

## 【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27年 6月19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26年12月19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

委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

(中略)

<ご参考> ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)とは

(中略)

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2014年6月末現在、グループ全体で9,923億米ドル(約100.6兆円\*)の資産を運用しています。

\*米ドルの円貨換算は便宜上、2014年6月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=101.36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

委託会社および本ファンドの関係法人の名称および関係業務

(中略)

<ご参考> ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)とは

(中略)

ゴールドマン・サックスの資産運用グループであるゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)は、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2014年12月末現在、グループ全体で1兆239億米ドル(約123.4兆円\*)の資産を運用しています。

\*米ドルの円貨換算は便宜上、2014年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=120.55円)により、計算しております。

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

(後略)

[次へ](#)

## 2 投資方針

### (5) 投資制限

#### < 訂正前 >

本ファンドは、以下の投資制限に従います。

#### (a) 信託約款の「運用の基本方針」に定める投資制限

1. 同一銘柄の株式への実質投資割合は、原則として、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。ただし、ベンチマークにおける同一銘柄の構成比率と同程度の比率となることを目的として、同一銘柄に対し上記割合を超える投資を行うことがあります。
2. 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3. 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
4. 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
5. 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
6. 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
7. 株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
8. デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
9. デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託会社が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

「実質投資割合」とは、投資対象である有価証券につき、本ファンドの信託財産に属する有価証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する有価証券のうち本ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の本ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。

（後略）

#### < 訂正後 >

本ファンドは、以下の投資制限に従います。

#### (a) 信託約款の「運用の基本方針」に定める投資制限

1. 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
2. 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
3. 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
4. 株式以外の資産への実質投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
5. デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
6. デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会規則に従い、委託会社が定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
7. 一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以下とし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会の規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

「実質投資割合」とは、投資対象である有価証券につき、本ファンドの信託財産に属する有価証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する有価証券のうち本ファンドの信託財産に属するとみなした額との合計額の本ファンドの信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。

（後略）

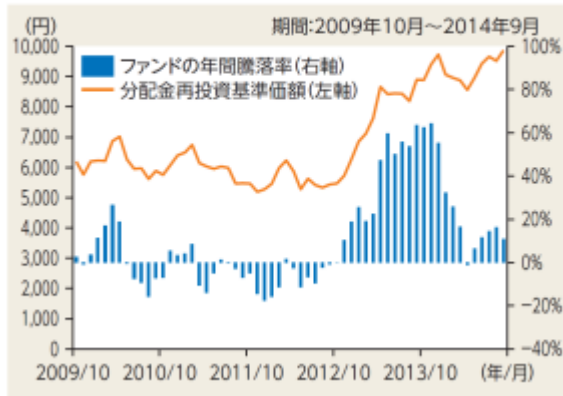
[次へ](#)

### 3 投資リスク

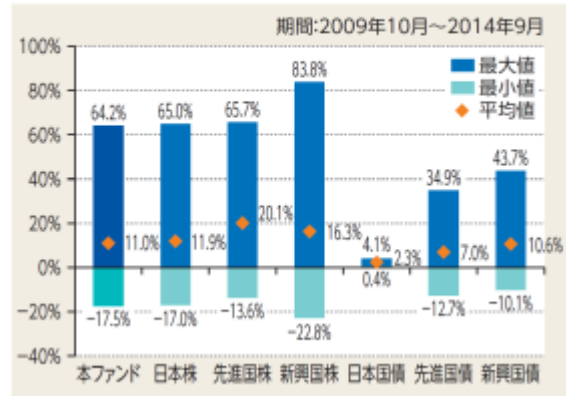
#### (3) 参考情報

< 訂正前 >

本ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移



本ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較(注)

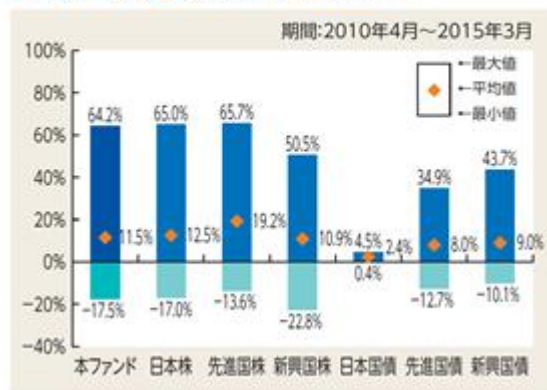


< 訂正後 >

本ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移



本ファンドと他の代表的な  
資産クラスとの騰落率の比較(注)



[次へ](#)

## 4 手数料等及び税金

<訂正前>

(前略)

(4) その他の手数料等

(中略)

(e) その他信託事務の処理等に要する諸費用(監査費用、法律顧問・税務顧問への報酬、印刷費用、郵送費用、公告費用、格付費用等を含みます。)

上記(a)から(d)記載の費用・税金については、ファンドより実費として間接的にご負担いただきますが、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。また、委託会社は、上記(e)記載の諸費用の支払いを信託財産のためにいき、その金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、信託財産の純資産総額の年率0.05%相当額を、かかる諸費用の合計額とみなして本ファンドより受領します。ただし、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、信託の設定時または期中に、随時かかる諸費用の年率を見直し、0.05%を上限としてこれを変更することができます。

(中略)

(5) 課税上の取扱い

(中略)

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。

<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)

収益分配金について上場株式等の配当等として確定申告を行う場合(申告分離課税を選択した場合に限ります。)、上場株式等の譲渡による損失(公募株式投資信託の買取差損・解約(償還)差損を含みます。 )との損益通算が可能です。

法人の受益者に対する課税

(中略)

所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)は課税されません。  
なお、益金不算入制度は適用されません。

<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)

また、買取差損益および解約(償還)差損益を含めて上場株式等の譲渡損が発生した場合は、確定申告を行うことにより、上場株式等の配当等(申告分離課税を選択した場合に限ります。 )との損益通算が可能です。

(後略)

&lt;訂正後&gt;

(前略)

## (4) その他の手数料等

(中略)

- (e) その他信託事務の処理等に要する諸費用（監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、法律顧問・税務顧問への報酬、印刷費用、郵送費用、公告費用、格付費用等を含みます。）

上記(a)から(d)記載の費用・税金については、ファンドより実費として間接的にご負担いただきますが、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。また、委託会社は、上記(e)記載の諸費用の支払いを信託財産のためにいき、その金額をあらかじめ合理的に見積もったうえで、信託財産の純資産総額の年率0.05%相当額を上限として定率で日々計算し、本ファンドより受領します。ただし、委託会社は、信託財産の規模等を考慮して、信託の設定時または期中に、随時かかる諸費用の定率を見直し、0.05%を上限としてこれを変更することができます。

(中略)

## (5) 課税上の取扱い

(中略)

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。

&lt;2016年1月1日以降&gt;

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、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を対象に、以下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。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・20歳以上の方・・・毎年、年間120万円まで

・20歳未満の方・・・毎年、年間80万円まで（2016年4月1日より）

&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)

収益分配金について上場株式等の配当等として確定申告を行う場合（申告分離課税を選択した場合に限りま  
す。）、上場株式等の譲渡による損失(公募株式投資信託の買取差損・解約(償還)差損を含みます。)との損益通  
算が可能です。

&lt;2016年1月1日以降&gt;

収益分配金について上場株式等の配当等として確定申告を行う場合（申告分離課税を選択した場合に限りま  
す。）、他の上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限りま  
す。）および譲渡所得等ならびに特  
定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との損益通算が可能です。

法人の受益者に対する課税

(中略)

所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

&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)

また、買取差損益および解約(償還)差損益を含めて上場株式等の譲渡損が発生した場合は、確定申告を行うこと  
により、上場株式等の配当等(申告分離課税を選択した場合に限りま  
す。)

&lt;2016年1月1日以降&gt;

また、買取差損益および解約(償還)差損益を含めて上場株式等の譲渡損が発生した場合は、確定申告を行うこと  
により、他の上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限りま  
す。）および譲渡所得等ならびに特  
定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得等および譲渡所得等との損益通算が可能です。

（後略）

[次へ](#)



## 5 運用状況

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

## (1) 投資状況

(2015年3月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	11,891,992,641	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,038,100	0.03
合計(純資産総額)		11,887,954,541	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>

(2015年3月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	43,120,318,500	97.37
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,166,449,875	2.63
合計(純資産総額)		44,286,768,375	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

(2015年3月31日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	GS日本株計量運用ポート フォリオ マザーファンド	7,084,470,774	1.7019	12,057,742,641	1.6786	11,891,992,641	100.03

## 種類別及び業種別投資比率

(2015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;

(2015年3月31日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	帳簿価額単価 (円)	帳簿価額金額 (円)	評価額単価 (円)	評価額金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	176,700	8,598.00	1,519,266,600	8,383.00	1,481,276,100	3.34
2	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	237,900	4,869.50	1,158,454,050	4,601.50	1,094,696,850	2.47
3	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	4,232,700	224.70	951,087,690	211.10	893,522,970	2.02
4	日本	株式	パナソニック	電気機器	559,700	1,567.50	877,329,750	1,577.00	882,646,900	1.99
5	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	174,600	5,097.00	889,936,200	5,053.00	882,253,800	1.99
6	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,123,300	790.00	887,407,000	743.70	835,398,210	1.89
7	日本	株式	三菱電機	電気機器	535,000	1,461.50	781,902,500	1,428.50	764,247,500	1.73
8	日本	株式	富士重工業	輸送用機器	185,600	4,038.50	749,545,600	3,991.00	740,729,600	1.67
9	日本	株式	三井物産	卸売業	458,100	1,657.00	759,071,700	1,612.00	738,457,200	1.67
10	日本	株式	オリックス	その他金融業	421,400	1,752.50	738,503,500	1,688.50	711,533,900	1.61
11	日本	株式	三菱重工業	機械	1,062,000	687.70	730,337,400	662.30	703,362,600	1.59
12	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	90,500	7,388.00	668,614,000	7,397.00	669,428,500	1.51
13	日本	株式	大和ハウス工業	建設業	277,700	2,420.50	672,172,850	2,371.00	658,426,700	1.49
14	日本	株式	大和証券グループ本社	証券・商品先物取引業	686,000	987.80	677,630,800	946.00	648,956,000	1.47
15	日本	株式	KDDI	情報・通信業	238,200	2,759.33	657,273,200	2,720.50	648,023,100	1.46
16	日本	株式	第一生命保険	保険業	369,000	1,762.50	650,362,500	1,745.50	644,089,500	1.45
17	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	168,100	3,730.50	627,097,050	3,759.50	631,971,950	1.43
18	日本	株式	第一三共	医薬品	316,900	1,972.50	625,085,250	1,907.00	604,328,300	1.36
19	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	86,000	7,068.00	607,848,000	6,980.00	600,280,000	1.36
20	日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	136,400	4,251.50	579,904,600	4,276.50	583,314,600	1.32
21	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	443,300	1,328.79	589,054,370	1,301.50	576,954,950	1.30
22	日本	株式	ヤマハ発動機	輸送用機器	196,900	2,929.00	576,720,100	2,902.00	571,403,800	1.29
23	日本	株式	大日本印刷	その他製品	476,000	1,235.00	587,860,000	1,168.00	555,968,000	1.26
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	120,800	4,589.00	554,351,200	4,538.50	548,250,800	1.24
25	日本	株式	ローム	電気機器	66,600	8,880.00	591,408,000	8,230.00	548,118,000	1.24
26	日本	株式	日本ハム	食料品	197,000	2,786.00	548,842,000	2,768.00	545,296,000	1.23
27	日本	株式	凸版印刷	その他製品	576,000	934.00	537,984,000	926.00	533,376,000	1.20
28	日本	株式	アマダ	機械	457,800	1,197.00	547,986,600	1,157.00	529,674,600	1.20
29	日本	株式	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	保険業	139,200	3,865.00	538,008,000	3,735.00	519,912,000	1.17
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	262,200	2,000.00	524,400,000	1,967.50	515,878,500	1.16

## 種類別及び業種別投資比率

(2015年3月31日現在)

国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
国内	水産・農林業	0.04
	建設業	2.16
	食料品	2.30
	繊維製品	0.34
	パルプ・紙	0.94
	化学	5.55
	医薬品	6.34
	石油・石炭製品	0.81
	ゴム製品	0.18
	ガラス・土石製品	1.45
	鉄鋼	0.54
	非鉄金属	0.50
	機械	5.24
	電気機器	13.36
	輸送用機器	10.76
	精密機器	1.76
	その他製品	3.81
	電気・ガス業	1.11
	陸運業	2.90
	海運業	1.10
	空運業	0.81
	情報・通信業	8.19
	卸売業	4.32
	小売業	4.71
	銀行業	6.38
	証券、商品先物取引業	3.19
保険業	5.26	
その他金融業	2.99	
サービス業	0.32	
合計		97.37

(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  
 (2015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>  
 (2015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  
 (2015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

(2015年3月31日現在)

資産の種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪証券取引所	東証株価指数先物	買建	22	日本円	343,019,731	339,570,000	0.77

(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

2015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。

期別	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末 (2006年3月20日)	8,210	8,809	1.0964	1.1764
第2計算期間末 (2006年9月20日)	22,535	22,667	1.0226	1.0286
第3計算期間末 (2007年3月20日)	23,466	24,771	1.0789	1.1389
第4計算期間末 (2007年9月20日)	22,366	22,412	0.9715	0.9735
第5計算期間末 (2008年3月21日)	17,867	17,878	0.7530	0.7535
第6計算期間末 (2008年9月22日)	17,040	17,052	0.7187	0.7192
第7計算期間末 (2009年3月23日)	11,650	11,662	0.4802	0.4807
第8計算期間末 (2009年9月24日)	14,077	14,089	0.5721	0.5726
第9計算期間末 (2010年3月23日)	14,118	14,130	0.5760	0.5765
第10計算期間末 (2010年9月21日)	12,537	12,549	0.5199	0.5204
第11計算期間末 (2011年3月22日)	12,338	12,350	0.5298	0.5303
第12計算期間末 (2011年9月20日)	10,459	10,470	0.4653	0.4658
第13計算期間末 (2012年3月21日)	11,432	11,443	0.5353	0.5358
第14計算期間末 (2012年9月20日)	9,714	9,724	0.4759	0.4764
第15計算期間末 (2013年3月21日)	12,611	12,620	0.6702	0.6707
第16計算期間末 (2013年9月20日)	14,116	14,125	0.7819	0.7824
第17計算期間末 (2014年3月20日)	11,649	11,657	0.7314	0.7319
第18計算期間末 (2014年9月22日)	12,551	12,558	0.8554	0.8559
第19計算期間末 (2015年3月20日)	12,178	12,184	0.9944	0.9949
2014年3月末日	12,207	-	0.7689	-
4月末日	11,694	-	0.7415	-
5月末日	12,158	-	0.7765	-
6月末日	12,533	-	0.8167	-
7月末日	12,611	-	0.8367	-
8月末日	12,304	-	0.8247	-
9月末日	12,427	-	0.8543	-
10月末日	12,193	-	0.8451	-
11月末日	12,036	-	0.8952	-
12月末日	11,610	-	0.8914	-
2015年1月末日	11,523	-	0.8918	-

期別	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
2月末日	12,112	-	0.9644	-
3月末日	11,887	-	0.9803	-

(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	期間	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	2005年10月3日～2006年3月20日	0.0800
第2計算期間	2006年3月21日～2006年9月20日	0.0060
第3計算期間	2006年9月21日～2007年3月20日	0.0600
第4計算期間	2007年3月21日～2007年9月20日	0.0020
第5計算期間	2007年9月21日～2008年3月21日	0.0005
第6計算期間	2008年3月22日～2008年9月22日	0.0005
第7計算期間	2008年9月23日～2009年3月23日	0.0005
第8計算期間	2009年3月24日～2009年9月24日	0.0005
第9計算期間	2009年9月25日～2010年3月23日	0.0005
第10計算期間	2010年3月24日～2010年9月21日	0.0005
第11計算期間	2010年9月22日～2011年3月22日	0.0005
第12計算期間	2011年3月23日～2011年9月20日	0.0005
第13計算期間	2011年9月21日～2012年3月21日	0.0005
第14計算期間	2012年3月22日～2012年9月20日	0.0005
第15計算期間	2012年9月21日～2013年3月21日	0.0005
第16計算期間	2013年3月22日～2013年9月20日	0.0005
第17計算期間	2013年9月21日～2014年3月20日	0.0005
第18計算期間	2014年3月21日～2014年9月22日	0.0005
第19計算期間	2014年9月23日～2015年3月20日	0.0005

## 収益率の推移

期	期間	収益率（％）
第1計算期間	2005年10月3日～2006年3月20日	17.6
第2計算期間	2006年3月21日～2006年9月20日	6.2
第3計算期間	2006年9月21日～2007年3月20日	11.4
第4計算期間	2007年3月21日～2007年9月20日	9.8
第5計算期間	2007年9月21日～2008年3月21日	22.4
第6計算期間	2008年3月22日～2008年9月22日	4.5
第7計算期間	2008年9月23日～2009年3月23日	33.1
第8計算期間	2009年3月24日～2009年9月24日	19.2
第9計算期間	2009年9月25日～2010年3月23日	0.8
第10計算期間	2010年3月24日～2010年9月21日	9.7
第11計算期間	2010年9月22日～2011年3月22日	2.0
第12計算期間	2011年3月23日～2011年9月20日	12.1
第13計算期間	2011年9月21日～2012年3月21日	15.2
第14計算期間	2012年3月22日～2012年9月20日	11.0
第15計算期間	2012年9月21日～2013年3月21日	40.9
第16計算期間	2013年3月22日～2013年9月20日	16.7
第17計算期間	2013年9月21日～2014年3月20日	6.4
第18計算期間	2014年3月21日～2014年9月22日	17.0
第19計算期間	2014年9月23日～2015年3月20日	16.3

## (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	期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1計算期間	2005年10月3日～2006年3月20日	7,646,888,852	158,656,531	7,488,232,321
第2計算期間	2006年3月21日～2006年9月20日	15,044,119,859	495,204,431	22,037,147,749
第3計算期間	2006年9月21日～2007年3月20日	3,361,059,645	3,647,886,508	21,750,320,886
第4計算期間	2007年3月21日～2007年9月20日	3,531,266,852	2,259,605,622	23,021,982,116
第5計算期間	2007年9月21日～2008年3月21日	1,588,391,874	882,703,830	23,727,670,160
第6計算期間	2008年3月22日～2008年9月22日	820,237,718	837,745,568	23,710,162,310
第7計算期間	2008年9月23日～2009年3月23日	6,466,556,491	5,914,360,955	24,262,357,846
第8計算期間	2009年3月24日～2009年9月24日	4,595,853,532	4,250,502,181	24,607,709,197
第9計算期間	2009年9月25日～2010年3月23日	2,608,652,487	2,705,357,039	24,511,004,645
第10計算期間	2010年3月24日～2010年9月21日	576,179,662	972,072,259	24,115,112,048
第11計算期間	2010年9月22日～2011年3月22日	592,169,053	1,420,104,780	23,287,176,321
第12計算期間	2011年3月23日～2011年9月20日	552,002,985	1,361,764,931	22,477,414,375
第13計算期間	2011年9月21日～2012年3月21日	479,114,420	1,597,801,075	21,358,727,720
第14計算期間	2012年3月22日～2012年9月20日	454,069,436	1,402,025,367	20,410,771,789
第15計算期間	2012年9月21日～2013年3月21日	869,771,200	2,462,107,087	18,818,435,902
第16計算期間	2013年3月22日～2013年9月20日	2,050,112,532	2,814,563,457	18,053,984,977
第17計算期間	2013年9月21日～2014年3月20日	1,306,694,148	3,432,211,496	15,928,467,629
第18計算期間	2014年3月21日～2014年9月22日	362,551,011	1,617,557,145	14,673,461,495
第19計算期間	2014年9月23日～2015年3月20日	240,927,749	2,667,436,507	12,246,952,737

(注) 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。

2015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)～2015年3月31日



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

## 基準価額・純資産総額

基準価額	9,803円
純資産総額	118.9億円

期間別騰落率  
(分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	1.70%
3ヵ月	10.03%
6ヵ月	14.81%
1年	27.63%
3年	81.86%
5年	64.99%
設定来	13.29%

## 分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	13/3/21	13/9/20	14/3/20	14/9/22	15/3/20	設定来累計
分配金	5円	5円	5円	5円	5円	1,555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

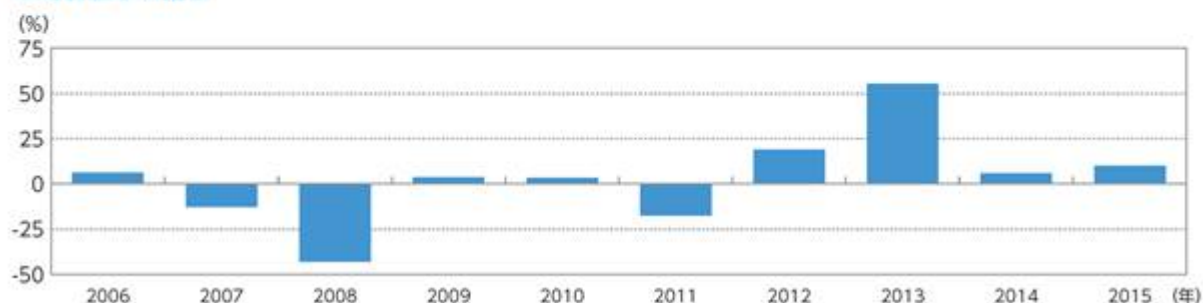
## 組入上位銘柄

	銘柄	市場	業種	比率
1	トヨタ自動車	東証1部	輸送用機器	3.3%
2	三井住友フィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.5%
3	みずほフィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.0%
4	パナソニック	東証1部	電気機器	2.0%
5	セブン&アイ・ホールディングス	東証1部	小売業	2.0%
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	東証1部	銀行業	1.9%
7	三菱電機	東証1部	電気機器	1.7%
8	富士重工	東証1部	輸送用機器	1.7%
9	三井物産	東証1部	卸売業	1.7%
10	オリックス	東証1部	その他金融業	1.6%

## 上位10業種

	業種名	比率
1	電気機器	13.4%
2	輸送用機器	10.8%
3	情報・通信業	8.2%
4	銀行業	6.4%
5	医薬品	6.3%
6	化学	5.6%
7	保険業	5.3%
8	機械	5.2%
9	小売業	4.7%
10	卸売業	4.3%

## 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算出しています。

●2015年は1月から3月末までの騰落率を表示しています。

## 第2【管理及び運営】

### 3 資産管理等の概要

#### (1) 資産の評価

<訂正前>

(前略)

また、原則として、日本経済新聞（朝刊）の「オープン基準価格」欄に、基準価額が掲載されます（略称：「ハイボン」）。年2回（3月および9月）の決算時および償還時に、期中の運用経過のほか信託財産の内容などを記載した運用報告書（交付目論見書を作成している場合は、交付目論見書）を作成し、販売会社を通じてお渡しいたします。

2015年3月の決算時以降に作成される運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

委託会社が設定・運用を行うファンドについては、通常、月次で運用経過について記載したレポートが作成されています。最新のレポートは、販売会社または上記のホームページにおいて入手可能です。

(後略)

<訂正後>

(前略)

また、原則として、日本経済新聞（朝刊）の「オープン基準価格」欄に、基準価額が掲載されます（略称：「ハイボン」）。年2回（3月および9月）の決算時および償還時に、期中の運用経過のほか信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成し、販売会社を通じてお渡しいたします。

運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

委託会社が設定・運用を行うファンドについては、通常、月次で運用経過について記載したレポートが作成されています。最新のレポートは、販売会社または上記のホームページにおいて入手可能です。

(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19期計算期間（2014年9月23日から2015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18期 (2014年9月22日現在)	第19期 (2015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	12,627,339,994	12,249,268,835
未収入金	57,815,802	82,090,329
流動資産合計	12,685,155,796	12,331,359,164
資産合計	12,685,155,796	12,331,359,164
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	7,336,730	6,123,476
未払解約金	57,815,802	82,090,329
未払受託者報酬	3,357,529	3,129,127
未払委託者報酬	63,792,935	59,453,409
その他未払費用	1,749,181	1,823,948
流動負債合計	134,052,177	152,620,289
負債合計	134,052,177	152,620,289
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	14,673,461,495	12,246,952,737
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2,122,357,876	68,213,862
(分配準備積立金)	1,104,213,227	2,602,816,978
元本等合計	12,551,103,619	12,178,738,875
純資産合計	12,551,103,619	12,178,738,875
負債純資産合計	12,685,155,796	12,331,359,164

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 2014年 3月21日 至 2014年 9月22日	第19期 自 2014年 9月23日 至 2015年 3月20日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,994,777,736	1,875,352,784
営業収益合計	1,994,777,736	1,875,352,784
営業費用		
受託者報酬	3,357,529	3,129,127
委託者報酬	63,792,935	59,453,409
その他費用	1,749,181	1,823,948
営業費用合計	68,899,645	64,406,484
営業利益又は営業損失（ ）	1,925,878,091	1,810,946,300
経常利益又は経常損失（ ）	1,925,878,091	1,810,946,300
当期純利益又は当期純損失（ ）	1,925,878,091	1,810,946,300
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（ ）	119,053,831	107,239,306
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	4,278,744,473	2,122,357,876
剰余金増加額又は欠損金減少額	433,680,342	385,922,950
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	433,680,342	385,922,950
剰余金減少額又は欠損金増加額	76,781,275	29,362,454
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	76,781,275	29,362,454
分配金	7,336,730	6,123,476
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,122,357,876	68,213,862

[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18期	第19期
	自 2014年3月21日 至 2014年9月22日	自 2014年9月23日 至 2015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 2014年9月20日及びその翌日が休業日のため、当計算期間末日は2014年9月22日としております。	計算期間の取扱い 2014年9月20日及びその翌日が休業日のため、当計算期間期首は2014年9月23日としております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第18期	第19期
	(2014年9月22日現在)	(2015年3月20日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	15,928,467,629円	14,673,461,495円
期中追加設定元本額	362,551,011円	240,927,749円
期中一部解約元本額	1,617,557,145円	2,667,436,507円
2. 受益権の総数	14,673,461,495口	12,246,952,737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2,122,357,876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68,213,862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18期	第19期
	自 2014年3月21日 至 2014年9月22日	自 2014年9月23日 至 2015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	139,503,262円	103,494,454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	393,197,875円	1,600,212,540円
収益調整金額	236,187,634円	213,918,364円
分配準備積立金額	578,848,820円	905,233,460円
本ファンドの分配対象収益額	1,347,737,591円	2,822,858,818円
本ファンドの期末残存口数	14,673,461,495口	12,246,952,737口
1口当たり収益分配対象額	0.091848円	0.230494円
1口当たり分配金額	0.0005円	0.0005円
収益分配金金額	7,336,730円	6,123,476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18期 自 2014年3月21日 至 2014年9月22日	第19期 自 2014年9月23日 至 2015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18期 自 2014年3月21日 至 2014年9月22日	第19期 自 2014年9月23日 至 2015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18期 (2014年9月22日現在)	第19期 (2015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	1,894,347,999	1,786,167,243
合計	1,894,347,999	1,786,167,243

## (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18期 (2014年9月22日現在)	第19期 (2015年3月20日現在)
1口当たり純資産額	0.8554円	0.9944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	7,196,139,605	12,249,268,835	
合計			7,196,139,605	12,249,268,835	

## 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	(2014年9月22日現在)	(2015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		875,636	422,283
コール・ローン		1,506,795,796	1,144,620,901
株式		54,185,205,520	47,234,494,120
派生商品評価勘定		20,160,585	11,403,137
未収入金		543,196,256	608,949,205
未収配当金		4,571,650	62,299,600
未収利息		1,470	871
差入委託証拠金		21,121,951	29,842,487
流動資産合計		56,281,928,864	49,092,032,604
資産合計		56,281,928,864	49,092,032,604
負債の部			
流動負債			
未払金		542,552,105	415,113,508
未払解約金		57,815,802	82,090,329
流動負債合計		600,367,907	497,203,837
負債合計		600,367,907	497,203,837
純資産の部			
元本等			
元本		38,232,529,273	28,548,221,329
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		17,449,031,684	20,046,607,438
元本等合計		55,681,560,957	48,594,828,767
純資産合計		55,681,560,957	48,594,828,767
負債純資産合計		56,281,928,864	49,092,032,604

## (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 2014年3月21日 至 2014年9月22日	自 2014年9月23日 至 2015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	(2014年9月22日現在)	(2015年3月20日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	43,955,294,715円	38,232,529,273円
期中追加設定元本額	1,084,927,273円	750,791,899円
期中一部解約元本額	6,807,692,715円	10,435,099,843円
期末元本額	38,232,529,273円	28,548,221,329円
元本の内訳		
GS日本株式インデックス・プラス	8,670,241,688円	7,196,139,605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)	2,579,654,988円	2,269,070,196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)	445,240,901円	392,057,300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	26,537,391,696円	18,690,954,228円
2. 受益権の総数	38,232,529,273口	28,548,221,329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 2014年 3月21日 至 2014年 9月22日	自 2014年 9月23日 至 2015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しているか、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 2014年 3月21日 至 2014年 9月22日	自 2014年 9月23日 至 2015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	(2014年9月22日現在)	(2015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	5,832,719,819	7,988,196,647
合計	5,832,719,819	7,988,196,647

(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	(2014年9月22日現在)				(2015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	841,414,415	-	861,575,000	20,160,585	869,476,863	-	880,880,000	11,403,137
	合計	841,414,415	-	861,575,000	20,160,585	869,476,863	-	880,880,000	11,403,137

(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	(2014年9月22日現在)	(2015年3月20日現在)
1口当たり純資産額	1.4564円	1.7022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

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
日本水産	48,200	373.00	17,978,600	
NIPPON	87,000	1,874.00	163,038,000	
大和ハウス工業	287,900	2,420.50	696,861,950	
積水ハウス	72,600	1,761.00	127,848,600	
森永乳業	40,000	456.00	18,240,000	
日本ハム	197,000	2,786.00	548,842,000	
丸大食品	138,000	412.00	56,856,000	
米久	4,400	1,857.00	8,170,800	
コカ・コーラウエスト	59,100	1,936.00	114,417,600	
ニチレイ	290,000	638.00	185,020,000	
わらべや日洋	34,000	2,173.00	73,882,000	
グンゼ	26,000	335.00	8,710,000	
日清紡ホールディングス	125,000	1,182.00	147,750,000	
ワコールホールディングス	60,000	1,433.00	85,980,000	
日本製紙	194,300	1,889.00	367,032,700	
中越パルプ工業	45,000	253.00	11,385,000	
大王製紙	17,000	1,113.00	18,921,000	
昭和電工	312,000	155.00	48,360,000	
トクヤマ	556,000	266.00	147,896,000	
セントラル硝子	31,000	528.00	16,368,000	
東亜合成	86,000	531.00	45,666,000	
電気化学工業	140,000	474.00	66,360,000	
日本カーバイド工業	48,000	231.00	11,088,000	
堺化学工業	268,000	406.00	108,808,000	
日本触媒	109,000	1,797.00	195,873,000	
三菱瓦斯化学	784,000	590.00	462,560,000	
JSR	74,300	2,053.00	152,537,900	
三菱ケミカルホールディングス	310,200	745.00	231,099,000	
日本合成化学工業	34,000	794.00	26,996,000	
住友ベークライト	98,000	539.00	52,822,000	
積水化学工業	19,000	1,584.00	30,096,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
日本ゼオン	8,000	1,111.00	8,888,000	
花王	17,600	6,006.00	105,705,600	
中国塗料	30,000	1,117.00	33,510,000	
D I C	92,000	344.00	31,648,000	
富士フィルムホールディングス	179,400	4,251.50	762,719,100	
マンダム	2,100	4,530.00	9,513,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	67,800	6,110.00	414,258,000	
日本バルカー工業	48,000	315.00	15,120,000	
アステラス製薬	298,600	2,000.00	597,200,000	
大日本住友製薬	90,100	1,467.00	132,176,700	
田辺三菱製薬	13,300	2,078.00	27,637,400	
科研製薬	22,000	3,555.00	78,210,000	
ロート製薬	4,400	1,712.00	7,532,800	
久光製薬	70,000	4,995.00	349,650,000	
日医工	10,300	2,850.00	29,355,000	
東和薬品	2,900	6,870.00	19,923,000	
第一三共	347,100	1,972.50	684,654,750	
キョーリン製薬ホールディングス	154,200	2,953.00	455,352,600	
ダイト	6,300	2,705.00	17,041,500	
大塚ホールディングス	168,100	3,730.50	627,097,050	
ニチレキ	7,000	1,077.00	7,539,000	
出光興産	102,100	2,097.00	214,103,700	
J Xホールディングス	642,700	478.50	307,531,950	
三ツ星ベルト	81,000	1,002.00	81,162,000	
旭硝子	23,000	780.00	17,940,000	
日本板硝子	157,000	116.00	18,212,000	
日本電気硝子	830,000	572.00	474,760,000	
住友大阪セメント	375,000	360.00	135,000,000	
新日鐵住金	456,000	311.20	141,907,200	
大阪製鐵	25,600	2,205.00	56,448,000	
東洋鋼鈑	83,000	561.00	46,563,000	
日本軽金属ホールディングス	408,700	184.00	75,200,800	
フジクラ	31,000	546.00	16,926,000	



銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
リョービ	413,000	359.00	148,267,000	
ツガミ	33,000	806.00	26,598,000	
アマダ	494,000	1,197.00	591,318,000	
小松製作所	32,600	2,455.00	80,033,000	
住友重機械工業	625,000	783.00	489,375,000	
TOWA	30,600	713.00	21,817,800	
荏原製作所	43,000	542.00	23,306,000	
椿本チエイン	45,000	1,000.00	45,000,000	
平和	7,300	2,419.00	17,658,700	
大和冷機工業	26,000	752.00	19,552,000	
日本ピストンリング	68,000	259.00	17,612,000	
NTN	59,000	631.00	37,229,000	
ジェイテクト	150,400	1,953.00	293,731,200	
キッツ	32,500	601.00	19,532,500	
三菱重工業	1,062,000	687.70	730,337,400	
イビデン	226,800	2,057.00	466,527,600	
ブラザー工業	237,100	1,944.00	460,922,400	
三菱電機	535,000	1,461.50	781,902,500	
富士電機	894,000	577.00	515,838,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	28,000	580.00	16,240,000	
日本電気	837,000	354.00	296,298,000	
富士通	596,000	843.30	502,606,800	
ジャパンディスプレイ	108,700	443.00	48,154,100	
パナソニック	559,700	1,567.50	877,329,750	
TDK	57,800	8,990.00	519,622,000	
ミツミ電機	44,200	916.00	40,487,200	
アルプス電気	44,600	2,991.00	133,398,600	
日本電波工業	24,400	1,044.00	25,473,600	
フォスター電機	7,900	3,145.00	24,845,500	
クラリオン	771,000	350.00	269,850,000	
日本航空電子工業	44,000	3,010.00	132,440,000	
TOA	25,300	1,198.00	30,309,400	
アルパイン	38,400	1,946.00	74,726,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
ローム	68,300	8,880.00	606,504,000	
新光電気工業	347,200	910.00	315,952,000	
日本ケミコン	114,000	365.00	41,610,000	
リコー	63,700	1,310.50	83,478,850	
東海理化電機製作所	43,600	2,756.00	120,161,600	
日産自動車	140,600	1,271.00	178,702,600	
いすゞ自動車	27,500	1,683.00	46,282,500	
トヨタ自動車	216,600	8,598.00	1,862,326,800	
日信工業	17,200	1,905.00	32,766,000	
NOK	34,800	3,870.00	134,676,000	
太平洋工業	13,300	999.00	13,286,700	
ケーヒン	79,900	1,967.00	157,163,300	
アイシン精機	112,000	4,465.00	500,080,000	
本田技研工業	161,600	4,116.50	665,226,400	
富士重工業	185,600	4,038.50	749,545,600	
ヤマハ発動機	196,900	2,929.00	576,720,100	
豊田合成	25,700	2,782.00	71,497,400	
愛三工業	12,900	1,117.00	14,409,300	
テイ・エス テック	20,200	3,220.00	65,044,000	
東京精密	13,900	2,861.00	39,767,900	
ニコン	256,900	1,677.00	430,821,300	
シチズンホールディングス	355,000	873.00	309,915,000	
バンダイナムコホールディングス	170,200	2,349.00	399,799,800	
凸版印刷	576,000	934.00	537,984,000	
大日本印刷	508,000	1,235.00	627,380,000	
ヤマハ	80,100	2,242.00	179,584,200	
アデランス	26,300	1,181.00	31,060,300	
東京電力	204,400	461.00	94,228,400	
中部電力	62,800	1,425.50	89,521,400	
関西電力	68,400	1,076.00	73,598,400	
中国電力	44,500	1,585.00	70,532,500	
北陸電力	39,200	1,595.00	62,524,000	
東北電力	48,800	1,368.00	66,758,400	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
九州電力	27,500	1,068.00	29,370,000	
沖縄電力	5,100	4,150.00	21,165,000	
東日本旅客鉄道	15,400	10,415.00	160,391,000	
西日本旅客鉄道	22,900	7,082.00	162,177,800	
東海旅客鉄道	10,200	24,075.00	245,565,000	
サカイ引越センター	13,200	4,010.00	52,932,000	
日本通運	601,000	675.00	405,675,000	
山九	130,000	539.00	70,070,000	
日本梱包運輸倉庫	107,300	2,188.00	234,772,400	
セイノーホールディングス	229,800	1,410.00	324,018,000	
日本郵船	24,000	386.00	9,264,000	
川崎汽船	1,571,000	362.00	568,702,000	
日本航空	100,800	3,890.00	392,112,000	
ITホールディングス	79,400	2,161.00	171,583,400	
グリー	138,800	754.00	104,655,200	
ネクソン	74,700	1,247.00	93,150,900	
フジ・メディア・ホールディングス	299,900	1,817.00	544,918,300	
イマジカ・ロボットホールディングス	16,500	770.00	12,705,000	
ネットワンシステムズ	47,000	842.00	39,574,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	18,500	1,995.00	36,907,500	
東京放送ホールディングス	9,000	1,635.00	14,715,000	
日本テレビホールディングス	64,100	2,121.00	135,956,100	
テレビ朝日ホールディングス	8,800	2,006.00	17,652,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	26,900	787.00	21,170,300	
日本電信電話	97,600	7,388.00	721,068,800	
KDDI	85,700	8,278.00	709,424,600	
NTTドコモ	129,900	2,199.50	285,715,050	
KADOKAWA・DWANGO	15,000	1,950.00	29,250,000	
カプコン	62,300	2,360.00	147,028,000	
TKC	10,800	2,570.00	27,756,000	
コナミ	47,200	2,262.00	106,766,400	
ソフトバンク	93,300	7,068.00	659,444,400	
伊藤忠食品	8,500	4,430.00	37,655,000	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
アルフレッサ ホールディングス	66,100	1,733.00	114,551,300	
メディカルホールディングス	7,300	1,616.00	11,796,800	
伊藤忠商事	375,900	1,325.00	498,067,500	
三井物産	491,400	1,657.00	814,249,800	
住友商事	305,100	1,316.50	401,664,150	
キャノンマーケティングジャパン	15,700	2,382.00	37,397,400	
東邦ホールディングス	12,500	2,098.00	26,225,000	
スズケン	73,300	4,050.00	296,865,000	
ローソン	8,000	8,230.00	65,840,000	
カワチ薬品	45,900	2,123.00	97,445,700	
エディオン	122,600	926.00	113,527,600	
J.フロント リテイリング	99,400	1,861.00	184,983,400	
ドトール・日レスホールディングス	120,300	2,067.00	248,660,100	
マツモトキヨシホールディングス	16,800	4,545.00	76,356,000	
セブン&アイ・ホールディングス	189,300	5,097.00	964,862,100	
サンマルクホールディングス	2,700	8,490.00	22,923,000	
コーナン商事	17,100	1,352.00	23,119,200	
壱番屋	4,200	5,600.00	23,520,000	
島忠	5,200	3,305.00	17,186,000	
AOKIホールディングス	13,200	1,694.00	22,360,800	
青山商事	40,200	3,910.00	157,182,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	11,100	2,288.00	25,396,800	
吉野家ホールディングス	69,900	1,304.00	91,149,600	
王将フードサービス	5,900	4,280.00	25,252,000	
プレナス	18,700	2,274.00	42,523,800	
アークス	8,300	2,756.00	22,874,800	
バロー	4,300	2,575.00	11,072,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,123,300	790.00	887,407,000	
三井住友フィナンシャルグループ	245,200	4,869.50	1,194,001,400	
みずほフィナンシャルグループ	5,200,100	224.70	1,168,462,470	
ジャフコ	32,400	4,640.00	150,336,000	
大和証券グループ本社	744,000	987.80	734,923,200	
野村ホールディングス	958,600	737.50	706,967,500	

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
水戸証券	252,000	493.00	124,236,000	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	150,300	3,865.00	580,909,500	
M S & A D インシュアランスグループホール	116,000	3,500.00	406,000,000	
第一生命保険	369,000	1,762.50	650,362,500	
東京海上ホールディングス	120,800	4,589.00	554,351,200	
T & Dホールディングス	135,500	1,613.50	218,629,250	
芙蓉総合リース	35,800	4,500.00	161,100,000	
興銀リース	18,200	2,545.00	46,319,000	
東京センチュリーリース	46,200	3,485.00	161,007,000	
日本証券金融	29,700	780.00	23,166,000	
日立キャピタル	68,600	2,613.00	179,251,800	
オリックス	443,400	1,752.50	777,058,500	
三菱UFJリース	45,900	615.00	28,228,500	
みらかホールディングス	15,300	5,910.00	90,423,000	
ラウンドワン	22,500	686.00	15,435,000	
ベネッセホールディングス	17,700	3,975.00	70,357,500	
合計			47,234,494,120	

## (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

(2015年3月31日現在)

資産総額	11,945,778,679円
負債総額	57,824,138円
純資産総額( - )	11,887,954,541円
発行済口数	12,126,711,743口
1口当たり純資産額( / )	0.9803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>

(2015年3月31日現在)

資産総額	44,343,995,893円
負債総額	57,227,518円
純資産総額( - )	44,286,768,375円
発行済口数	26,382,662,492口
1口当たり純資産額( / )	1.6786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

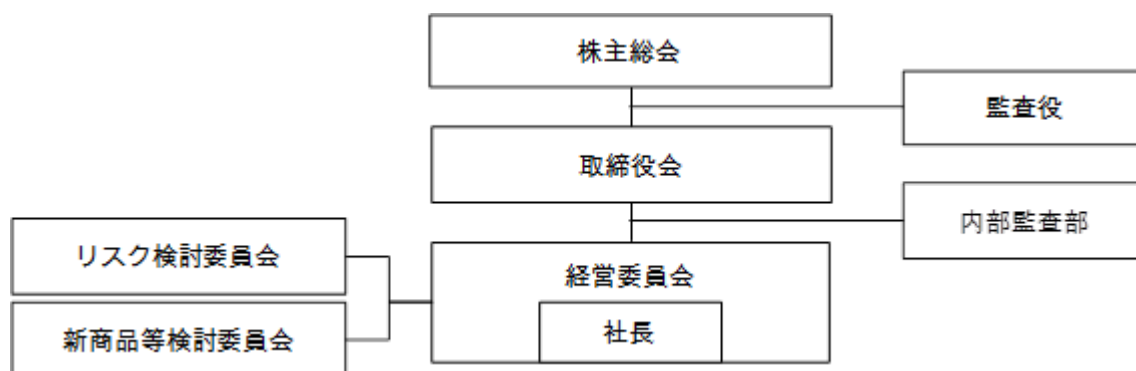
発行する株式の総数：8,000株

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

2015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	107	1,490,416,615,109
合計	107	1,490,416,615,109

[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19期事業年度（平成25年4月1日から平成26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20期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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。

[次へ](#)

## ( 1 ) 貸借対照表

期別		第18期 (平成25年3月31日現在)			第19期 (平成26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			3,799,436			6,190,481	
有価証券			10,197,717			15,497,189	
支払委託金			51			38	
収益分配金		51			38		
未収委託者報酬			1,349,584			1,629,300	
未収運用受託報酬			1,052,020			1,149,245	
未収収益			250,263			90,505	
立替金			58,689			2	
預け金			-			2,290	
繰延税金資産			655,118			810,563	
流動資産計			17,362,882	78.5		25,369,618	88.8
固定資産							
投資その他の資産			4,744,062			3,209,508	
投資有価証券		3,515,336			1,515,755		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,218,726			1,683,753		
固定資産計			4,744,062	21.5		3,209,508	11.2
資産合計			22,106,945	100.0		28,579,127	100.0

期別		第18期 (平成25年3月31日現在)			第19期 (平成26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			296			265	
未払金			533,934			539,515	
未払収益分配金		177			203		
未払償還金		72			72		
未払手数料		533,685			539,240		
未払費用			2,373,586			3,077,924	
未払法人税等			678,381			2,327,419	
未払消費税等			99,850			154,504	
流動負債計			3,686,048	16.7		6,099,629	21.3
固定負債							
長期未払費用			3,835,760			5,436,742	
役員退職慰労引当金			222,911			174,176	
その他固定負債			650			650	
固定負債計			4,059,322	18.4		5,611,569	19.6
負債合計			7,745,371	35.0		11,711,198	41.0

期別		第18期 (平成25年3月31日現在)			第19期 (平成26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			13,224,106			15,752,528	
その他利益剰余金		13,224,106			15,752,528		
繰越利益剰余金		13,224,106			15,752,528		
株主資本合計			14,104,106	63.8		16,632,528	58.2
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		257,467			235,400		
評価・換算差額等合計			257,467	1.2		235,400	0.8
純資産合計			14,361,574	65.0		16,867,928	59.0
負債・純資産合計			22,106,945	100.0		28,579,127	100.0

## (2) 損益計算書

期別		第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日			第19期 自 平成25年4月1日 至 平成26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	営業収益		千円	千円	%	千円	千円	%
	委託者報酬			10,394,695		13,635,195		
	運用受託報酬			5,903,536		9,656,904		
	その他営業収益	* 2		5,346,245		6,207,085		
	営業収益計			21,644,477	100.0	29,499,185	100.0	
	営業費用							
	支払手数料			4,828,407		6,962,756		
	広告宣伝費			356,368		144,681		
	調査費			4,843,198		5,933,889		
	委託調査費	* 2	4,843,198			5,933,889		
	委託計算費			187,048		223,678		
	営業雑経費			412,224		461,100		
	通信費		254,451			255,040		
	印刷費		128,462			177,694		
	協会費		29,310			28,365		
	営業費用計			10,627,248	49.1	13,726,106	46.5	
	一般管理費							
	給料			6,758,363		7,256,790		
	役員報酬		178,109			206,318		
	給料・手当		2,621,391			2,653,784		
	賞与		1,291,499			1,204,783		
	株式従業員報酬	* 1	807,717			1,588,176		
	その他の報酬		1,859,646			1,603,726		
	交際費			38,921		51,545		
	寄付金			19,338		21,662		
	旅費交通費			167,344		180,749		
	租税公課			49,118		132,233		
不動産賃借料			482,119		563,642			
退職給付費用			843,772		1,238,747			
事務委託費			457,831		381,217			
諸経費			1,084,126		1,348,001			
一般管理費計			9,900,937	45.7	11,174,589	37.9		
営業利益			1,116,291	5.2	4,598,489	15.6		

期別		第18期 自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日			第19期 自 平成25年4月1日 至 平成26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		104,727	
	受取利息				16,255		17,522	
	投資有価証券売却益				-		320,553	
	為替差益				14,373		-	
	雑益				52		1,661	
	営業外収益計				99,515	0.5	444,464	1.5
	営業外費用							
	支払利息				26		-	
	株式従業員報酬	* 1			257,196		292,295	
	為替差損				-		40,483	
投資有価証券売却損				-		491		
営業外費用計				257,223	1.2	333,269	1.1	
経常利益					958,583	4.4	4,709,683	16.0
税引前当期純利益					958,583	4.4	4,709,683	16.0
法人税、住民税及び事業税					1,030,076	4.8	2,774,220	9.4
法人税等調整額					373,921	1.7	592,957	2.0
当期純利益					302,428	1.4	2,528,421	8.6

## (3) 株主資本等変動計算書

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

第19期  
(自平成25年4月1日 至平成26年3月31日)

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成25年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	13,224,106	13,224,106	14,104,106	257,467	257,467	14,361,574
事業年度中の変動額									
当期純利益				2,528,421	2,528,421	2,528,421			2,528,421
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							22,067	22,067	22,067
事業年度中の変動額合計	-	-	-	2,528,421	2,528,421	2,528,421	22,067	22,067	2,506,354
平成26年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,752,528	15,752,528	16,632,528	235,400	235,400	16,867,928

## 重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入法によっております。</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 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>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（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 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18期 (平成25年3月31日現在)	第19期 (平成26年3月31日現在)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(損益計算書関係)

第18期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	第19期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)																
<p>* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますが、ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。</p> <p>* 2 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">営業収益</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">5,294,986千円</td> </tr> <tr> <td>営業費用</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">4,843,198千円</td> </tr> </table>	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	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">営業収益</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">6,098,382千円</td> </tr> <tr> <td>営業費用</td> <td></td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">5,933,889千円</td> </tr> </table>	営業収益		その他営業収益	6,098,382千円	営業費用		委託調査費	5,933,889千円
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																
営業収益																	
その他営業収益	6,098,382千円																
営業費用																	
委託調査費	5,933,889千円																

## （株主資本等変動計算書関係）

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。

第19期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

## 1．発行済株式に関する事項

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

## 2．配当に関する事項

該当事項はありません。

## （リース取引関係）

第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）	第19期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

## （金融商品関係）

第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	-	-	-	-	-

第19期  
（自 平成25年4月1日  
至 平成26年3月31日）

#### (1) 金融商品の状況に関する事項

##### 金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

##### 金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

##### 信用リスク

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

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

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

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

##### 市場リスク

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

##### 流動性および資金調達リスク

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

第19期  
(自 平成25年4月1日  
至 平成26年3月31日)

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成26年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	6,190,481	6,190,481	-
有価証券			
その他有価証券	15,497,189	15,497,189	-
未収委託者報酬	1,629,300	1,629,300	-
未収運用受託報酬	1,149,245	1,149,245	-
投資有価証券			
その他投資有価証券	1,515,755	1,515,755	-

## 金融商品の時価の算定方法

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

## 金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	6,190,481	-	-	-	-	-
有価証券						
その他有価証券の うち満期があるもの	15,500,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,629,300	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,149,245	-	-	-	-	-

## （有価証券関係）

第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）					第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26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	3,100,000	3,515,336	415,336	貸借対照表計上 額が取得原価を 超えるもの	投資信託	1,140,000	1,505,843	365,843
貸借対照表計上 額が取得原価を 超えないもの	コマー シャル・ ペーパー	10,197,717	10,197,717	-	貸借対照表計上 額が取得原価を 超えないもの	投資信託	10,000	9,912	88
						コマー シャル・ ペーパー	15,497,189	15,497,189	-
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券					2. 当事業年度中に売却したその他有価証券				
売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）			売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）		
1,900,000	-	-			2,610,062	320,553	491		

## （デリバティブ取引関係）

第18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）	第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26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18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）	第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26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18期 （自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日）	第19期 （自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日）
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	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
繰延税金資産（流動資産）	繰延税金資産（流動資産）
未払費用 592,366千円	未払費用 634,857千円
未払事業税 54,579	未払事業税 165,496
その他 8,172	その他 10,209
小計 655,118	小計 810,563
繰延税金負債（流動負債）	繰延税金負債（流動負債）
小計 -	小計 -
繰延税金資産（流動資産） の純額 655,118	繰延税金資産（流動資産） の純額 810,563
繰延税金資産（固定資産）	繰延税金資産（固定資産）
長期未払費用 1,239,518	長期未払費用 1,702,486
役員退職慰労引当金 80,193	役員退職慰労引当金 70,593
その他 56,884	その他 41,028
小計 1,376,595	小計 1,814,108
繰延税金負債（固定負債）	繰延税金負債（固定負債）
その他有価証券評価差額金 157,869	その他有価証券評価差額金 130,355
小計 157,869	小計 130,355
繰延税金資産（固定資産） の純額 1,218,726千円	繰延税金資産（固定資産） の純額 1,683,753千円
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	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
法定実効税率 38.01 %	法定実効税率 38.01 %
（調整）	（調整）
賞与等永久に損金に算入されない 項目 26.89 %	賞与等永久に損金に算入されない 項目 7.42 %
その他 3.55 %	その他 0.89 %
税効果会計適用後の法人税等の負 担率 68.45 %	税効果会計適用後の法人税等の負 担率 46.31 %



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

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。

第19期（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

## 〔セグメント情報〕

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

## 〔関連情報〕

## 1. 製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

（単位：千円）

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

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

## (2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## （関連当事者情報）

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 ニューヨーク州	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）										

第19期 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)										
親会社及び法人主要株主等										
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	276 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益(注1)  委託調査費の支払(注1)	6,098,382  5,933,889		
取引条件及び取引条件の決定方針等 (注1) その他営業収益及び委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。										
役員及び個人主要株主等 該当事項はありません。										
兄弟会社等										
種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任  有価証券の購入	兼務従業員の 人件費等の支払(注1)	2,207,798	有価証券  未払費用	15,497,189  278,488
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 有限会社	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	8,427,134  272,838	未払費用  長期未払 費用	2,505,305  5,560,064
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・USA	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	20,667 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	1,760,744
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・インベストメント・ストラテジー・LLC	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	25 百万ドル	投資顧問業		投資助言	運用受託報酬 (注3)	3,329,598		
取引条件及び取引条件の決定方針等 (注1) 兼務従業員の人件費等の支払に関しては、グループ会社間の契約に基づき、決定しております。 (注2) ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社(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。 (注3) 運用受託報酬に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。										
親会社又は重要な関連会社に関する注記 親会社情報 ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク(ニューヨーク証券取引所に上場) ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)										

## （1株当たり情報）

第18期 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）		第19期 （自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）	
1株当たり純資産額	2,243,995円98銭	1株当たり純資産額	2,635,613円85銭
1株当たり当期純利益金額	47,254円38銭	1株当たり当期純利益金額	395,065円83銭
損益計算書上の当期純利益	302,428千円	損益計算書上の当期純利益	2,528,421千円
1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	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	2,528,421千円
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20期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
		金額	構成比
(資産の部)		千円	%
流動資産			
現金・預金		9,878,196	
有価証券		11,998,406	
支払委託金		51	
前払費用		2,594	
未収委託者報酬		1,778,887	
未収運用受託報酬		1,742,732	
未収収益		916,423	
繰延税金資産		1,176,557	
流動資産計		27,493,850	88.4
固定資産			
投資その他の資産			
投資有価証券		1,686,101	
長期差入保証金		10,000	
繰延税金資産		1,923,888	
投資その他の資産計		3,619,989	
固定資産計		3,619,989	11.6
資産合計		31,113,839	100.0

区分	注記 番号	第20期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
		金額	構成比
(負債の部)		千円	%
流動負債			
預り金		347	
未払金		569,506	
未払費用		3,916,909	
未払法人税等		1,585,632	
未払消費税	* 1	236,540	
流動負債計		6,308,935	20.3
固定負債			
長期未払費用		6,798,036	
固定負債計		6,798,036	21.8
負債合計		13,106,972	42.1



区分	注記 番号	第20期中間会計期間末 (平成26年9月30日)	
		金額	構成比
(純資産の部)			
株主資本			
資本金		490,000	
資本剰余金			
資本準備金		390,000	
資本剰余金合計		390,000	
利益剰余金			
その他利益剰余金			
繰越利益剰余金		16,839,904	
利益剰余金合計		16,839,904	
株主資本合計		17,719,904	57.0
評価・換算差額等			
その他有価証券評価差額金		286,962	
評価・換算差額等合計		286,962	
純資産合計		18,006,867	57.9
負債・純資産合計		31,113,839	100.0

## (2) 中間損益計算書

区分	注記 番号	第20期中間会計期間 (自 平成26年 4 月 1 日 至 平成26年 9 月30日)	
		金額	百分比
		千円	%
営業収益			
委託者報酬		6,999,852	
運用受託報酬		4,738,635	
その他営業収益		3,063,757	
営業収益計		14,802,245	100.0
営業費用及び一般管理費		12,572,441	84.9
営業利益		2,229,804	15.1
営業外収益	* 1	46,240	0.3
営業外費用	* 2	245,503	1.7
経常利益		2,030,541	13.7
税引前中間純利益		2,030,541	13.7
法人税、住民税及び事業税		1,577,847	10.7
法人税等調整額		634,682	4.3
中間純利益		1,087,376	7.3

## 重要な会計方針

項目	第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券</p> <p>時価のあるもの</p> <p>時価をもって中間貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入する方法によっております。</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金</p> <p>貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 金融商品取引責任準備金</p> <p>金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法</p> <p>役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（営業費用及び一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

## 注記事項

( 中間貸借対照表関係 )

項目	第20期中間会計期間末 (平成26年9月30日)
* 1 消費税等の取扱い	控除対象の仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、流動負債に表示しております。

(中間損益計算書関係)

項目	第20期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26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	27,748千円
	受取利息	9,606千円
	為替差益	6,396千円
* 2 営業外費用のうち主要なもの	株式従業員報酬	245,364千円

## （リース取引関係）

第20期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	9,878,196	9,878,196	-
有価証券			
その他有価証券	11,998,406	11,998,406	-
未収委託者報酬	1,778,887	1,778,887	-
未収運用受託報酬	1,742,732	1,742,732	-
投資有価証券			
その他有価証券	1,686,101	1,686,101	-

## 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20期中間会計期間末（平成26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	1,225,000	1,671,024	446,024
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	15,230	15,076	153
	コマーシャル・ペーパー	11,998,406	11,998,406	-

## （デリバティブ取引関係）

第20期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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20期中間会計期間（自平成26年4月1日 至平成26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	6,999,852	4,738,635	3,063,757	14,802,245

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	米国	その他	合計
12,151,285	1,948,257	702,703	14,802,245

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3．主要な顧客ごとの情報

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

( 1株当たり情報 )

第20期中間会計期間 (自 平成26年 4月 1日 至 平成26年 9月30日)	
1株当たり純資産額	2,813,573円00銭
1株当たり中間純利益金額	169,902円56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	1,087,376千円
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	1,087,376千円
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20期中間会計期間（自平成26年 4月 1日 至平成26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27年4月22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GS日本株式インデックス・プラスの平成26年9月23日から平成27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、GS日本株式インデックス・プラスの平成27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XBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成26年6月2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26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26年12月1日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第20期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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。