	15,928,467,629口
1口当たり収益分配対象額	0.053774円	0.056006円
1口当たり分配金額	0.0005円	0.0005円
収益分配金金額	9,026,992円	7,964,233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16期 自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	第17期 自 2013年9月21日 至 2014年3月20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16期 自 2013年3月22日 至 2013年9月20日	第17期 自 2013年9月21日 至 2014年3月20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16期 (2013年9月20日現在)	第17期 (2014年3月20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	2,026,252,192	689,661,282
合計	2,026,252,192	689,661,282

## (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16期 (2013年9月20日現在)	第17期 (2014年3月20日現在)
1口当たり純資産額	0.7819円	0.7314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	9,474,272,264	11,730,096,490	
合計			9,474,272,264	11,730,096,490	

## 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	(2013年9月20日現在)	(2014年3月20日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		-	86,754
コール・ローン		2,233,120,398	1,784,461,407
株式		71,494,792,000	52,599,491,600
派生商品評価勘定		34,715,000	-
未収入金		-	603,845,032
未収配当金		21,529,100	38,482,200
未収利息		3,139	2,454
差入委託証拠金		91,271,448	66,256,131
流動資産合計		73,875,431,085	55,092,625,578
資産合計		73,875,431,085	55,092,625,578
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	27,114,999
未払金		-	621,454,758
未払解約金		30,029,824	24,274,803
流動負債合計		30,029,824	672,844,560
負債合計		30,029,824	672,844,560
純資産の部			
元本等			
元本		56,156,803,444	43,955,294,715
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		17,688,597,817	10,464,486,303
元本等合計		73,845,401,261	54,419,781,018
純資産合計		73,845,401,261	54,419,781,018
負債純資産合計		73,875,431,085	55,092,625,578

## (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 2013年3月22日 至 2013年9月20日	自 2013年9月21日 至 2014年3月20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	(2013年9月20日現在)	(2014年3月20日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	68,238,885,183円	56,156,803,444円
期中追加設定元本額	2,121,801,225円	4,054,894,780円
期中一部解約元本額	14,203,882,964円	16,256,403,509円
期末元本額	56,156,803,444円	43,955,294,715円
元本の内訳		
GS日本株式インデックス・プラス	10,797,795,664円	9,474,272,264円
GS日本株計量運用ポートフォリオ2(適格機関投資家専用)	1,990,397,655円	-円
GSグローバル・バランス・ファンド2(適格機関投資家専用)	6,502,969,835円	6,456,078,062円
GSグローバル・ダイバーシファイドVA(適格機関投資家専用)	470,865,661円	454,480,394円
VAインデックス・プラスGS日本株計量運用ポートフォリオ	36,394,774,629円	27,570,463,995円
2. 受益権の総数	56,156,803,444口	43,955,294,715口

## （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 2013年 3月22日 至 2013年 9月20日	自 2013年 9月21日 至 2014年 3月20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おります。</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

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	自 2013年 3月22日 至 2013年 9月20日	自 2013年 9月21日 至 2014年 3月20日
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明</p>	<p>金融商品は時価で計上しているため記載を省略しております。</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>(2) 有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(3) デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」の「取引の時価等に関する事項」に記載しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額、又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>同左</p> <p>(1) 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> <p>(2) 有価証券 同左</p> <p>(3) デリバティブ取引 同左</p> <p>同左</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	(2013年9月20日現在)	(2014年3月20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	7,368,749,129	823,909,939
合計	7,368,749,129	823,909,939

(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	(2013年9月20日現在)				(2014年3月20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	1,551,040,000	-	1,585,755,000	34,715,000	1,243,704,999	-	1,216,590,000	27,114,999
	合計	1,551,040,000	-	1,585,755,000	34,715,000	1,243,704,999	-	1,216,590,000	27,114,999

## (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	(2013年9月20日現在)	(2014年3月20日現在)
1口当たり純資産額	1.3150円	1.2381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)	
石油資源開発	6,800	3,355.00	22,814,000	
東建コーポレーション	11,560	4,110.00	47,511,600	
大東建託	51,100	9,520.00	486,472,000	
NIPPPO	185,000	1,356.00	250,860,000	
前田道路	77,000	1,413.00	108,801,000	
大和ハウス工業	272,000	1,743.00	474,096,000	
ライト工業	99,800	870.00	86,826,000	
きんでん	19,000	974.00	18,506,000	
日揮	37,000	3,463.00	128,131,000	
カルビー	135,500	2,278.00	308,669,000	
日本ハム	159,000	1,549.00	246,291,000	
麒麟ホールディングス	374,000	1,303.00	487,322,000	
コカ・コーラウエスト	15,200	1,701.00	25,855,200	
東洋水産	21,000	3,165.00	66,465,000	
日本たばこ産業	391,300	3,030.00	1,185,639,000	
わらべや日洋	34,000	1,793.00	60,962,000	
日清紡ホールディングス	425,000	839.00	356,575,000	
日本製紙	191,200	1,954.00	373,604,800	
トクヤマ	238,000	326.00	77,588,000	
東亜合成	221,000	401.00	88,621,000	
堺化学工業	268,000	293.00	78,524,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,048,000	429.00	449,592,000	
日本合成化学工業	59,000	735.00	43,365,000	
積水化学工業	297,000	1,074.00	318,978,000	
日本ゼオン	256,000	885.00	226,560,000	
DIC	1,058,000	275.00	290,950,000	
東洋インキS Cホールディングス	137,000	437.00	59,869,000	
富士フイルムホールディングス	238,500	2,647.00	631,309,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	71,300	3,755.00	267,731,500	
協和発酵キリン	37,000	1,006.00	37,222,000	
武田薬品工業	160,600	4,871.00	782,282,600	



銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
塩野義製薬	305,200	1,906.00	581,711,200	
久光製薬	37,900	4,195.00	158,990,500	
参天製薬	81,100	4,475.00	362,922,500	
ツムラ	14,800	2,506.00	37,088,800	
沢井製薬	6,000	6,280.00	37,680,000	
第一三共	436,000	1,645.00	717,220,000	
キョーリン製薬ホールディングス	179,200	2,048.00	367,001,600	
大塚ホールディングス	270,500	2,999.00	811,229,500	
大正製薬ホールディングス	5,200	7,400.00	38,480,000	
出光興産	77,500	2,023.00	156,782,500	
東洋ゴム工業	464,000	704.00	326,656,000	
ブリヂストン	17,700	3,503.00	62,003,100	
住友ゴム工業	66,600	1,298.00	86,446,800	
三ツ星ベルト	81,000	525.00	42,525,000	
旭硝子	1,137,000	545.00	619,665,000	
日本電気硝子	1,151,000	468.00	538,668,000	
太平洋セメント	1,698,000	357.00	606,186,000	
TOTO	231,000	1,302.00	300,762,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	131,600	1,863.00	245,170,800	
大阪製鐵	25,600	1,760.00	45,056,000	
東洋鋼鈹	83,000	448.00	37,184,000	
山陽特殊製鋼	126,000	387.00	48,762,000	
日立金属	56,000	1,363.00	76,328,000	
住友電気工業	122,400	1,433.00	175,399,200	
フジクラ	805,000	435.00	350,175,000	
リョービ	413,000	306.00	126,378,000	
東プレ	24,100	1,105.00	26,630,500	
高周波熱錬	36,900	656.00	24,206,400	
日本発條	62,100	967.00	60,050,700	
日本製鋼所	61,000	432.00	26,352,000	
東芝機械	281,000	478.00	134,318,000	
アマダ	717,000	719.00	515,523,000	
D M G 森精機	24,800	1,337.00	33,157,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
三井海洋開発	21,800	2,391.00	52,123,800	
住友重機械工業	1,365,000	419.00	571,935,000	
クボタ	256,000	1,311.00	335,616,000	
新東工業	45,200	706.00	31,911,200	
小森コーポレーション	15,400	1,329.00	20,466,600	
ダイキン工業	86,100	5,203.00	447,978,300	
椿本チエイン	208,000	799.00	166,192,000	
C K D	77,800	950.00	73,910,000	
グローリー	107,100	2,723.00	291,633,300	
大和冷機工業	33,000	630.00	20,790,000	
日本ピストンリング	157,000	173.00	27,161,000	
日本精工	382,000	1,028.00	392,696,000	
NTN	694,000	350.00	242,900,000	
ジェイテクト	113,200	1,508.00	170,705,600	
THK	98,100	2,130.00	208,953,000	
三菱重工業	253,000	571.00	144,463,000	
イビデン	54,400	1,899.00	103,305,600	
コニカミノルタ	189,500	940.00	178,130,000	
ブラザー工業	158,200	1,311.00	207,400,200	
三菱電機	119,000	1,115.00	132,685,000	
富士電機	607,000	430.00	261,010,000	
ダイヘン	47,000	387.00	18,189,000	
日本電気	837,000	298.00	249,426,000	
富士通	938,000	575.00	539,350,000	
沖電気工業	1,162,000	215.00	249,830,000	
セイコーエプソン	121,000	2,957.00	357,797,000	
シャープ	1,243,000	281.00	349,283,000	
富士通ゼネラル	171,000	957.00	163,647,000	
日立国際電気	127,000	1,128.00	143,256,000	
ソニー	360,900	1,757.00	634,101,300	
T D K	42,900	4,190.00	179,751,000	
パイオニア	401,500	208.00	83,512,000	
ローランド ディー . ジー .	6,100	3,410.00	20,801,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
フォスター電機	23,200	1,325.00	30,740,000	
日本航空電子工業	13,000	1,523.00	19,799,000	
新電元工業	90,000	447.00	40,230,000	
メガチップス	37,300	1,188.00	44,312,400	
ウシオ電機	98,900	1,274.00	125,998,600	
カシオ計算機	65,700	1,138.00	74,766,600	
新光電気工業	347,200	699.00	242,692,800	
京セラ	177,600	4,415.00	784,104,000	
ニチコン	89,600	818.00	73,292,800	
日本ケミコン	421,000	291.00	122,511,000	
大日本スクリーン製造	71,000	467.00	33,157,000	
トヨタ紡織	43,200	1,005.00	43,416,000	
東海理化電機製作所	72,100	1,721.00	124,084,100	
トヨタ自動車	570,100	5,425.00	3,092,792,500	
カヤバ工業	302,000	444.00	134,088,000	
大同メタル工業	51,000	915.00	46,665,000	
ケーヒン	41,800	1,459.00	60,986,200	
アイシン精機	50,700	3,395.00	172,126,500	
マツダ	1,565,000	441.00	690,165,000	
本田技研工業	61,500	3,536.00	217,464,000	
富士重工業	146,300	2,615.00	382,574,500	
ショーワ	59,300	1,182.00	70,092,600	
豊田合成	139,600	1,903.00	265,658,800	
テイ・エス テック	32,100	3,020.00	96,942,000	
テルモ	5,100	4,475.00	22,822,500	
ニコン	14,400	1,661.00	23,918,400	
シチズンホールディングス	632,800	781.00	494,216,800	
凸版印刷	132,000	690.00	91,080,000	
大日本印刷	598,000	930.00	556,140,000	
ヤマハ	91,100	1,306.00	118,976,600	
ビジョン	26,900	4,385.00	117,956,500	
イトーキ	94,600	584.00	55,246,400	
東京電力	348,600	376.00	131,073,600	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
中部電力	133,700	1,128.00	150,813,600	
関西電力	162,400	1,012.00	164,348,800	
中国電力	31,300	1,357.00	42,474,100	
北陸電力	13,600	1,252.00	17,027,200	
東北電力	61,800	1,039.00	64,210,200	
四国電力	13,100	1,388.00	18,182,800	
九州電力	74,100	1,225.00	90,772,500	
沖縄電力	10,400	3,420.00	35,568,000	
電源開発	16,800	2,942.00	49,425,600	
東海旅客鉄道	10,000	11,010.00	110,100,000	
日本通運	813,000	489.00	397,557,000	
日本梱包運輸倉庫	123,100	1,788.00	220,102,800	
セイノーホールディングス	208,000	999.00	207,792,000	
日本郵船	474,000	288.00	136,512,000	
商船三井	1,479,000	382.00	564,978,000	
川崎汽船	2,714,000	208.00	564,512,000	
N S ユナイテッド海運	94,000	232.00	21,808,000	
日本航空	84,000	4,845.00	406,980,000	
I T ホールディングス	117,100	1,722.00	201,646,200	
グリー	85,300	1,030.00	87,859,000	
ネクソン	114,100	792.00	90,367,200	
トレンドマイクロ	7,000	3,145.00	22,015,000	
大塚商会	7,500	12,530.00	93,975,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	13,400	1,654.00	22,163,600	
日本テレビホールディングス	156,600	1,580.00	247,428,000	
テレビ朝日	15,500	1,854.00	28,737,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	45,900	498.00	22,858,200	
日本電信電話	153,700	5,619.00	863,640,300	
K D D I	80,900	5,741.00	464,446,900	
N T T ドコモ	192,500	1,549.00	298,182,500	
G M O インターネット	324,100	1,022.00	331,230,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	13,300	2,021.00	26,879,300	
カプコン	38,900	1,808.00	70,331,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
TKC	13,900	1,795.00	24,950,500	
ソフトバンク	145,400	8,212.00	1,194,024,800	
伊藤忠食品	8,500	3,555.00	30,217,500	
アルフレッサホールディングス	16,600	5,920.00	98,272,000	
伊藤忠商事	358,800	1,204.00	431,995,200	
三井物産	15,500	1,422.00	22,041,000	
住友商事	484,200	1,273.00	616,386,600	
サンリオ	28,100	3,460.00	97,226,000	
オートバックスセブン	84,900	1,558.00	132,274,200	
ミスミグループ本社	6,200	2,659.00	16,485,800	
カワチ薬品	45,900	1,836.00	84,272,400	
ゲオホールディングス	57,100	936.00	53,445,600	
ドトール・日レスホールディングス	62,800	1,653.00	103,808,400	
マツモトキヨシホールディングス	24,200	3,185.00	77,077,000	
スタートトゥデイ	235,100	2,600.00	611,260,000	
ゼンショーホールディングス	46,900	997.00	46,759,300	
青山商事	82,100	2,662.00	218,550,200	
吉野家ホールディングス	14,000	1,256.00	17,584,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,567,900	546.00	1,948,073,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	522,000	434.00	226,548,000	
三井住友フィナンシャルグループ	371,400	4,220.00	1,567,308,000	
みずほフィナンシャルグループ	7,183,100	201.00	1,443,803,100	
大和証券グループ本社	566,000	869.00	491,854,000	
野村ホールディングス	1,484,500	641.00	951,564,500	
水戸証券	252,000	414.00	104,328,000	
第一生命保険	369,000	1,428.00	526,932,000	
T&Dホールディングス	443,600	1,196.00	530,545,600	
芙蓉総合リース	35,800	3,555.00	127,269,000	
興銀リース	22,800	2,568.00	58,550,400	
東京センチュリーリース	46,200	2,812.00	129,914,400	
日立キャピタル	7,500	2,387.00	17,902,500	
オリックス	558,900	1,399.00	781,901,100	
野村不動産ホールディングス	218,800	1,954.00	427,535,200	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価（円）	金額（円）	
東急不動産ホールディングス	529,800	730.00	386,754,000	
平和不動産	35,600	1,507.00	53,649,200	
住友不動産	21,000	3,914.00	82,194,000	
イオンモール	22,400	2,447.00	54,812,800	
アコーディア・ゴルフ	308,600	1,289.00	397,785,400	
カカクコム	283,000	1,712.00	484,496,000	
ディー・エヌ・エー	13,200	1,884.00	24,868,800	
博報堂D Yホールディングス	53,800	713.00	38,359,400	
リゾートトラスト	43,600	1,601.00	69,803,600	
楽天	97,500	1,287.00	125,482,500	
合計			52,599,491,600	

(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

(2014年3月31日現在)

資産総額	12,229,842,502円
負債総額	22,357,396円
純資産総額( - )	12,207,485,106円
発行済口数	15,876,951,323口
1口当たり純資産額( / )	0.7689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>

(2014年3月31日現在)

資産総額	57,147,343,568円
負債総額	23,315,408円
純資産総額( - )	57,124,028,160円
発行済口数	43,875,505,940口
1口当たり純資産額( / )	1.3020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

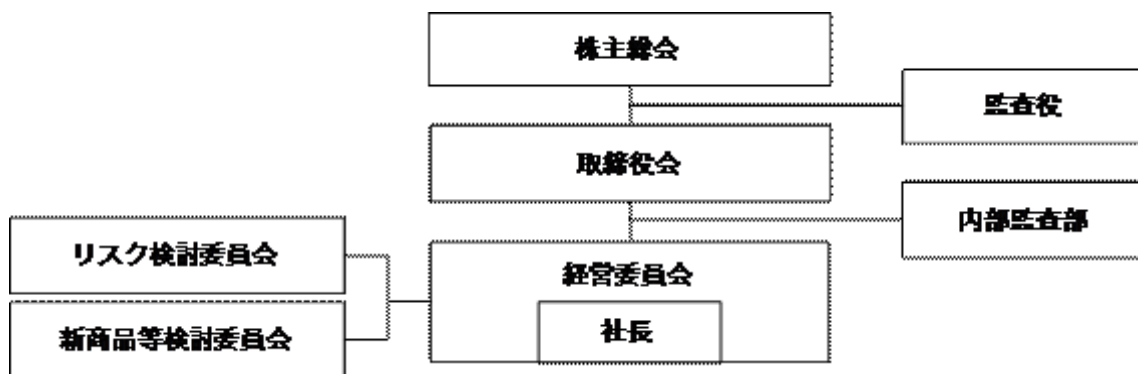
発行する株式の総数：8,000株

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。取締役会は、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。

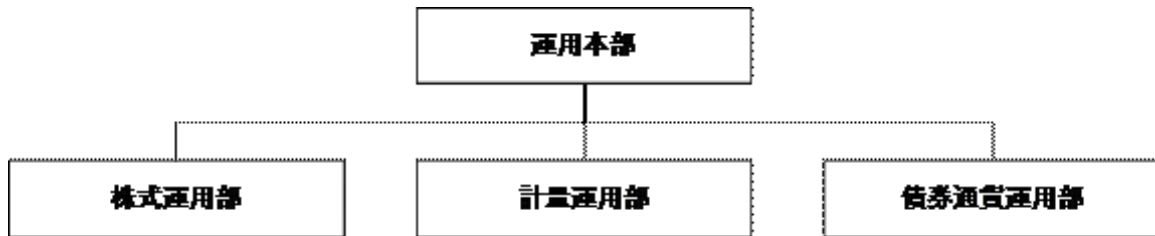
新商品等検討委員会は、経営委員会の監督の下に、新商品等検討委員会規則に基づき、新商品、投資信託の分配方針等に関する正式な検討プロセスを維持することに責任を持ちます。

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、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

2014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	99	1,491,475,942,763
合計	99	1,491,475,942,763

[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18期事業年度（平成24年4月1日から平成25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19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25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			3,285,446			3,799,436	
有価証券			11,797,976			10,197,717	
支払委託金			25			51	
収益分配金		25			51		
前払費用			468			-	
未収入金	* 1		406,284			-	
未収委託者報酬			1,064,467			1,349,584	
未収運用受託報酬			1,026,201			1,052,020	
未収収益			159,925			250,263	
立替金			34,566			58,689	
繰延税金資産			489,782			655,118	
流動資産計			18,265,146	90.9		17,362,882	78.5
固定資産							
無形固定資産			694			-	
その他の無形固定資産		694			-		
投資その他の資産			1,830,583			4,744,062	
投資有価証券		684,540			3,515,336		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,135,876			1,218,726		
その他の投資等		166			-		
固定資産計			1,831,278	9.1		4,744,062	21.5
資産合計			20,096,424	100.0		22,106,945	100.0

期別		第17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25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			82			296	
未払金			853,668			533,934	
未払収益分配金		151			177		
未払償還金		72			72		
未払手数料		447,157			533,685		
その他未払金		406,287			-		
未払費用			1,998,271			2,373,586	
未払法人税等			190,726			678,381	
未払消費税等			30,533			99,850	
流動負債計			3,073,282	15.3		3,686,048	16.7
固定負債							
長期未払費用			2,945,495			3,835,760	
役員退職慰労引当金			222,911			222,911	
その他固定負債			650			650	
固定負債計			3,169,057	15.8		4,059,322	18.4
負債合計			6,242,339	31.1		7,745,371	35.0

期別		第17期 (平成24年3月31日現在)			第18期 (平成25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			12,921,678			13,224,106	
その他利益剰余金		12,921,678			13,224,106		
繰越利益剰余金		12,921,678			13,224,106		
株主資本合計			13,801,678	68.7		14,104,106	63.8
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		52,406			257,467		
評価・換算差額等合計			52,406	0.3		257,467	1.2
純資産合計			13,854,085	68.9		14,361,574	65.0
負債・純資産合計			20,096,424	100.0		22,106,945	100.0

## (2) 損益計算書

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25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			9,262,739			10,394,695	
運用受託報酬			5,636,349			5,903,536	
その他営業収益	* 2		5,514,145			5,346,245	
営業収益計			20,413,234	100.0		21,644,477	100.0
営業費用							
支払手数料			4,702,587			4,828,407	
広告宣伝費			165,456			356,368	
調査費			4,318,795			4,843,198	
委託調査費	* 2	4,318,795			4,843,198		
委託計算費			163,984			187,048	
営業雑経費			365,639			412,224	
通信費		212,981			254,451		
印刷費		130,935			128,462		
協会費		21,722			29,310		
営業費用計			9,716,463	47.6		10,627,248	49.1
一般管理費							
給料			5,308,793			6,758,363	
役員報酬		163,438			178,109		
給料・手当		2,866,902			2,621,391		
賞与		488,900			1,291,499		
株式従業員報酬	* 1	199,573			807,717		
その他の報酬		1,589,978			1,859,646		
交際費			26,547			38,921	
寄付金			92,237			19,338	
旅費交通費			204,386			167,344	
租税公課			60,314			49,118	
不動産賃借料			458,251			482,119	
退職給付費用			635,720			843,772	
固定資産減価償却費			24,336			-	
事務委託費			386,181			457,831	
諸経費			1,284,675			1,084,126	
一般管理費計			8,481,445	41.5		9,900,937	45.7
営業利益			2,215,325	10.9		1,116,291	5.2

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日			
		科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額
経常損益の部	営業外収益							
	収益分配金				-		68,834	
	受取利息				21,224		16,255	
	投資有価証券売却益				77,795		-	
	株式従業員報酬	* 1,2			251,012		-	
	為替差益				-		14,373	
	雑益				2,903		52	
	営業外収益計				352,935	1.7	99,515	0.5
	営業外費用							
	支払利息				0		26	
	株式従業員報酬	* 1			-		257,196	
	為替差損				22,648		-	
	雑損				0		-	
営業外費用計				22,649	0.1	257,223	1.2	
経常利益					2,545,612	12.5	958,583	4.4

期別		第17期 自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日			第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25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				2,545,613	12.5		958,583	4.4
法人税、住民税及び事業税				731,215	3.6		1,030,076	4.8
法人税等調整額				452,629	2.2		373,921	1.7
当期純利益				1,361,767	6.7		302,428	1.4



## (3) 株主資本等変動計算書

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

第18期  
(自平成24年4月1日 至平成25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24年4月1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
事業年度中の変動額									
当期純利益				302,428	302,428	302,428			302,428
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							205,061	205,061	205,061
事業年度中の変動額合計	-	-	-	302,428	302,428	302,428	205,061	205,061	507,489
平成25年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	13,224,106	13,224,106	14,104,106	257,467	257,467	14,361,574

## 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</p> <p>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</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員退職慰労引当金</p> <p>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</p> <p>貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(3) 金融商品取引責任準備金</p> <p>金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注記事項

(貸借対照表関係)

第17期 (平成24年3月31日現在)	第18期 (平成25年3月31日現在)
* 1 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には次のものがあります。  流動資産 未収入金 404,033千円	* 1 関係会社項目 該当事項はありません。

(損益計算書関係)

第17期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第18期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。  * 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。  営業収益 その他営業収益 5,452,985千円 営業費用 委託調査費 4,318,795千円 営業外収益 株式従業員報酬 56,181千円	* 1 株式従業員報酬 同左  * 2 関係会社項目 同左  営業収益 その他営業収益 5,294,986千円 営業費用 委託調査費 4,843,198千円

## （株主資本等変動計算書関係）

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	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

第18期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

該当事項はありません。

## （リース取引関係）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25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ます。当社は、効率的なリスク管理が極めて重要であると考えており、職務の分掌と経営陣による監督は、当社リスク管理手続の重要な要素であります。

信用リスク

信用リスクとしては主に、当社が保有する預金に係る銀行の信用リスク、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

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

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

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

市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内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			
その他有価証券	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						
その他有価証券の 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	-	-	-	-	-

第18期  
（自 平成24年4月1日  
至 平成25年3月31日）

#### (1) 金融商品の状況に関する事項

##### 金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業、投資助言・代理業を含む金融商品取引法により金融商品取引業者が行うことができる業務、及びこれに付帯関連する業務を行っております。これらの業務に関連し、当社は、主に現金・預金、コマーシャル・ペーパー、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び投資有価証券といった金融資産を保有しております。なお、当社は、資金運用については短期的な預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定する方針です。投資有価証券は事業推進目的のために保有する当社設定の投資信託であります。

##### 金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

##### 信用リスク

信用リスクとしては主に、当社が保有する預金に係る銀行の信用リスク、保有するコマーシャル・ペーパーに係る発行体の信用リスク、当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬に関して、運用資産が悪化した場合に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できず、当社が損失を被るリスクがあります。

当社は、預金に係る銀行の信用リスクに関しては、口座開設時、およびその後継続的に銀行の信用力を評価し、また各銀行に預け入れる金額に上限を設けることにより、預金に係る信用リスクを管理しております。コマーシャル・ペーパーに関しましては、主にゴールドマン・サックスのグループ会社が発行するものとし、定期的に見直すことによって信用リスクを管理しております。

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

##### 市場リスク

当社は、海外の関連会社との取引により生じた外国通貨建て資産負債を保有していることから、為替相場の変動によるリスクに晒されております。当社は為替リスクを管理するため、外貨建資産負債の純額が予め社内で設定した水準を越える場合、当該通貨の売買を行い、為替リスクを削減しております。また、当社は事業推進目的のために当社設定の投資有価証券を保有していることから、基準価額の変動による価格変動リスクに晒されております。係る投資有価証券については運用を行う資産の種類を文書に定め、取得にあたり事前に社内委員会にて検討・承認をし、保有の目的が達成されたと判断された時点で適時処分しております。

##### 流動性および資金調達リスク

当社は総資産の60%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18期  
（自 平成24年4月1日  
至 平成25年3月31日）

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成25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	3,799,436	3,799,436	-
有価証券			
その他有価証券	10,197,717	10,197,717	-
未収委託者報酬	1,349,584	1,349,584	-
未収運用受託報酬	1,052,020	1,052,020	-
投資有価証券			
その他投資有価証券	3,515,336	3,515,336	-

## 金融商品の時価の算定方法

現金・預金、有価証券、未収委託者報酬及び未収運用受託報酬については、短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。投資有価証券については、投資信託であり、直近の基準価額によっております。

## 金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	3,799,436	-	-	-	-	-
有価証券						
その他有価証券の うち満期があるもの	10,200,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,349,584	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,052,020	-	-	-	-	-



## （有価証券関係）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）					第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25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	600,000	684,540	84,540	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,100,000	3,515,336	415,336
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	-	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	10,197,717	10,197,717	-
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）		
1,095,821	77,795	-			1,900,000	-	-		

## （デリバティブ取引関係）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25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17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、退職給付制度を採用しておりません。</p> <p>2. 退職給付費用に関する事項</p> <p>損益計算書上、出向者負担金等に含まれる退職給付費用負担金相当額を、退職給付費用として計上しております。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付費用に関する事項</p> <p>同左</p>

## （税効果会計関係）

第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）	第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25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 456,569千円</p> <p>未払事業税 15,881</p> <p>その他 17,331</p> <p style="text-align: right;">小計 489,782</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p>繰延税金資産（流動資産）の純額 489,782</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,033,933</p> <p>役員退職慰労引当金 81,558</p> <p>その他 52,518</p> <p style="text-align: right;">小計 1,168,010</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 32,133</p> <p style="text-align: right;">小計 32,133</p> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額 1,135,876千円</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 592,366千円</p> <p>未払事業税 54,579</p> <p>その他 8,172</p> <p style="text-align: right;">小計 655,118</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p>繰延税金資産（流動資産）の純額 655,118</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,239,518</p> <p>役員退職慰労引当金 80,193</p> <p>その他 56,884</p> <p style="text-align: right;">小計 1,376,595</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 157,869</p> <p style="text-align: right;">小計 157,869</p> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額 1,218,726千円</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>法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正 6.24 %</p> <p>その他 - 0.42 %</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 46.51 %</p>	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 38.01 %</p> <p>（調整）</p> <p>賞与等永久に損金に算入されない項目 26.89 %</p> <p>その他 3.55 %</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 68.45 %</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 style="text-align: center;">第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）</p>
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「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</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のその内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>

## 〔セグメント情報等〕

第17期（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	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。

第18期（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	10,394,695	5,903,536	5,346,245	21,644,477

## 2．地域ごとの情報

## (1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
19,592,948	2,051,528	21,644,477

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 株式会社	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、グループ会社間の契約に基づき、決定しております。

（注2）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス株式会社（以下GSJH）より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はGSJHより行われております。

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

## 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）

第18期  
（自 平成24年4月1日  
至 平成25年3月31日）

## 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国ニューヨーク州	293 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 委託調査費の支払（注1）	5,294,986 4,843,198		

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

## 役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

## 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任 有価証券の購入	兼務従業員の 人件費等の支払（注1）	2,408,126	有価証券 未払費用	10,197,717 309,903
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 有限公司	東京都港区	100 百万円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託		従業員出向受入等 役員の兼任	出向者に関する人件費等の負担金（注2） 営業費用及び一般管理費 株式従業員報酬	6,694,581 230,495	未払費用 長期未払費用	1,335,190 3,706,199
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	20,667 百万ドル	銀行業		現金の預入			現金・預金	579,001

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）



## （1株当たり情報）

第17期 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）		第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	
1株当たり純資産額	2,164,700円82銭	1株当たり純資産額	2,243,995円98銭
1株当たり当期純利益金額	212,776円18銭	1株当たり当期純利益金額	47,254円38銭
損益計算書上の当期純利益	1,361,767千円	損益計算書上の当期純利益	302,428千円
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	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	302,428千円
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19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		4,017,996	
有価証券		11,897,460	
支払委託金		25	
前払費用		2,681	
未収委託者報酬		1,795,741	
未収運用受託報酬		1,411,305	
未収収益		229,350	
立替金		65,962	
繰延税金資産		906,196	
流動資産計		20,326,721	79.6
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		3,950,673	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,245,484	
投資その他の資産計		5,206,158	
固定資産計		5,206,158	20.4
資産合計		25,532,880	100.0

区分	注記 番号	第19期中間会計期間末 (平成25年9月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		498	
未払金		579,578	
未払費用		2,956,225	
未払法人税等		1,410,557	
その他	* 1	113,288	
流動負債計		5,060,149	19.8
固定負債			
長期未払費用		4,438,407	
役員退職慰労引当金		174,176	
その他固定負債		650	
固定負債計		4,613,234	18.1
負債合計		9,673,383	37.9

区分	注記 番号	第19期中間会計期間末 (平成25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		14,607,139	
利益剰余金合計		14,607,139	
株主資本合計		15,487,139	60.7
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		372,357	
評価・換算差額等合計		372,357	
純資産合計		15,859,497	62.1
負債・純資産合計		25,532,880	100.0

## (2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第19期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		7,227,277	
運用受託報酬		3,467,808	
その他営業収益		3,097,839	
営業収益計		13,792,926	100.0
営業費用及び一般管理費		11,316,062	82.0
営業利益		2,476,863	18.0
営業外収益	* 1	71,494	0.5
営業外費用	* 2	126,262	0.9
経常利益		2,422,094	17.6
税引前中間純利益		2,422,094	17.6
法人税、住民税及び事業税		1,387,345	10.1
法人税等調整額		348,283	2.5
中間純利益		1,383,032	10.0

## 重要な会計方針

項目	第19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>時価をもって中間貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 役員退職慰労引当金</p> <p>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未要支給見積額を計上しております。</p> <p>(2) 貸倒引当金</p> <p>貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(3) 金融商品取引責任準備金</p> <p>金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限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</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注記事項

( 中間貸借対照表関係 )

項目	第19期中間会計期間末 (平成25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19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
* 1 営業外収益のうち主要なもの	有価証券分配金	62,253千円
	受取利息	8,389千円
* 2 営業外費用のうち主要なもの	株式従業員報酬	103,912千円
	為替差損	22,350千円



## （リース取引関係）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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	4,017,996	4,017,996	-
有価証券			
その他有価証券	11,897,460	11,897,460	-
未収委託者報酬	1,795,741	1,795,741	-
未収運用受託報酬	1,411,305	1,411,305	-
投資有価証券			
その他有価証券	3,950,673	3,950,673	-

## 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19期中間会計期間末（平成25年9月30日）

その他有価証券で時価のあるもの

（単位：千円）

区分	種類	取得原価	中間貸借対照表計上額	差額
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	3,310,000	3,910,673	600,673
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	40,000	40,000	-
	コマーシャル・ペーパー	11,897,460	11,897,460	-

## （デリバティブ取引関係）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25年9月30日）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1．製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ ファンド関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	7,227,277	3,467,808	3,097,839	13,792,926

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
12,228,537	1,564,389	13,792,926

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19期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,478,046円41銭
1株当たり中間純利益金額	216,098円84銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載していません。	
（ 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎）	
中間損益計算書上の中間純利益	1,383,032千円
1株当たり中間純利益金額の算定に用いられた普通株式に係る中間純利益	1,383,032千円
差 額	- 千円
期中平均株式数	
普通株式	6,400株

## （ 重要な後発事象）

第19期中間会計期間（自平成25年4月1日 至平成25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26年4月23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25年9月21日から平成26年3月20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26年3月20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25年6月5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25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25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25年4月1日から平成26年3月31日までの第19期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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。