

【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28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27年12月18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

<訂正前>

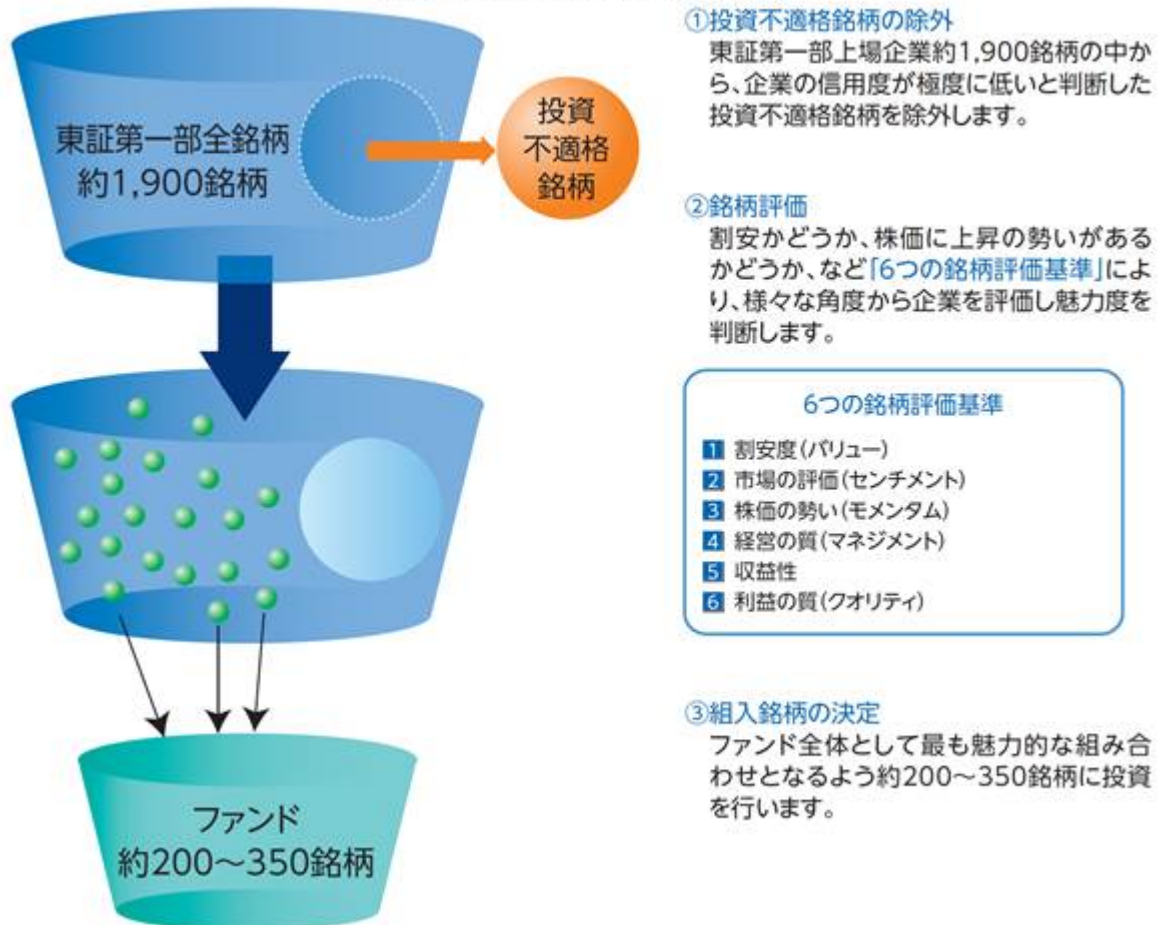
(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドの運用手法>

(中略)

独自開発の計量モデルを用いた運用手法



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

< ファンドの運用プロセス >

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

計量モデルを用いることで、約1,900銘柄に及ぶ多数の銘柄を、複数の銘柄評価基準を用いて分析し、これらを基に最も魅力的と思われるポートフォリオを構築します。

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

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

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、2015年6月末現在、グループ全体で1兆211億米ドル (約125兆円*)の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2015年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 = 122.45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。

委託会社等の概況

(中略)

c. 大株主の状況

(本書提出日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (株)	所有比率 (%)
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ニューヨーク市ウエスト・ストリート200番地	6,336	99
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ニューヨーク市ウエスト・ストリート200番地	64	1

<訂正後>

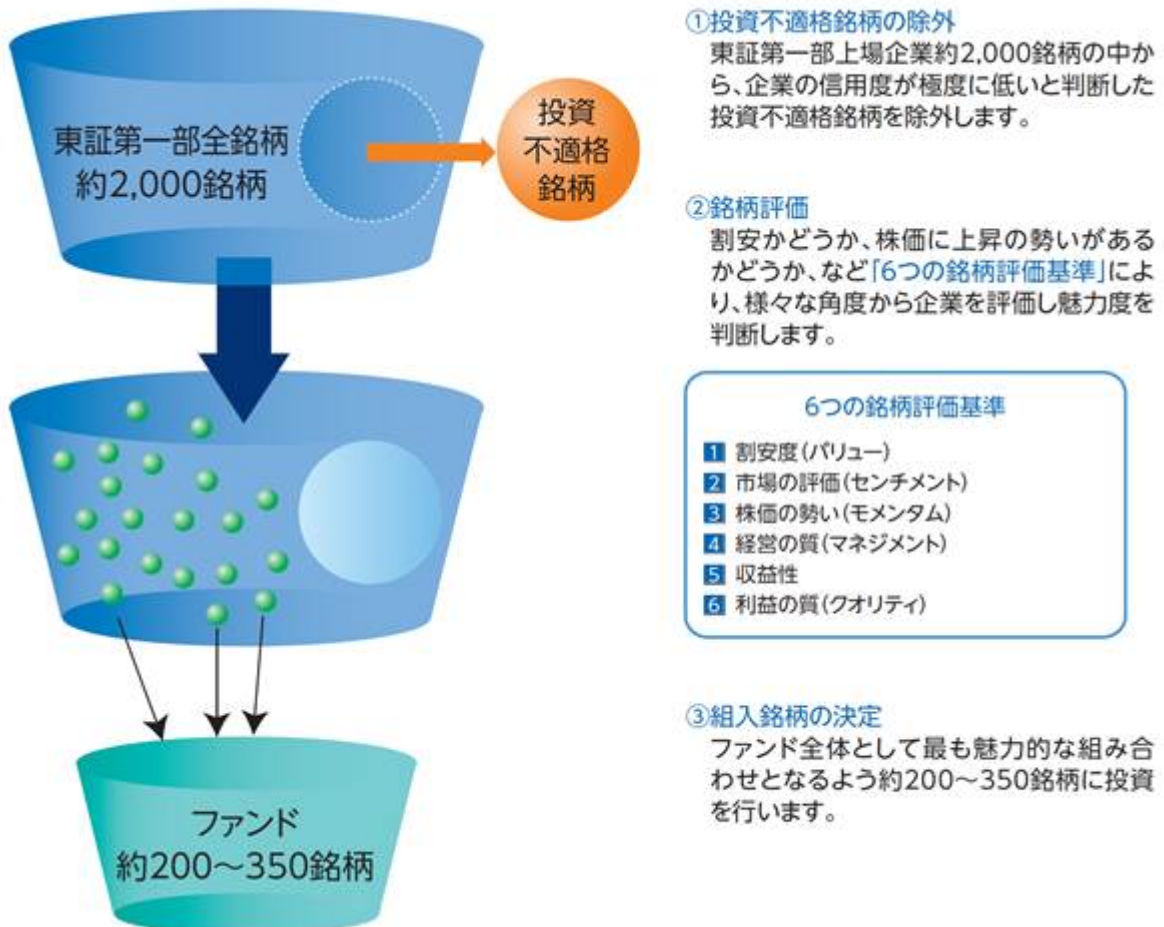
(1) ファンドの目的及び基本的性格

(中略)

<ファンドの運用手法>

(中略)

独自開発の計量モデルを用いた運用手法



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

< ファンドの運用プロセス >

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

計量モデルを用いることで、約2,000銘柄に及ぶ多数の銘柄を、複数の銘柄評価基準を用いて分析し、これらを基に最も魅力的と思われるポートフォリオを構築します。

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

(中略)

(3) ファンドの仕組み

(中略)

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、2015年12月末現在、グループ全体で1兆827億米ドル(約131兆円*)の資産を運用しています。

*米ドルの円貨換算は便宜上、2015年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1米ドル=120.61円)により、計算しております。

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

委託会社等の概況

(中略)

c. 大株主の状況

(本書提出日現在)

氏名又は名称	住所	所有株式数 (株)	所有比率 (%)
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル・ホールディングス・エルエルシー	アメリカ合衆国ニューヨーク州ニューヨーク市ウェスト・ストリート200番地	6,400	100

[次へ](#)

3 投資リスク

(3) 参考情報

原届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 3 投資リスク (3) 参考情報」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

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。

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



- 年間騰落率は各月末における直近1年間の騰落率を表示したものです。

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



- グラフは、本ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。
- すべての資産クラスが本ファンドの投資対象とは限りません。
- 上記のグラフは、過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

● 各資産クラスの指数

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株：MSCI コクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）

日本国債：NOMURA-BPI 国債

先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースまたは円換算ベースの指数を採用しております。

本ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額および当該基準価額の年間騰落率が記載されており、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

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。

< 2016年1月1日以降 >

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）

(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)

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。

< 2016年1月1日以降 >

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)

< 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。

< 2016年1月1日以降 >

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)

<訂正後>

（前略）

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。

<2016年1月1日以降>

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

NISAの非課税期間（5年）以内に信託期間が終了（繰上償還）した場合、制度上、本ファンドで利用した非課税投資額（NISA枠）を再利用することはできません。

（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）

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）

<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、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

(2016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	8,824,268,477	100.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,454,937	0.03
合計(純資産総額)		8,821,813,540	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>

(2016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	22,963,014,430	96.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		881,297,291	3.70
合計(純資産総額)		23,844,311,721	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

(2016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	5,615,188,341	1.5816	8,880,984,148	1.5715	8,824,268,477	100.03

種類別及び業種別投資比率

(2016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

<GS日本株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

(2016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	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,399,100	553.00	773,702,300	521.50	729,630,650	3.06
2	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	143,200	4,972.00	711,990,400	4,848.00	694,233,600	2.91
3	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	107,500	6,098.00	655,535,000	5,952.00	639,840,000	2.68
4	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	155,600	3,590.91	558,746,473	3,412.00	530,907,200	2.23
5	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	23,300	20,080.00	467,864,000	19,905.00	463,786,500	1.95
6	日本	株式	KDDI	情報・通信業	145,900	3,118.00	454,916,200	3,006.00	438,575,400	1.84
7	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	277,800	1,545.44	429,325,245	1,496.50	415,727,700	1.74
8	日本	株式	オリックス	その他金融業	245,500	1,624.50	398,814,750	1,605.50	394,150,250	1.65
9	日本	株式	大和ハウス工業	建設業	120,200	3,231.00	388,366,200	3,166.00	380,553,200	1.60
10	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	121,100	3,091.27	374,353,341	3,086.00	373,714,600	1.57
11	日本	株式	日本航空	空運業	84,300	4,144.00	349,339,200	4,122.00	347,484,600	1.46
12	日本	株式	積水ハウス	建設業	181,000	1,986.00	359,466,000	1,899.50	343,809,500	1.44
13	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	46,500	7,201.00	334,846,500	7,336.00	341,124,000	1.43
14	日本	株式	住友商事	卸売業	276,900	1,210.50	335,187,450	1,118.50	309,712,650	1.30
15	日本	株式	積水化学工業	化学	222,900	1,372.00	305,818,800	1,386.00	308,939,400	1.30
16	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	117,700	2,613.50	307,608,950	2,552.50	300,429,250	1.26
17	日本	株式	東京瓦斯	電気・ガス業	571,000	513.00	292,923,000	524.70	299,603,700	1.26
18	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	55,700	5,632.00	313,702,400	5,366.00	298,886,200	1.25
19	日本	株式	キリンホールディングス	食料品	188,700	1,574.68	297,143,638	1,578.00	297,768,600	1.25
20	日本	株式	帝人	繊維製品	723,000	392.00	283,416,000	392.00	283,416,000	1.19
21	日本	株式	田辺三菱製薬	医薬品	142,700	1,969.00	280,976,300	1,957.00	279,263,900	1.17
22	日本	株式	日本電気硝子	ガラス・土石製品	483,000	590.00	284,970,000	576.00	278,208,000	1.17
23	日本	株式	マツモトキヨシホールディングス	小売業	46,900	5,750.00	269,675,000	5,890.00	276,241,000	1.16
24	日本	株式	アマダホールディングス	機械	250,500	1,116.00	279,558,000	1,098.00	275,049,000	1.15
25	日本	株式	凸版印刷	その他製品	285,000	978.00	278,730,000	944.00	269,040,000	1.13
26	日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	38,600	6,935.00	267,691,000	6,949.00	268,231,400	1.12
27	日本	株式	住友化学	化学	522,000	519.00	270,918,000	509.00	265,698,000	1.11
28	日本	株式	キョーリン製薬ホールディングス	医薬品	120,700	2,159.00	260,591,300	2,144.00	258,780,800	1.09
29	日本	株式	日本テレビホールディングス	情報・通信業	135,200	1,879.00	254,040,800	1,857.00	251,066,400	1.05
30	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	561,000	421.30	236,349,300	432.40	242,576,400	1.02

種類別及び業種別投資比率

（2016年3月31日現在）

国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
国内	水産・農林業	0.07
	鉱業	0.02
	建設業	4.54
	食料品	3.81
	繊維製品	1.40
	化学	7.15
	医薬品	5.49
	石油・石炭製品	0.85
	ゴム製品	0.46
	ガラス・土石製品	1.89
	鉄鋼	1.23
	非鉄金属	0.67
	機械	5.93
	電気機器	4.57
	輸送用機器	6.18
	精密機器	0.11
	その他製品	2.50
	電気・ガス業	3.60
	陸運業	4.95
	空運業	1.64
	情報・通信業	13.42
	卸売業	6.20
	小売業	4.79
	銀行業	5.98
	証券、商品先物取引業	0.81
	保険業	1.28
	その他金融業	2.80
不動産業	2.08	
サービス業	1.91	
合計		96.30

(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
 (2016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>
 (2016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
 (2016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

(2016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	27	日本円	366,120,000	363,825,000	1.53

(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

2016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
第20計算期間末 (2015年9月24日)	9,307	9,312	0.9239	0.9244
第21計算期間末 (2016年3月22日)	8,892	8,896	0.9120	0.9125
2015年3月末日	11,887	-	0.9803	-
4月末日	11,964	-	1.0319	-
5月末日	12,044	-	1.0961	-
6月末日	11,180	-	1.0571	-
7月末日	11,063	-	1.0727	-
8月末日	10,042	-	0.9932	-
9月末日	9,341	-	0.9252	-
10月末日	10,163	-	1.0137	-
11月末日	10,188	-	1.0348	-
12月末日	9,946	-	1.0197	-

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)
2016年1月末日	9,374	-	0.9577	-
2月末日	8,467	-	0.8670	-
3月末日	8,821	-	0.9057	-

(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
第20計算期間	2015年3月21日～2015年9月24日	0.0005
第21計算期間	2015年9月25日～2016年3月22日	0.0005

収益率の推移

期	期間	収益率（%）
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
第20計算期間	2015年3月21日～2015年9月24日	7.0
第21計算期間	2015年9月25日～2016年3月22日	1.2

(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
第20計算期間	2015年3月21日～2015年9月24日	322,568,662	2,495,340,062	10,074,181,337
第21計算期間	2015年9月25日～2016年3月22日	244,340,808	568,251,565	9,750,270,580

[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。

2016年3月31日現在

基準価額・純資産の推移

2006年4月3日～2016年3月31日(設定日:2005年10月3日)



●分配金再投資基準価額および期間別騰落率(分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●基準価額および分配金再投資基準価額は、1万口当たりの値です。

基準価額・純資産総額

基準価額	9,057円
純資産総額	88.2億円

期間別騰落率
(分配金再投資)

期間	ファンド
1ヵ月	4.52%
3ヵ月	-11.13%
6ヵ月	-2.05%
1年	-7.51%
3年	37.42%
5年	70.59%
設定来	4.79%

分配の推移(1万口当たり、税引前)

決算日	14/3/20	14/9/22	15/3/20	15/9/24	16/3/22	設定来累計
分配金	5円	5円	5円	5円	5円	1,565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

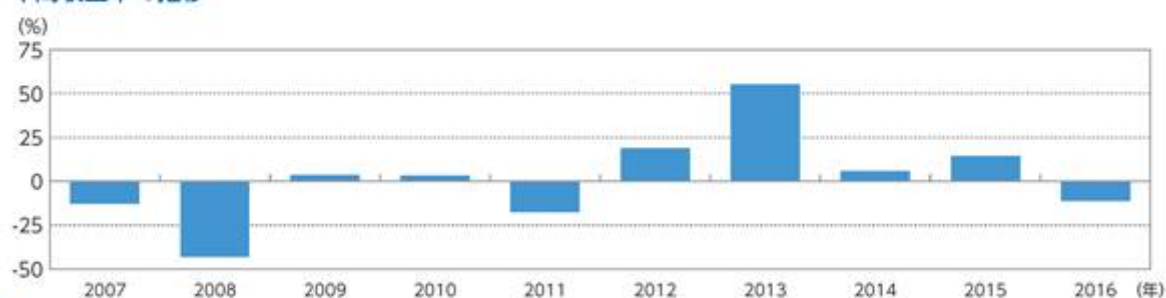
組入上位銘柄

	銘柄	市場	業種	比率
1	三菱UFJフィナンシャル・グループ	東証1部	銀行業	3.1%
2	日本電信電話	東証1部	情報・通信業	2.9%
3	トヨタ自動車	東証1部	輸送用機器	2.7%
4	三井住友フィナンシャルグループ	東証1部	銀行業	2.2%
5	東海旅客鉄道	東証1部	陸運業	1.9%
6	KDDI	東証1部	情報・通信業	1.8%
7	アステラス製薬	東証1部	医薬品	1.7%
8	オリックス	東証1部	その他金融業	1.7%
9	大和ハウス工業	東証1部	建設業	1.6%
10	本田技研工業	東証1部	輸送用機器	1.6%

上位10業種

	業種名	比率
1	情報・通信業	13.4%
2	化学	7.2%
3	卸売業	6.2%
4	輸送用機器	6.2%
5	銀行業	6.0%
6	機械	5.9%
7	医薬品	5.5%
8	陸運業	5.0%
9	小売業	4.8%
10	電気機器	4.6%

年間収益率の推移



●本ファンドの収益率は、分配金(税引前)を再投資したものとして算出しています。

●2016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21期計算期間(平成27年9月25日から平成28年3月22日まで)の財務諸表について、PWC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20期 (平成27年9月24日現在)	第21期 (平成28年3月22日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	9,377,251,459	8,949,112,030
未収入金	11,927,361	3,941,533
流動資産合計	9,389,178,820	8,953,053,563
資産合計	9,389,178,820	8,953,053,563
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,037,090	4,875,135
未払解約金	11,927,361	3,941,533
未払受託者報酬	3,127,984	2,521,203
未払委託者報酬	59,431,610	47,902,811
その他未払費用	1,832,936	1,800,958
流動負債合計	81,356,981	61,041,640
負債合計	81,356,981	61,041,640
純資産の部		
元本等		
元本	10,074,181,337	9,750,270,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	766,359,498	858,258,657
（分配準備積立金）	2,135,764,401	2,050,322,689
元本等合計	9,307,821,839	8,892,011,923
純資産合計	9,307,821,839	8,892,011,923
負債純資産合計	9,389,178,820	8,953,053,563

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期		第21期	
	自	平成27年3月21日 平成27年9月24日	自	平成27年9月25日 平成28年3月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		515,481,738		26,363,073
営業収益合計		515,481,738		26,363,073
営業費用				
受託者報酬		3,127,984		2,521,203
委託者報酬		59,431,610		47,902,811
その他費用		1,832,936		1,800,958
営業費用合計		64,392,530		52,224,972
営業利益又は営業損失（ ）		579,874,268		78,588,045
経常利益又は経常損失（ ）		579,874,268		78,588,045
当期純利益又は当期純損失（ ）		579,874,268		78,588,045
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（ ）		139,004,263		39,137,326
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		68,213,862		766,359,498
剰余金増加額又は欠損金減少額		25,769,985		43,005,799
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,546,791		43,005,799
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		13,223,194		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		12,304,452
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		12,304,452
分配金		5,037,090		4,875,135
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		766,359,498		858,258,657

[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20期	第21期
	自 平成27年 3月21日 至 平成27年 9月24日	自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 平成27年 9月20日から 9月23日までが休業日のため、当計算期間末日は平成27年 9月24日としております。	計算期間の取扱い 平成27年 9月20日から 9月23日までが休業日のため、当計算期間期首は平成27年 9月25日としております。また、平成28年 3月20日及びその翌日が休業日のため、当計算期間末日は平成28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20期	第21期
	(平成27年 9月24日現在)	(平成28年 3月22日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	12,246,952,737円	10,074,181,337円
期中追加設定元本額	322,568,662円	244,340,808円
期中一部解約元本額	2,495,340,062円	568,251,565円
2. 受益権の総数	10,074,181,337口	9,750,270,580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766,359,498円です。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は858,258,657円です。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第20期		第21期	
	自	平成27年3月21日 至 平成27年9月24日	自	平成27年9月25日 至 平成28年3月22日
分配金の計算過程				
費用控除後の配当等収益額		62,306,094円		38,747,202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		239,108,709円		282,508,586円
分配準備積立金額		2,078,495,397円		2,016,450,622円
本ファンドの分配対象収益額		2,379,910,200円		2,337,706,410円
本ファンドの期末残存口数		10,074,181,337口		9,750,270,580口
1口当たり収益分配対象額		0.236238円		0.239758円
1口当たり分配金額		0.0005円		0.0005円
収益分配金金額		5,037,090円		4,875,135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20期 自 平成27年3月21日 至 平成27年9月24日	第21期 自 平成27年9月25日 至 平成28年3月22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も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。 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20期	第21期
	自 平成27年3月21日 至 平成27年9月24日	自 平成27年9月25日 至 平成28年3月22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20期 (平成27年9月24日現在)	第21期 (平成28年3月22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	632,924,494	42,974,800
合計	632,924,494	42,974,800

(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20期 (平成27年9月24日現在)	第21期 (平成28年3月22日現在)
1口当たり純資産額	0.9239円	0.9120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	5,656,834,406	8,949,112,030	
合計			5,656,834,406	8,949,112,030	

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	(平成27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		712,079	108,446
コール・ローン		791,521,842	598,725,620
株式		30,064,949,450	23,406,494,420
未収入金		-	1,919,524,439
未収配当金		16,164,350	42,453,800
未収利息		676	-
差入委託証拠金		90,838,562	26,101,164
流動資産合計		30,964,186,959	25,993,407,889
資産合計		30,964,186,959	25,993,407,889
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		4,246,526	85,368
未払金		-	779,868,033
未払解約金		11,927,361	1,134,802,532
流動負債合計		16,173,887	1,914,755,933
負債合計		16,173,887	1,914,755,933
純資産の部			
元本等			
元本		19,432,662,576	15,220,530,531
剰余金			
剰余金又は欠損金()		11,515,350,496	8,858,121,425
元本等合計		30,948,013,072	24,078,651,956
純資産合計		30,948,013,072	24,078,651,956
負債純資産合計		30,964,186,959	25,993,407,889

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年 3月21日 至 平成27年 9月24日	自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22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	(平成27年 9月24日現在)	(平成28年 3月22日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	28,548,221,329円	19,432,662,576円
期中追加設定元本額	331,526,757円	563,921,660円
期中一部解約元本額	9,447,085,510円	4,776,053,705円
期末元本額	19,432,662,576円	15,220,530,531円
元本の内訳		
GS日本株式インデックス・プラス	5,888,014,228円	5,656,834,406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)	1,942,735,226円	2,340,794,929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)	356,201,310円	348,676,076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	11,245,711,812円	6,874,225,120円
2. 受益権の総数	19,432,662,576口	15,220,530,531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 平成27年 3月21日 至 平成27年 9月24日	自 平成27年 9月25日 至 平成28年 3月22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 平成27年3月21日 至 平成27年9月24日	自 平成27年9月25日 至 平成28年3月22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	(平成27年9月24日現在)	(平成28年3月22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	3,027,109,528	1,537,829,722
合計	3,027,109,528	1,537,829,722

(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	(平成27年9月24日現在)				(平成28年3月22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	500,196,526	-	495,950,000	4,246,526	366,205,368	-	366,120,000	85,368
	合計	500,196,526	-	495,950,000	4,246,526	366,205,368	-	366,120,000	85,368

(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	(平成27年9月24日現在)	(平成28年3月22日現在)
1口当たり純資産額	1.5926円	1.5820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

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	日本水産	11,600	526.00	6,101,600	
	日鉄鉱業	11,000	445.00	4,895,000	
	ミライト・ホールディングス	53,500	926.00	49,541,000	
	鹿島建設	27,000	727.00	19,629,000	
	大豊建設	7,000	503.00	3,521,000	
	大東建託	10,900	16,280.00	177,452,000	
	N I P P O	11,000	1,845.00	20,295,000	
	前田道路	23,000	1,881.00	43,263,000	
	日本道路	10,000	537.00	5,370,000	
	大林道路	15,000	785.00	11,775,000	
	大和ハウス工業	124,900	3,231.00	403,551,900	
	積水ハウス	181,000	1,986.00	359,466,000	
	きんでん	26,800	1,404.00	37,627,200	
	N D S	11,000	295.00	3,245,000	
	明星工業	7,900	494.00	3,902,600	
	日本製粉	16,000	914.00	14,624,000	
	三井製糖	9,000	508.00	4,572,000	
	森永乳業	95,000	591.00	56,145,000	
	プリマハム	16,000	278.00	4,448,000	
	丸大食品	64,000	459.00	29,376,000	
	米久	5,900	2,650.00	15,635,000	
	キリンホールディングス	181,400	1,574.00	285,523,600	
	コカ・コーラウエスト	8,400	2,624.00	22,041,600	
	ダイドードリンコ	3,800	5,270.00	20,026,000	
	ニチレイ	157,000	899.00	141,143,000	
	東洋水産	48,000	4,070.00	195,360,000	
	フジッコ	2,500	2,417.00	6,042,500	
	わらべや日洋	34,000	2,494.00	84,796,000	
	富士紡ホールディングス	160,000	233.00	37,280,000	
	日本毛織	18,000	781.00	14,058,000	
帝人	723,000	392.00	283,416,000		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	クラレ	27,300	1,370.00	37,401,000	
	昭和電工	376,000	119.00	44,744,000	
	住友化学	522,000	519.00	270,918,000	
	東ソー	292,000	490.00	143,080,000	
	東亜合成	34,100	912.00	31,099,200	
	デンカ	117,000	467.00	54,639,000	
	堺化学工業	268,000	312.00	83,616,000	
	日本化学工業	13,000	222.00	2,886,000	
	日本触媒	1,200	5,760.00	6,912,000	
	三菱瓦斯化学	22,000	621.00	13,662,000	
	三井化学	277,000	375.00	103,875,000	
	三菱ケミカルホールディングス	105,700	612.50	64,741,250	
	日本合成化学工業	13,000	706.00	9,178,000	
	積水化学工業	222,900	1,372.00	305,818,800	
	宇部興産	115,000	208.00	23,920,000	
	三洋化成工業	4,000	792.00	3,168,000	
	中国塗料	22,000	793.00	17,446,000	
	富士フイルムホールディングス	36,800	4,505.00	165,784,000	
	マンダム	3,200	4,935.00	15,792,000	
	コーセー	5,100	10,600.00	54,060,000	
	ポーラ・オルビスホールディングス	23,800	9,160.00	218,008,000	
	アステラス製薬	264,700	1,545.00	408,961,500	
	大日本住友製薬	144,500	1,307.00	188,861,500	
	塩野義製薬	11,800	5,449.00	64,298,200	
	田辺三菱製薬	142,700	1,969.00	280,976,300	
	科研製薬	16,900	6,450.00	109,005,000	
	キッセイ薬品工業	6,000	2,592.00	15,552,000	
	生化学工業	3,400	1,535.00	5,219,000	
	富士製薬工業	1,900	1,928.00	3,663,200	
	キョーリン製薬ホールディングス	120,700	2,159.00	260,591,300	
	大塚ホールディングス	3,400	4,070.00	13,838,000	
	ニチレキ	4,000	815.00	3,260,000	
	東燃ゼネラル石油	9,000	976.00	8,784,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	出光興産	100,200	1,960.00	196,392,000	
	東洋ゴム工業	16,800	1,741.00	29,248,800	
	ブリヂストン	6,500	4,128.00	26,832,000	
	三ツ星ベルト	60,000	946.00	56,760,000	
	旭硝子	256,000	619.00	158,464,000	
	日本山村硝子	50,000	173.00	8,650,000	
	日本電気硝子	483,000	590.00	284,970,000	
	ニチハ	3,900	1,723.00	6,719,700	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	62,500	1,543.00	96,437,500	
	大和工業	31,200	2,482.00	77,438,400	
	東洋鋼鈑	83,000	324.00	26,892,000	
	フジクラ	22,000	569.00	12,518,000	
	リョービ	333,000	452.00	150,516,000	
	オークマ	235,000	819.00	192,465,000	
	アマダホールディングス	250,500	1,116.00	279,558,000	
	富士機械製造	5,200	1,194.00	6,208,800	
	牧野フライス製作所	179,000	719.00	128,701,000	
	ソディック	11,500	864.00	9,936,000	
	島精機製作所	2,300	1,898.00	4,365,400	
	ホソカワミクロン	11,000	548.00	6,028,000	
	小松製作所	53,300	1,941.00	103,455,300	
	北川鉄工所	15,000	219.00	3,285,000	
	クボタ	43,300	1,543.00	66,811,900	
	帝国電機製作所	3,900	717.00	2,796,300	
	新東工業	8,800	1,008.00	8,870,400	
	小森コーポレーション	15,600	1,359.00	21,200,400	
	椿本チエイン	104,000	744.00	77,376,000	
	タダノ	23,000	1,064.00	24,472,000	
	平和	64,000	2,439.00	156,096,000	
	SANKYO	55,500	4,360.00	241,980,000	
	大和冷機工業	31,800	992.00	31,545,600	
	セガサミーホールディングス	5,900	1,301.00	7,675,900	
	日本ピストンリング	3,400	1,585.00	5,389,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	キッツ	58,500	515.00	30,127,500	
	コニカミノルタ	63,900	1,017.00	64,986,300	
	三菱電機	44,000	1,188.50	52,294,000	
	日東工業	16,000	1,798.00	28,768,000	
	ジャパンディスプレイ	479,400	227.00	108,823,800	
	日本信号	6,000	941.00	5,646,000	
	タムラ製作所	28,000	308.00	8,624,000	
	フォスター電機	4,800	2,369.00	11,371,200	
	TOA	25,300	1,113.00	28,158,900	
	アルパイン	29,600	1,296.00	38,361,600	
	スミダコーポレーション	6,300	746.00	4,699,800	
	横河電機	8,400	1,144.00	9,609,600	
	レーザーテック	2,600	1,540.00	4,004,000	
	ローム	26,700	5,040.00	134,568,000	
	新光電気工業	325,800	661.00	215,353,800	
	太陽誘電	6,900	1,174.00	8,100,600	
	ユーシン	7,700	676.00	5,205,200	
	東京エレクトロン	46,500	7,201.00	334,846,500	
	ユニプレス	17,600	1,982.00	34,883,200	
	日産自動車	113,200	1,082.00	122,482,400	
	いすゞ自動車	190,700	1,170.50	223,214,350	
	トヨタ自動車	107,500	6,098.00	655,535,000	
	新明和工業	68,000	822.00	55,896,000	
	極東開発工業	5,000	1,147.00	5,735,000	
	KYB	76,000	331.00	25,156,000	
	今仙電機製作所	4,900	1,009.00	4,944,100	
	本田技研工業	95,000	3,096.00	294,120,000	
	富士重工業	19,300	3,953.00	76,292,900	
	エクセディ	4,600	2,443.00	11,237,800	
	ヨロズ	8,400	2,416.00	20,294,400	
	テイ・エス テック	7,600	2,606.00	19,805,600	
	東京精密	3,600	2,163.00	7,786,800	
	バンダイナムコホールディングス	41,000	2,465.00	101,065,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	凸版印刷	298,000	978.00	291,444,000	
	大日本印刷	186,000	1,056.00	196,416,000	
	宝印刷	2,800	1,320.00	3,696,000	
	コクヨ	18,300	1,256.00	22,984,800	
	岡村製作所	21,900	1,052.00	23,038,800	
	東京電力	131,600	584.00	76,854,400	
	中部電力	78,200	1,525.50	119,294,100	
	関西電力	95,000	971.50	92,292,500	
	沖縄電力	5,600	2,850.00	15,960,000	
	東京瓦斯	571,000	513.00	292,923,000	
	大阪瓦斯	620,000	421.30	261,206,000	
	東日本旅客鉄道	20,500	10,195.00	208,997,500	
	西日本旅客鉄道	43,100	6,935.00	298,898,500	
	東海旅客鉄道	23,300	20,080.00	467,864,000	
	ニッコンホールディングス	97,300	2,093.00	203,648,900	
	セイノーホールディングス	99,200	1,183.00	117,353,600	
	日本航空	87,000	4,144.00	360,528,000	
	A N Aホールディングス	136,000	327.20	44,499,200	
	新日鉄住金ソリューションズ	3,200	2,220.00	7,104,000	
	I Tホールディングス	79,200	2,601.00	205,999,200	
	グリー	210,200	588.00	123,597,600	
	コーエーテクモホールディングス	8,600	1,836.00	15,789,600	
	ポルトゥウィン・ピットクルーホール ディ	13,300	982.00	13,060,600	
	ネクソン	97,200	1,881.00	182,833,200	
	アイスタイル	9,700	1,073.00	10,408,100	
	ティー・ワイ・オー	57,600	163.00	9,388,800	
	フジ・メディア・ホールディングス	42,100	1,317.00	55,445,700	
	伊藤忠テクノソリューションズ	46,500	2,236.00	103,974,000	
	ネットワンシステムズ	73,600	643.00	47,324,800	
	マーベラス	87,700	964.00	84,542,800	
	日本テレビホールディングス	135,200	1,879.00	254,040,800	
	テレビ朝日ホールディングス	35,500	2,066.00	73,343,000	
	スカパーJ S A Tホールディングス	177,100	666.00	117,948,600	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	日本電信電話	143,200	4,972.00	711,990,400	
	K D D I	145,900	3,118.00	454,916,200	
	N T T ドコモ	117,700	2,613.50	307,608,950	
	カドカワ	10,100	1,703.00	17,200,300	
	学研ホールディングス	12,000	253.00	3,036,000	
	D T S	4,800	2,148.00	10,310,400	
	ジャステック	27,700	925.00	25,622,500	
	T K C	4,200	3,130.00	13,146,000	
	N S D	56,900	1,718.00	97,754,200	
	ソフトバンクグループ	55,700	5,632.00	313,702,400	
	伊藤忠食品	6,600	4,355.00	28,743,000	
	フィールズ	1,600	1,959.00	3,134,400	
	双日	486,700	242.00	117,781,400	
	伊藤忠商事	160,300	1,444.00	231,473,200	
	丸紅	388,800	617.30	240,006,240	
	長瀬産業	5,600	1,281.00	7,173,600	
	三井物産	184,500	1,419.00	261,805,500	
	日立ハイテクノロジーズ	5,400	3,130.00	16,902,000	
	スターゼン	900	3,360.00	3,024,000	
	住友商事	276,900	1,210.50	335,187,450	
	内田洋行	8,000	428.00	3,424,000	
	三菱商事	37,100	2,050.00	76,055,000	
	キャノンマーケティングジャパン	29,700	2,040.00	60,588,000	
	ワキタ	12,800	938.00	12,006,400	
	東邦ホールディングス	13,900	2,393.00	33,262,700	
	サンゲツ	20,800	2,156.00	44,844,800	
	P A L T A C	16,900	2,052.00	34,678,800	
	スズケン	14,700	3,910.00	57,477,000	
	カワチ薬品	34,300	2,059.00	70,623,700	
	ゲオホールディングス	6,600	1,979.00	13,061,400	
	エディオン	86,700	883.00	76,556,100	
	あみやき亭	3,100	4,515.00	13,996,500	
	クオール	3,900	1,703.00	6,641,700	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	DCMホールディングス	32,200	833.00	26,822,600	
	ドトール・日レスホールディングス	91,600	1,883.00	172,482,800	
	マツモトキヨシホールディングス	48,300	5,750.00	277,725,000	
	ココカラファイン	5,500	4,850.00	26,675,000	
	セブン&アイ・ホールディングス	21,000	4,758.00	99,918,000	
	クスリのアオキ	3,100	5,980.00	18,538,000	
	良品計画	5,000	22,440.00	112,200,000	
	コーナン商事	17,100	1,726.00	29,514,600	
	島忠	2,800	2,677.00	7,495,600	
	AOKIホールディングス	3,300	1,396.00	4,606,800	
	青山商事	32,100	4,355.00	139,795,500	
	ユニーグループ・ホールディングス	48,400	787.00	38,090,800	
	平和堂	3,500	2,404.00	8,414,000	
	王将フードサービス	1,800	4,215.00	7,587,000	
	アークス	21,900	2,595.00	56,830,500	
	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,399,100	553.00	773,702,300	
	三井住友フィナンシャルグループ	128,700	3,609.00	464,478,300	
	西日本シティ銀行	60,000	209.00	12,540,000	
	ふくおかフィナンシャルグループ	54,000	389.00	21,006,000	
	みずほフィナンシャルグループ	656,300	179.10	117,543,330	
	北洋銀行	80,000	302.00	24,160,000	
	ジャフコ	37,100	3,535.00	131,148,500	
	水戸証券	32,700	336.00	10,987,200	
	極東証券	40,200	1,484.00	59,656,800	
	損保ジャパン日本興亜ホールディングス	54,400	3,171.00	172,502,400	
	東京海上ホールディングス	41,800	3,897.00	162,894,600	
	芙蓉総合リース	25,500	4,780.00	121,890,000	
	東京センチュリーリース	33,300	4,080.00	135,864,000	
	オリックス	245,500	1,624.50	398,814,750	
	三菱UFJリース	22,000	510.00	11,220,000	
	野村不動産ホールディングス	11,100	2,125.00	23,587,500	
	サムティ	4,800	1,117.00	5,361,600	
	東急不動産ホールディングス	34,600	762.00	26,365,200	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	飯田グループホールディングス	104,100	2,210.00	230,061,000	
	三井不動産	55,000	2,790.50	153,477,500	
	平和不動産	10,700	1,438.00	15,386,600	
	イオンモール	11,200	1,690.00	18,928,000	
	トーセイ	18,600	777.00	14,452,200	
	日本M&Aセンター	1,300	6,180.00	8,034,000	
	スタジオアリス	6,600	2,490.00	16,434,000	
	ディー・エヌ・エー	21,600	1,957.00	42,271,200	
	電通	22,200	5,560.00	123,432,000	
	みらかホールディングス	2,300	4,755.00	10,936,500	
	ダスキン	14,500	2,127.00	30,841,500	
	明光ネットワークジャパン	4,400	1,215.00	5,346,000	
	ラウンドワン	15,500	675.00	10,462,500	
	スペース	5,600	1,362.00	7,627,200	
	セコム	11,700	8,520.00	99,684,000	
	メイテック	14,500	4,110.00	59,595,000	
	アサツー ディ・ケイ	31,100	2,982.00	92,740,200	
合計				23,406,494,420	

(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

（平成28年3月31日現在）

資産総額	8,835,955,594円
負債総額	14,142,054円
純資産総額（ - ）	8,821,813,540円
発行済口数	9,740,636,468口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9057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>

（平成28年3月31日現在）

資産総額	23,868,379,206円
負債総額	24,067,485円
純資産総額（ - ）	23,844,311,721円
発行済口数	15,172,573,725口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5715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

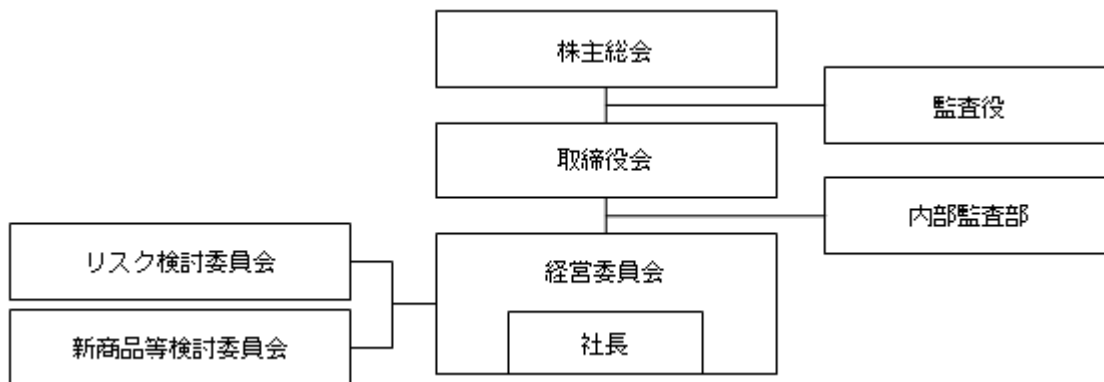
発行する株式の総数：8,000株

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、マルチプロダクト・ファンド部およびオルタナティブ投資室があります。



投資運用の意思決定には、委託会社が属するゴールドマン・サックスの資産運用グループのリソースが活用されます。委託会社の運用本部はゴールドマン・サックスの資産運用グループのポートフォリオ・マネジメント・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

2016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	106	1,584,718,042,550
合計	106	1,584,718,042,550

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

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

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

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期事業年度（平成27年4月1日から平成27年12月31日まで）の財務諸表について、PwCあらた監査法人により監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているあらた監査法人は、平成27年7月1日に名称を変更し、PwCあらた監査法人となりました。

(1) 貸借対照表

期別		第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12月31日現在)		
資産の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動資産							
現金・預金			6,748,612			8,541,657	
有価証券			13,297,906			12,097,990	
支払委託金			39			26	
収益分配金		39			26		
前払費用			18			157	
未収委託者報酬			1,842,228			1,527,034	
未収運用受託報酬			1,578,480			1,885,724	
未収収益			368,604			11,848	
繰延税金資産			826,971			1,079,356	
流動資産計			24,662,860	88.5		25,143,796	90.7
固定資産							
投資その他の資産			3,193,568			2,580,738	
投資有価証券		1,596,511			573,290		
長期差入保証金		10,000			10,000		
繰延税金資産		1,587,056			1,997,448		
固定資産計			3,193,568	11.5		2,580,738	9.3
資産合計			27,856,428	100.0		27,724,534	100.0

期別		第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12月31日現在)		
負債の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動負債							
預り金			599			580	
未払金			585,816			538,691	
未払収益分配金		229			242		
未払償還金		72			72		
未払手数料		585,514			538,376		
未払費用			3,406,376			4,518,812	
未払法人税等			957,171			888,102	
未払消費税等			470,936			205,603	
流動負債計			5,420,899	19.5		6,151,789	22.2
固定負債							
長期未払費用			6,285,478			7,097,924	
固定負債計			6,285,478	22.6		7,097,924	25.6
負債合計			11,706,378	42.0		13,249,714	47.8

期別	第20期 (平成27年3月31日現在)			第21期 (平成27年12月31日現在)			
純資産の部							
科目		内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
株主資本							
資本金			490,000			490,000	
資本剰余金			390,000			390,000	
資本準備金		390,000			390,000		
利益剰余金			14,867,795			13,545,174	
その他利益剰余金		14,867,795			13,545,174		
繰越利益剰余金		14,867,795			13,545,174		
株主資本合計			15,747,795	56.5		14,425,174	52.0
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		402,254			49,646		
評価・換算差額等合計			402,254	1.4		49,646	0.2
純資産合計			16,150,050	58.0		14,474,820	52.2
負債・純資産合計			27,856,428	100.0		27,724,534	100.0

(2) 損益計算書

期別		第20期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日			第21期 自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日					
		科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比	
経常 損益 の部	営業 損益 の部	営業収益		千円	千円	%	千円	千円	%	
		委託者報酬			14,066,674		11,823,135			
		運用受託報酬	* 2		9,173,012		6,961,333			
		その他営業収益	* 2		5,932,747		4,316,802			
		営業収益計			29,172,434	100.0	23,101,271	100.0		
		営業費用								
		支払手数料			6,754,210		5,363,613			
		広告宣伝費			139,448		102,758			
		調査費			6,692,987		5,350,334			
		委託調査費	* 2	6,692,987			5,350,334			
		委託計算費			220,885		159,321			
		営業雑経費			384,844		197,324			
		通信費		205,675			9,974			
		印刷費		147,770			161,506			
		協会費		31,398			25,843			
		営業費用計			14,192,375	48.6	11,173,351	48.4		
		一般管理費								
		給料			7,106,650		5,734,984			
		役員報酬		228,309			185,510			
		給料・手当		2,654,259			2,319,237			
		賞与		1,251,694			746,339			
		株式従業員報酬	* 1	1,027,305			797,337			
		その他の報酬		1,945,082			1,686,559			
		交際費			84,594		57,202			
		寄付金			71,518		63,290			
		旅費交通費			234,673		187,482			
		租税公課			83,891		71,744			
		不動産賃借料			416,707		268,044			
		退職給付費用			842,766		698,807			
		事務委託費			376,536		398,407			
諸経費			998,793		941,860					
一般管理費計			10,216,131	35.0	8,421,824	36.5				
営業利益			4,763,926	16.3	3,506,095	15.2				

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

(3) 株主資本等変動計算書

第20期
(自平成26年 4 月 1 日 至平成27年 3 月31日)

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成26年 4 月 1 日残高	490,000	390,000	390,000	15,752,528	15,752,528	16,632,528	235,400	235,400	16,867,928
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000			3,000,000
当期純利益				2,115,267	2,115,267	2,115,267			2,115,267
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							166,854	166,854	166,854
事業年度中の変動額合計	-	-	-	884,732	884,732	884,732	166,854	166,854	717,878
平成27年 3 月31日残高	490,000	390,000	390,000	14,867,795	14,867,795	15,747,795	402,254	402,254	16,150,050

第21期
(自平成27年 4 月 1 日 至平成27年12月31日)

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成27年 4 月 1 日残高	490,000	390,000	390,000	14,867,795	14,867,795	15,747,795	402,254	402,254	16,150,050
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				4,000,000	4,000,000	4,000,000			4,000,000
当期純利益				2,677,378	2,677,378	2,677,378			2,677,378
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							352,608	352,608	352,608
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,322,621	1,322,621	1,322,621	352,608	352,608	1,675,229
平成27年12月31日残高	490,000	390,000	390,000	13,545,174	13,545,174	14,425,174	49,646	49,646	14,474,820

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>その他有価証券 時価のあるもの 時価をもって貸借対照表価額とし、取得原価（移動平均法による原価法）ないし償却原価との評価差額については全部純資産直入法によっております。</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法によっております。</p>
2. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 金融商品取引責任準備金 金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 役員及び従業員に付与されております、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬については、企業会計基準第8号「ストック・オプション等に関する会計基準」及び企業会計基準適用指針第11号「ストック・オプション等に関する会計基準の適用指針」に準じて、権利付与日公正価値及び付与された株数に基づき計算される費用を権利確定計算期間にわたり人件費（一般管理費）として処理しております。また、ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクおよびゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社との契約に基づき当社が負担する、権利付与日以降の株価の変動により発生する損益については営業外損益として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p> <p>(3) 決算日の変更に関する事項 当社は平成27年6月26日開催の株主総会で決算日を3月31日から12月31日に変更致しました。これに伴い、平成27年12月期の会計年度は平成27年4月1日から平成27年12月31日までの9ヶ月間となりました。</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

第20期 (平成27年3月31日現在)	第21期 (平成27年12月31日現在)
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(損益計算書関係)

第20期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第21期 (自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日)																				
<p>* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。</p> <p>* 2 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">営業収益</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">2,942,406千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">5,828,635千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">営業費用</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">6,692,987千円</td> </tr> </table>	営業収益		運用受託報酬	2,942,406千円	その他営業収益	5,828,635千円	営業費用		委託調査費	6,692,987千円	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td colspan="2">営業収益</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">運用受託報酬</td> <td style="text-align: right;">1,882,545千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">その他営業収益</td> <td style="text-align: right;">4,175,357千円</td> </tr> <tr> <td colspan="2">営業費用</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">委託調査費</td> <td style="text-align: right;">5,350,334千円</td> </tr> </table>	営業収益		運用受託報酬	1,882,545千円	その他営業収益	4,175,357千円	営業費用		委託調査費	5,350,334千円
営業収益																					
運用受託報酬	2,942,406千円																				
その他営業収益	5,828,635千円																				
営業費用																					
委託調査費	6,692,987千円																				
営業収益																					
運用受託報酬	1,882,545千円																				
その他営業収益	4,175,357千円																				
営業費用																					
委託調査費	5,350,334千円																				

（株主資本等変動計算書関係）

第20期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成26年12月12日 臨時株主総会	普通株式	3,000,000	468,750	平成26年12月18日	平成26年12月18日

第21期（自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

1．発行済株式に関する事項

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

2．配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成27年12月18日 臨時株主総会	普通株式	4,000,000	625,000	平成27年12月21日	平成27年12月21日

（リース取引関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（金融商品関係）

第20期
（自 平成26年4月1日
至 平成27年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

信用リスク

当社の信用リスクは主に、銀行預金、コマーシャル・ペーパー、営業債権（当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬等）に係るものがあります。

銀行預金に係る信用リスクについては、預金先銀行の信用力を口座開設時およびその後継続的に評価することによって管理しております。

コマーシャル・ペーパーに係る信用リスクについては、発行体をゴールドマン・サックスのグループ会社とし、定期的に金額その他条件を見直すことによって管理しております。

また、営業債権は一年以内に回収される債権であり、社内規程に沿ってリスク管理を行っております。なお、過去に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できなかったケースはございません。

市場リスク

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

流動性および資金調達リスク

当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、ゴールドマン・サックスのグループ会社との間で融資枠を設定し、緊急時の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第20期
（自 平成26年4月1日
至 平成27年3月31日）

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	6,748,612	6,748,612	-
有価証券			
その他有価証券	13,297,906	13,297,906	-
未収委託者報酬	1,842,228	1,842,228	-
未収運用受託報酬	1,578,480	1,578,480	-
投資有価証券			
その他投資有価証券	1,596,511	1,596,511	-

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	6,748,612	-	-	-	-	-
有価証券						
その他有価証券の うち満期があるもの	13,300,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,842,228	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,578,480	-	-	-	-	-

第21期
（自 平成27年4月1日
至 平成27年12月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

信用リスク

当社の信用リスクは主に、銀行預金、コマーシャル・ペーパー、営業債権（当社が運用する投資信託から受領する委託者報酬及び投資一任契約に基づき顧客から受領する運用受託報酬等）に係るものがあります。

銀行預金に係る信用リスクについては、預金先銀行の信用力を口座開設時およびその後継続的に評価することによって管理しております。

コマーシャル・ペーパーに係る信用リスクについては、発行体をゴールドマン・サックスのグループ会社とし、定期的に金額その他条件を見直すことによって管理しております。

また、営業債権は一年以内に回収される債権であり、社内規程に沿ってリスク管理を行っております。なお、過去に未収委託者報酬及び未収運用受託報酬を回収できなかったケースはございません。

市場リスク

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

流動性および資金調達リスク

当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、ゴールドマン・サックスのグループ会社との間で融資枠を設定し、緊急時の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第21期
（自 平成27年4月1日
至 平成27年12月31日）

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成27年12月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	8,541,657	8,541,657	-
有価証券			
其他有価証券	12,097,990	12,097,990	-
未収委託者報酬	1,527,034	1,527,034	-
未収運用受託報酬	1,885,724	1,885,724	-
投資有価証券			
其他投資有価証券	573,290	573,290	-

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	8,541,657	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券のうち満期があるもの	12,100,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,527,034	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,885,724	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）					第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）				
1. その他有価証券で時価のあるもの					1. その他有価証券で時価のあるもの				
区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）	区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	1,002,000	1,596,511	594,511	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	500,000	573,290	73,290
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	13,297,906	13,297,906	-	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	12,097,990	12,097,990	-
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券					2. 当事業年度中に売却したその他有価証券				
売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）			売却額（千円）	売却益の合計額 （千円）	売却損の合計額 （千円）		
285,818	36,653	1,065			568,887	66,895	8		

（デリバティブ取引関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）
<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20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）	第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）																																												
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">735,838千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">67,023</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">24,108</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">826,971</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産（流動資産）</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">826,971</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,710,136</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">69,177</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,779,313</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">192,256</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">192,256</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,587,056千円</td> </tr> </table>	未払費用	735,838千円	未払事業税	67,023	その他	24,108	小計	826,971	繰延税金資産（流動資産）	826,971	長期未払費用	1,710,136	その他	69,177	小計	1,779,313	その他有価証券評価差額金	192,256	小計	192,256		1,587,056千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">980,373千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">64,201</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">34,781</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,079,356</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産（流動資産）</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,079,356</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,939,534</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">81,558</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">2,021,092</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">23,644</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">23,644</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）の純額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;"></td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,997,448千円</td> </tr> </table>	未払費用	980,373千円	未払事業税	64,201	その他	34,781	小計	1,079,356	繰延税金資産（流動資産）	1,079,356	長期未払費用	1,939,534	その他	81,558	小計	2,021,092	その他有価証券評価差額金	23,644	小計	23,644		1,997,448千円
未払費用	735,838千円																																												
未払事業税	67,023																																												
その他	24,108																																												
小計	826,971																																												
繰延税金資産（流動資産）	826,971																																												
長期未払費用	1,710,136																																												
その他	69,177																																												
小計	1,779,313																																												
その他有価証券評価差額金	192,256																																												
小計	192,256																																												
	1,587,056千円																																												
未払費用	980,373千円																																												
未払事業税	64,201																																												
その他	34,781																																												
小計	1,079,356																																												
繰延税金資産（流動資産）	1,079,356																																												
長期未払費用	1,939,534																																												
その他	81,558																																												
小計	2,021,092																																												
その他有価証券評価差額金	23,644																																												
小計	23,644																																												
	1,997,448千円																																												
<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率（調整）</td> <td style="text-align: right;">35.64 %</td> </tr> <tr> <td>賞与等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">10.62 %</td> </tr> <tr> <td>法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正</td> <td style="text-align: right;">5.57 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.11 %</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">51.94 %</td> </tr> </table>	法定実効税率（調整）	35.64 %	賞与等永久に損金に算入されない項目	10.62 %	法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	5.57 %	その他	0.11 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	51.94 %	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率（調整）</td> <td style="text-align: right;">33.06 %</td> </tr> <tr> <td>賞与等永久に損金に算入されない項目</td> <td style="text-align: right;">3.02 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">0.40 %</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">35.67 %</td> </tr> </table>	法定実効税率（調整）	33.06 %	賞与等永久に損金に算入されない項目	3.02 %	その他	0.40 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.67 %																										
法定実効税率（調整）	35.64 %																																												
賞与等永久に損金に算入されない項目	10.62 %																																												
法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	5.57 %																																												
その他	0.11 %																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	51.94 %																																												
法定実効税率（調整）	33.06 %																																												
賞与等永久に損金に算入されない項目	3.02 %																																												
その他	0.40 %																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.67 %																																												

第20期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第21期 (自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日)
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率及び事業税率の引下げが行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から、平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は225百万円減少し、法人税等調整額が245百万円増加しております。</p>	<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>該当事項はありません。</p>

〔セグメント情報等〕

第20期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	14,066,674	9,173,012	5,932,747	29,172,434

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
25,087,105	4,085,328	29,172,434

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

第21期（自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）

〔セグメント情報〕

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

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	11,823,135	6,961,333	4,316,802	23,101,271

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

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

営業収益は顧客の所在地を基礎とし、国又は地域に分類しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）										
親会社及び法人主要株主等										
種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	8 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 運用受託報酬（注1） 委託調査費の支払（注1）	5,828,635 2,942,406 6,692,987		
取引条件及び取引条件の決定方針等 （注1）その他営業収益、運用受託報酬、ならびに委託調査費の支払に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。 役員及び個人主要株主等 該当事項はありません。 兄弟会社等										
種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任 有価証券の購入	兼務従業員の 人件費等の支払（注1）	2,452,937	有価証券 未払費用	13,297,906 287,201
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 有限公司	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	6,803,100	未払費用 長期未払 費用	2,791,417 6,188,739
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・USA	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	8,000 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	1,975,463
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・インベストメント・ストラテジー・LLC	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	37 百万ドル	投資顧問業		投資助言			未収収益	354,819
取引条件及び取引条件の決定方針等 （注1）兼務従業員の人件費等の支払に関しては、グループ会社間の契約に基づき、決定しております。 （注2）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司（以下G S J H）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G S J Hより行われております。 但し、これらの費用はG S J H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G S J Hに対する債務として処理しております。										
親会社又は重要な関連会社に関する注記 親会社情報 ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク（ニューヨーク証券取引所に上場） ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー（未上場）										

第21期
（自 平成27年4月1日
至 平成27年12月31日）

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	8 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注1） 運用受託報酬（注1） 委託調査費（注1）	4,175,357 1,882,545 5,350,334		

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）その他営業収益、運用受託報酬、ならびに委託調査費に関しては、関係会社間の契約に基づき決定しております。

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有（被所有）割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（千円）	科目	期末残高（千円）
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任 有価証券の購入	兼務従業員の 人件費等 （注1）	2,233,594	有価証券	12,097,990
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス 有限公司	東京都港区	100 百万円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託		従業員出向受入等 役員の兼任	出向者に関する 人件費等 （注2）	5,538,780	未払費用 長期未払費用	3,776,015 7,075,447
親会社の子会社	ゴールドマン・サックス・バンク・USA	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	8,000 百万ドル	銀行業		現金の預入			現金・預金	1,344,386

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（注2）ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限公司（以下G S J H）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G S J Hより行われております。

但し、これらの費用はG S J H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G S J Hに対する債務として処理しております。

親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

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

（1株当たり情報）

第20期 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）		第21期 （自 平成27年4月1日 至 平成27年12月31日）	
1株当たり純資産額	2,523,445円38銭	1株当たり純資産額	2,261,690円72銭
1株当たり当期純利益金額	330,510円53銭	1株当たり当期純利益金額	418,340円43銭
損益計算書上の当期純利益	2,115,267千円	損益計算書上の当期純利益	2,677,378千円
1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	2,115,267千円	1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	2,677,378千円
差額	-	差額	-
期中平均株式数		期中平均株式数	
普通株式	6,400株	普通株式	6,400株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載しておりません。		同左	

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

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

5 その他

- (1) 委託会社に関し、株主総会の決議により、2016年1月1日付けで株券の不発行に関する定款の変更を行いました。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28年4月20日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木貴司
指定社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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27年9月25日から平成28年3月22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28年3月22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28年3月1日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

P w C あらた監査法人

指定社員 業務執行社員	公認会計士	佐々木貴司
指定社員 業務執行社員	公認会計士	山口 健志

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成27年12月31日までの第21期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成27年12月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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