

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年12月16日
【発行者名】	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 土岐 大介
【本店の所在の場所】	東京都港区六本木六丁目10番1号 六本木ヒルズ森タワー
【事務連絡者氏名】	法務部 山崎 誠吾
【電話番号】	03 - 6437 - 6000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	G S 外国株式インデックス・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22年6月16日付で提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項に変更が生じ、また、本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、原届出書の関係事項を新たな情報により訂正するため、本訂正届出書を提出するものであります。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下のとおり訂正または更新します。

下線部__が訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(12) その他

<訂正前>

(前略)

(ご参考) ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

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

2010年6月16日現在、委託会社が認識し得る2010年12月末までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

<訂正後>

(前略)

(ご参考) ファンドの海外休業日

ロンドンまたはニューヨークの休業日

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

2010年12月16日現在、委託会社が認識し得る2011年6月末までの「ロンドンまたはニューヨークの休業日」です。(休業日は変更されることがありますので、必ず事前に販売会社までお問い合わせください。)

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

<訂正前>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

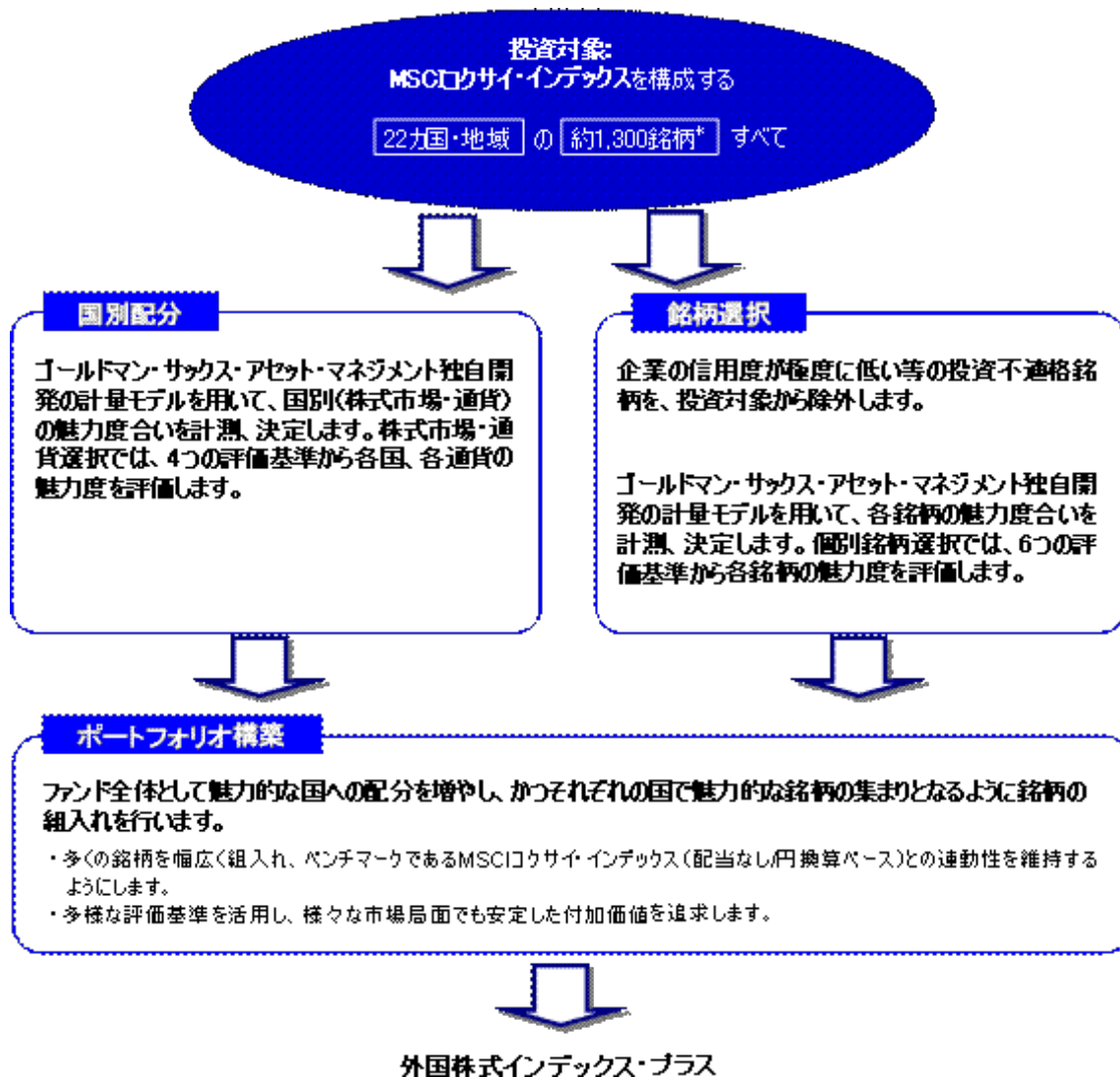
(中略)

- b. 日本を除く世界の株式市場全体を表すMSCIコクサイ・インデックス（配当なし/円換算ベース）をベンチマークとします。



ベンチマークとは、運用において投資収益目標を設定する際に基準とする指標です。また、投資家がファンドの運用対象や資産の基本配分比率を確認する際の目安となります。

c. ベンチマークとの連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益の獲得を追求します。



ベンチマークとの連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益を獲得することを目指します。

* M S C I コクサイ・インデックスの構成銘柄以外についても評価対象としており、組み入れられる場合があります。

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

(中略)

(2) 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)

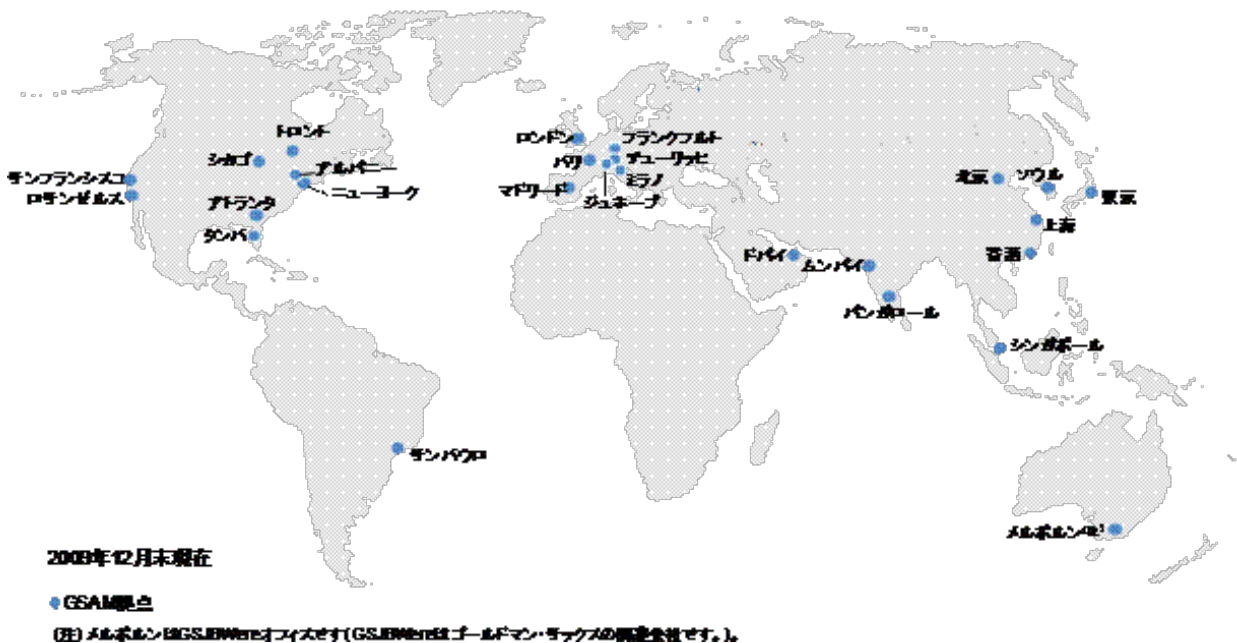
<ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)とは>

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

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

*米ドルの円貨換算は便宜上、2009年12月30日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル＝92.10円）により計算しております。

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



(後略)

<訂正後>

(1) ファンドの目的及び基本的性格

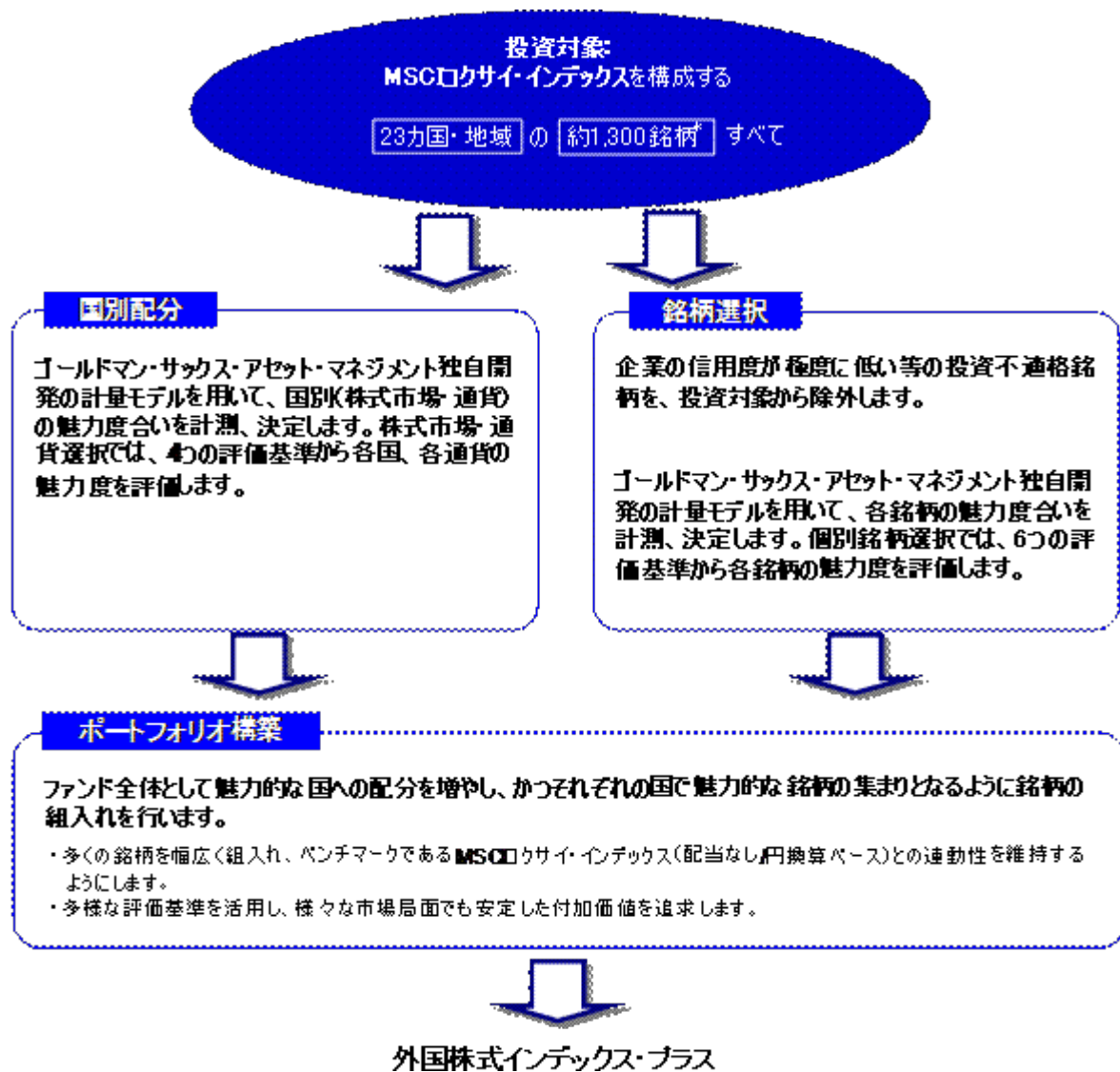
(中略)

- b. 日本を除く世界の株式市場全体を表すMSCIコクサイ・インデックス（配当なし/円換算ベース）をベンチマークとします。



ベンチマークとは、運用において投資収益目標を設定する際に基準とする指標です。また、投資家がファンドの運用対象や資産の基本配分比率を確認する際の目安となります。

c. ベンチマークとの連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益の獲得を追求します。



ベンチマークとの連動性を維持しながら、ベンチマークを上回る収益を獲得することを目指します。

* M S C I コクサイ・インデックスの構成銘柄以外についても評価対象としており、組み入れられる場合があります。

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

(中略)

(2) 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)

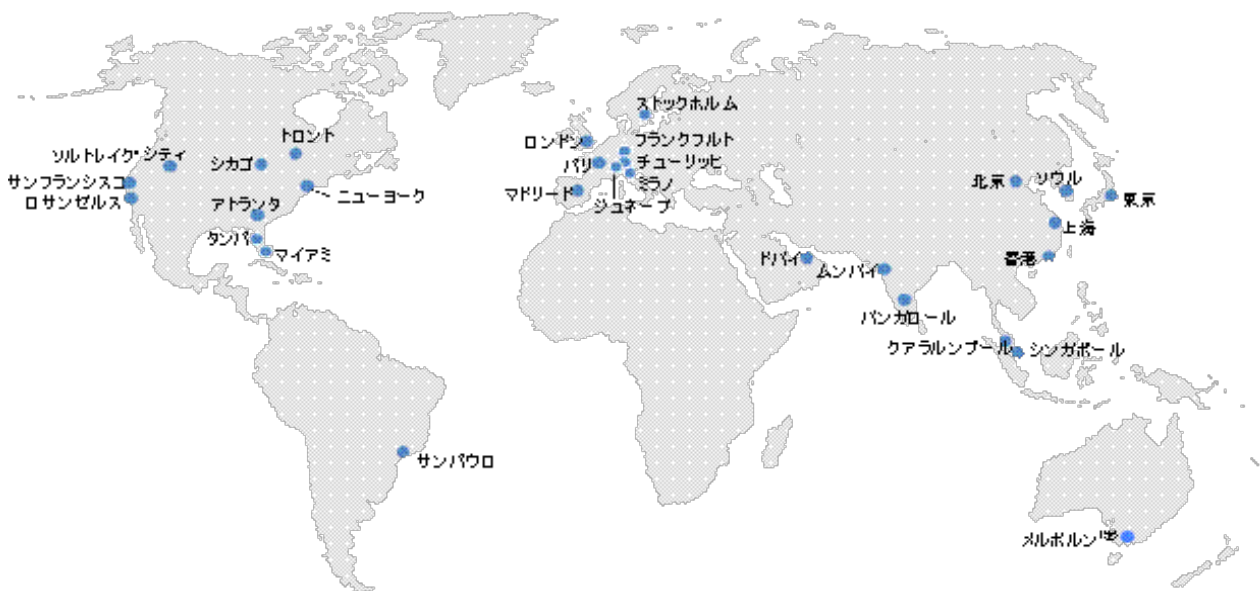
<ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント(GSAM)とは>

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

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

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

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



⑧メルボルンはGoldman Sachs & Partners Australia Pty Ltdのオフィスです。

(後略)

2 投資方針

(3) 運用体制

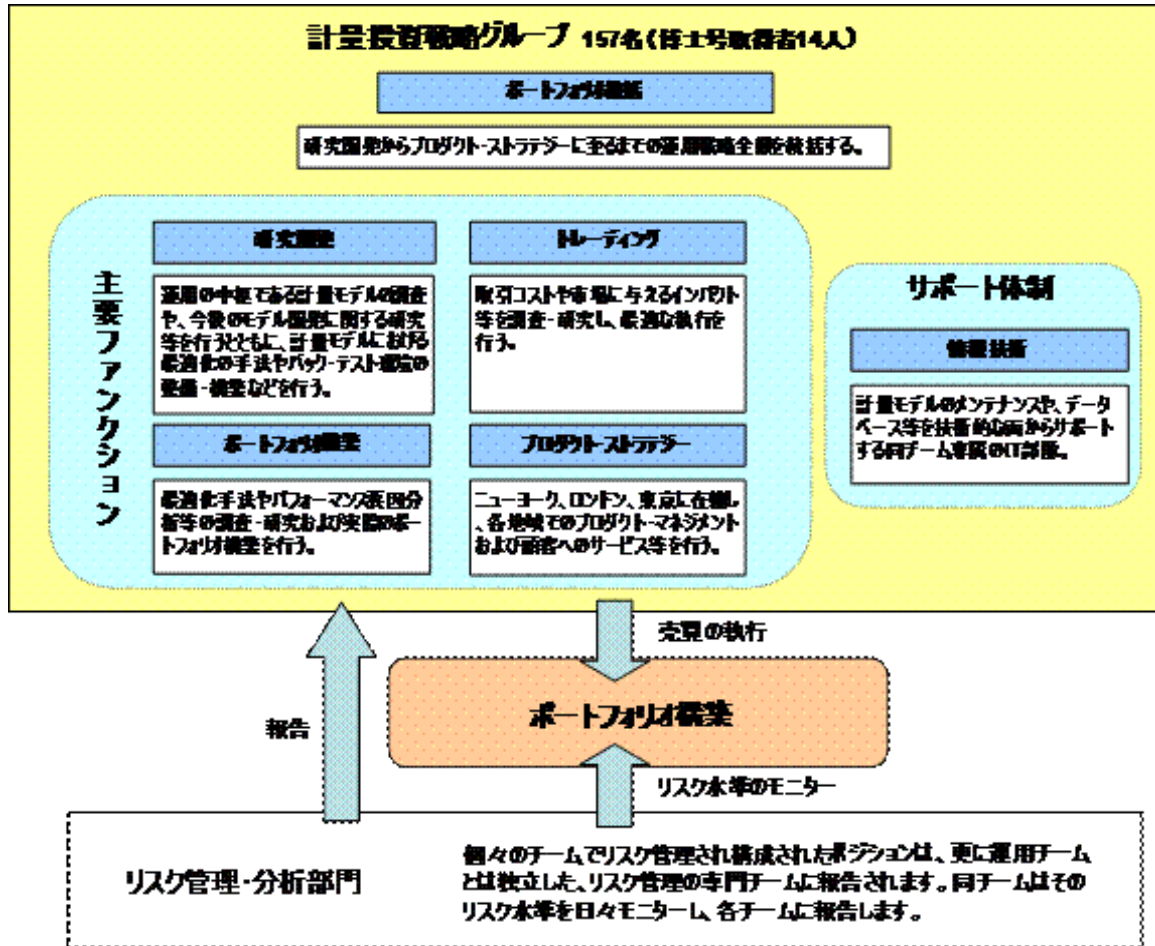
<訂正前>

a. 組織

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

同グループの組織体制の特徴としては、経験・知識を共有化するチーム運用体制、豊富な実務経験と学識経験の融合といったことが挙げられます。

また、運用チームとは独立した「リスク管理・分析部門」がファンドのリスク管理を行います。



2010年1月現在

(注1) リスク管理とは、ベンチマークの収益率と本ファンドの収益率とのかい離の散らばり具合を、一定の範囲に留めることを目指すことです。かい離幅がかかる一定の範囲におさまることを保証するものではなく、また、必ずしもリスクの低減を目的とするものではありません。

(注2) 上記運用体制およびリスク管理体制は、将来変更される場合があります。

投資哲学

市場における効率性は完全なものではなく、従って伝統的なファンダメンタル分析と洗練された計量的なモデリングの融合による計量的アプローチを継続的に用いるならば、アクティブ運用による付加価値の獲得は可能であると考えます。

運用資産残高

合計：5兆4,535億円（計量投資戦略グループの全運用資産）

2009年12月末現在、1米ドル = 92.10円換算。

b．運用体制に関する社内規則等

ファンドの運用に関する社内規則として、ポートフォリオ・マネジャーが遵守すべき服務規程のほか、有価証券などの売買執行基準およびその遵守手続きなどに関して取扱い基準を設けることにより、法令遵守の徹底を図るとともに、利益相反となる取引、インサイダー取引等を防止し、かつ売買執行においては最良執行に努めています。（運用の全部または一部を海外に外部委託する場合には、現地の法令および諸規則にもあわせて従うこととなります。）

c．内部管理体制

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

（後略）

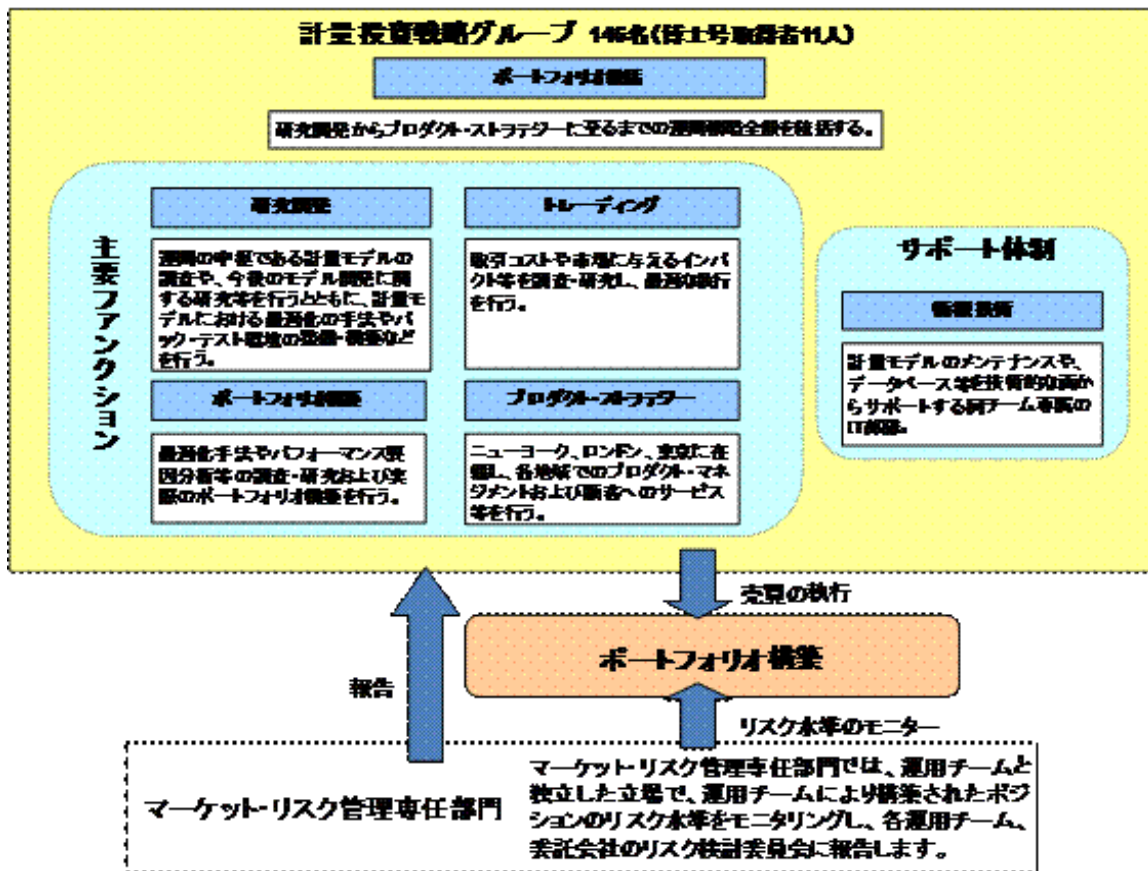
<訂正後>

a. 組織

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

同グループの組織体制の特徴としては、経験・知識を共有化するチーム運用体制、豊富な実務経験と学識経験の融合といったことが挙げられます。

また、運用チームとは独立した「マーケット・リスク管理専任部門」がファンドのリスク管理を行います。



2010年6月現在

(注1) リスク管理とは、ベンチマークの収益率と本ファンドの収益率とのかい離の散らばり具合を、一定の範囲に留めることを目指すことです。かい離幅がかかる一定の範囲におさまることを保証するものではなく、また、必ずしもリスクの低減を目的とするものではありません。

(注2) 上記運用体制およびリスク管理体制は、将来変更される場合があります。

投資哲学

市場における効率性は完全なものではなく、従って伝統的なファンダメンタル分析と洗練された計量的なモデリングの融合による計量的アプローチを継続的に用いるならば、アクティブ運用による付加価値の獲得は可能であると考えます。

運用資産残高

合計：3兆9,735億円（計量投資戦略グループの全運用資産）

2010年6月末現在、1米ドル = 88.48円換算。

b. 運用体制に関する社内規則等

ファンドの運用に関する社内規則として、ポートフォリオ・マネジャーが遵守すべき服務規程のほか、有価証券などの売買執行基準およびその遵守手続きなどに関して取扱い基準を設けることにより、法令遵守の徹底を図るとともに、利益相反となる取引、インサイダー取引等を防止し、かつ売買執行においては最良執行に努めています。（運用の全部または一部を海外に外部委託する場合には、現地の法令および諸規則にもあわせて従うこととなります。）

c. 内部管理体制

委託会社は、リスク検討委員会を設置しています。リスク検討委員会は、法務部、コンプライアンス部を含む各部署の代

表から構成されており、マーケット・リスク管理専任部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、検討、決定等を月次で行います。

(後略)

3 投資リスク

<訂正前>

(1) 投資リスク

本ファンドへの投資には、一定のリスクを伴います。本ファンドの購入申込者は、以下に掲げる本ファンドに関するリスクおよび留意点を十分にご検討いただく必要があります。なお、以下に記載するリスクおよび留意点は、本ファンドに関わるすべてのリスクおよび留意点を完全に網羅しないことにつき、ご留意下さい。

(a) 元本変動リスク

本ファンドへの投資には、資産価値に影響を及ぼす様々なリスクが伴いますので、基準価額が投資元本を下回る可能性があります。したがって、元金は保証されていません。

主なリスクとして以下のものが挙げられます。

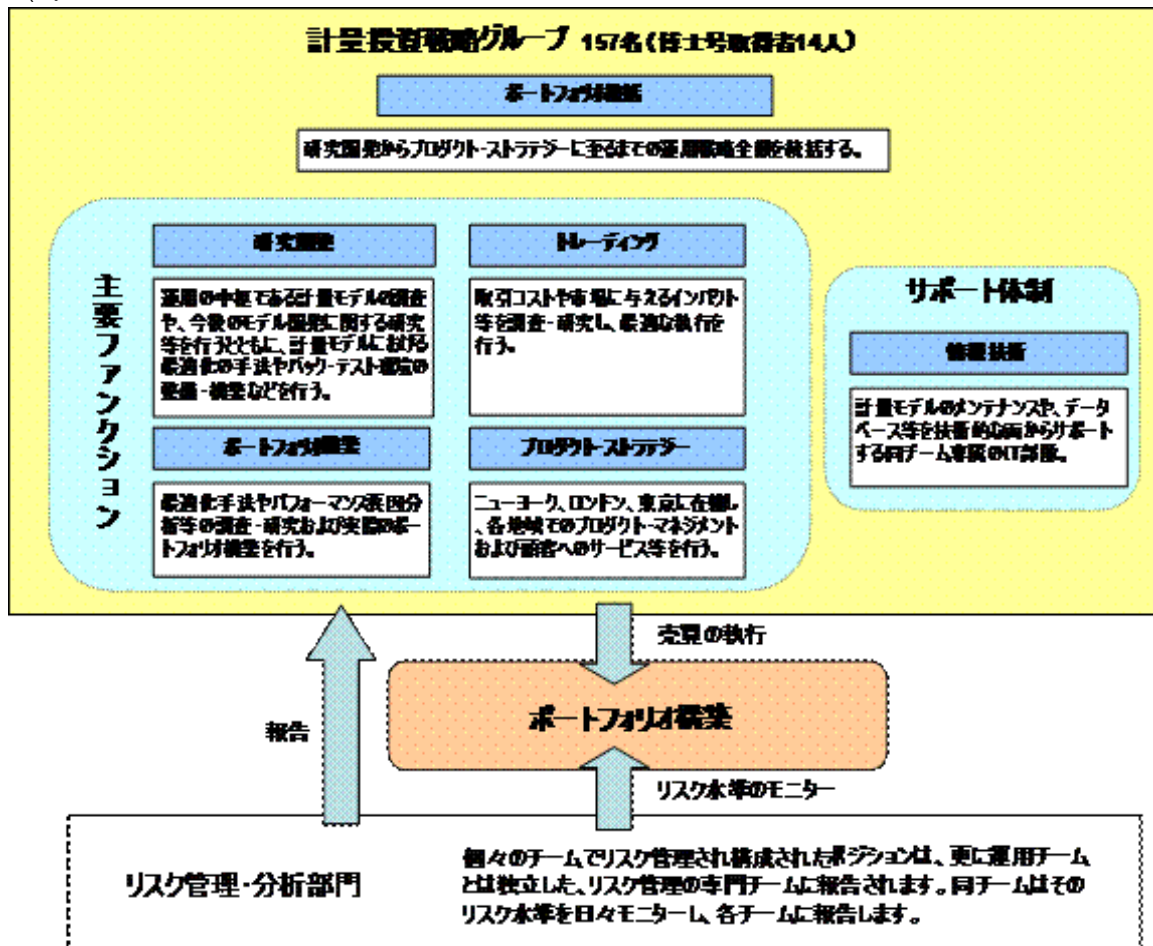
(中略)

(i) その他の留意点

収益分配金・一部解約金・償還金の支払いはすべて販売会社を通じて行われます。それぞれの場合においてその金額が販売会社に対して支払われた後は、委託会社は受益者への支払いについての責任を負いません。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用について、販売会社は販売(お買付代金の預り等を含みます。)について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。

(2) 投資リスクに対する管理体制



2010年1月現在

(注1) リスク管理とは、ベンチマークの収益率と本ファンドの収益率とのかい離の散らばり具合を、一定の範囲に留めることを目指すことです。かい離幅がかかる一定の範囲におさまることを保証するものではなく、また、必ずしもリスクの低減を目的とするものではありません。

(注2) 上記運用体制およびリスク管理体制は、将来変更される場合があります。

<訂正後>

(1) 投資リスク

本ファンドへの投資には、一定のリスクを伴います。本ファンドの購入申込者は、以下に掲げる本ファンドに関するリスクおよび留意点を十分にご検討いただく必要があります。なお、以下に記載するリスクおよび留意点は、本ファンドに関わるすべてのリスクおよび留意点を完全に網羅しないことにつき、ご留意下さい。

(a) 元本変動リスク

本ファンドへの投資には、資産価値に影響を及ぼす様々なリスクが伴いますので、基準価額が投資元本を下回る可能性があります。したがって、元金は保証されていません。

主なリスクとして以下のものが挙げられます。

(中略)

(i) その他の留意点

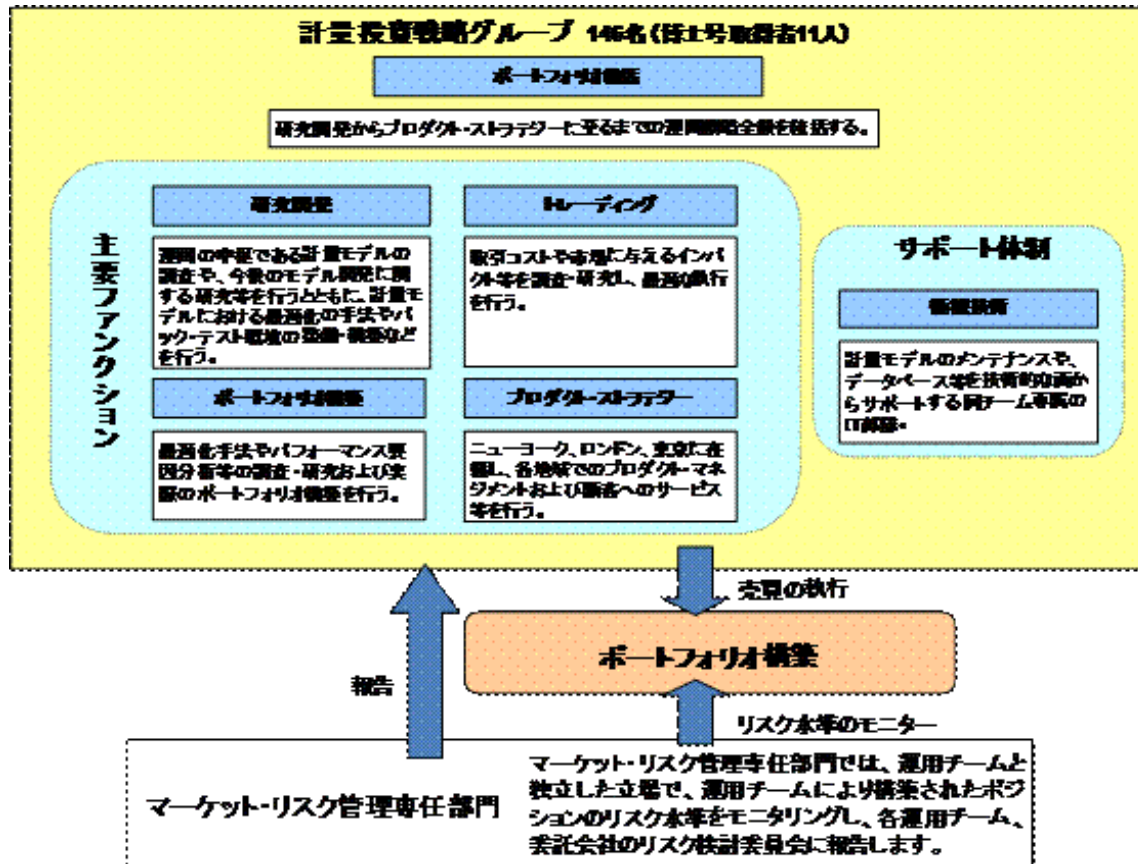
収益分配金・一部解約金・償還金の支払いはすべて販売会社を通じて行われます。それぞれの場合においてその金額が販売会社に対して支払われた後は、委託会社は受益者への支払いについての責任を負いません。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用について、販売会社は販売(お買付代金の預り等を含みます。)について、それぞれ責任を有し、互いに他について責任を有しません。

(j) 繰上償還に関わる留意点

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

(2) 投資リスクに対する管理体制



2010年6月現在

(注1) リスク管理とは、ベンチマークの収益率と本ファンドの収益率とのかい離の散らばり具合を、一定の範囲に留めることを目指すことです。かい離幅がかかる一定の範囲におさまることを保証するものではなく、また、必ずしもリスクの低減を目的とするものではありません。

(注2) 上記運用体制およびリスク管理体制は、将来変更される場合があります。

5【運用状況】

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

<訂正・更新後>

(1) 投資状況

(2010年9月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券		62,993,716	100.06
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		35,662	0.06
合計(純資産総額)		62,958,054	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外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

(2010年9月30日現在)

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	18,346,928,482	47.37
	カナダ	1,290,543,553	3.33
	ドイツ	1,353,244,042	3.49
	イタリア	84,371,745	0.22
	フランス	2,520,549,264	6.51
	オーストラリア	226,264,488	0.58
	イギリス	2,829,479,159	7.31
	スイス	712,645,375	1.84
	バミューダ	4,714,983	0.01
	シンガポール	468,732,777	1.21
	ニュージーランド	17,090,829	0.04
	オランダ	1,750,432,925	4.52
	ベルギー	1,713,767,550	4.42
	スウェーデン	3,018,593,664	7.79
	ノルウェー	1,493,873,190	3.86
	オーストリア	571,347,380	1.48
	デンマーク	170,617,918	0.44
	アイルランド	650,859,466	1.68
	イスラエル	157,801,410	0.41
	ケイマン	13,378,855	0.03
モーリシャス	30,558,308	0.08	
パナマ	45,282,697	0.12	
ガーンジー	23,377,867	0.06	
小計		37,494,455,927	96.81

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	636,123,243	1.64
	フランス	83,451,577	0.22
	オーストラリア	15,345,107	0.04
	イギリス	36,486,333	0.09
	シンガポール	16,802,774	0.04
小計		788,209,034	2.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		447,082,170	1.15
合計(純資産総額)		38,729,747,131	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2010年9月30日現在)

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量(口数)	帳簿価額単価(円)	帳簿価額金額(円)	評価額単価(円)	評価額金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	GS外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド	72,373,296	0.8655	62,640,141	0.8704	62,993,716	100.06

種類別及び業種別投資比率

(2010年9月30日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.06
合計	100.06

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

投資不動産物件

(2010年9月30日現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2010年9月30日現在)

該当事項はありません。

参考情報

<GS外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド>

投資有価証券の主要銘柄

(2010年9月30日現在)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量 (株式数)	帳簿価額単価 (円)	帳簿価額金額 (円)	評価額単価 (円)	評価額金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	LORILLARD INC	飲料・タバコ	143,108	6,396.26	915,357,084	6,764.27	968,021,723	2.50
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	186,366	5,557.26	1,035,685,435	5,162.47	962,109,592	2.48
3	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	コンピューター	391,715	2,450.89	960,053,040	2,053.58	804,422,006	2.08
4	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品	215,848	3,018.35	651,506,580	3,061.94	660,914,618	1.71
5	アメリカ	株式	INTEL CORP	電子部品・計器	405,663	1,775.30	720,176,606	1,614.37	654,891,475	1.69
6	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	ヘルス・ケア	120,190	5,339.33	641,734,553	5,050.15	606,978,129	1.57
7	ベルギー	株式	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	食品・飲料・タバコ	121,192	4,182.32	506,864,501	4,978.57	603,363,970	1.56
8	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・石炭	87,400	6,166.63	538,964,108	6,812.88	595,446,551	1.54
9	アメリカ	株式	PFIZER INC	ヘルス・ケア	387,358	1,446.73	560,403,678	1,458.46	564,949,247	1.46
10	オランダ	株式	KONINKLIJKE DSM NV	化学	119,015	3,770.75	448,776,500	4,281.14	509,520,352	1.32
11	フランス	株式	TOTAL SA	石油・石炭	117,147	4,470.54	523,710,388	4,335.40	507,880,040	1.31
12	ドイツ	株式	E.ON AG	サービス	201,692	2,933.18	591,600,225	2,486.43	501,493,765	1.29
13	アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	サービス	139,580	3,562.35	497,232,813	3,545.58	494,892,893	1.28
14	ノルウェー	株式	STATOIL ASA	エネルギー	279,591	1,904.55	532,497,834	1,742.74	487,255,537	1.26
15	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	サービス	10,864	41,117.90	446,704,876	44,230.97	480,525,321	1.24
16	スウェーデン	株式	TELIASONERA AB	通信	676,585	644.07	435,771,822	683.35	462,348,419	1.19
17	スウェーデン	株式	NORDEA BANK AB	銀行	531,620	907.61	482,503,835	862.30	458,416,191	1.18
18	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	不動産	58,347	6,863.18	400,446,056	7,798.61	455,025,661	1.17
19	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	126,417	3,669.63	463,904,829	3,219.52	407,002,843	1.05
20	アメリカ	株式	AT&T INC	通信	167,615	2,160.87	362,195,834	2,406.47	403,360,837	1.04
21	ノルウェー	株式	TELENOR ASA	通信	301,581	1,134.71	342,209,027	1,333.19	402,065,376	1.04
22	アメリカ	株式	AMGEN INC	ヘルス・ケア	87,057	4,780.25	416,154,624	4,605.07	400,903,648	1.04
23	アメリカ	株式	CONOCOPHILLIPS	石油・石炭	81,859	4,329.30	354,392,414	4,807.91	393,571,130	1.02
24	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	電気・電子	269,093	1,449.24	389,982,438	1,371.29	369,005,939	0.95
25	アメリカ	株式	NORTHROP GRUMMAN CORP	宇宙・軍事産業	67,201	5,396.33	362,638,879	5,045.96	339,093,826	0.88
26	スウェーデン	株式	SKANSKA AB-B SHS	建設	214,529	1,582.75	339,547,814	1,540.04	330,384,313	0.85
27	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	380,967	903.48	344,197,093	861.02	328,023,368	0.85
28	アメリカ	株式	ORACLE CORP	コンピューター	142,462	2,080.41	296,379,711	2,277.38	324,441,448	0.84
29	ベルギー	株式	DELHAIZE GROUP	商業	52,495	6,794.99	356,703,273	6,107.27	320,601,159	0.83
30	イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品	71,873	3,893.79	279,859,008	4,295.19	308,708,280	0.80

種類別及び業種別投資比率

(2010年9月30日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	4.65
		電力・ガス	1.60
		建設資材	0.14
		化学	2.97
		木材,紙・パルプ	0.50
		非鉄金属	1.37
		鉄鋼	0.72
		宇宙・軍事産業	1.05
		建設・住宅	0.06
		コンピューター	3.91
		電気・電子	1.75
		電子部品・計器	3.39
		エネルギー関連機器・サービス	0.02
		機械・エンジニアリング	0.98
		家電	0.46
		自動車	2.06
		飲料・タバコ	5.11
		食品・日用品	2.34
		ヘルス・ケア	6.49
		レクリエーション	0.01
		繊維・アパレル	0.90
		放送・出版	1.05
		ビジネス・公共サービス	0.86
		レジャー旅行	0.58
		商業	2.97
		通信	7.04
		航空	1.00
		陸運業	0.20
		海運業	0.06
		銀行	9.69
		ファイナンシャル・サービス	1.04
		保険	2.64
		不動産	0.41
		複合産業	0.57
		金鉱	1.65
		農業	0.10
		石油・石炭	7.37
		建設	1.25
		金融・保険	1.93
		サービス	5.26
		電気機器	1.31
コングロマリット	0.83		
金属製品	0.09		
医薬品	4.38		
その他製造	1.43		
運輸	0.57		
自動車・自動車部品	0.12		
食品・生活必需品小売り	0.16		
食品・飲料・タバコ	1.56		
銀行	0.21		
投資証券	外国	不動産	2.04
合計			98.85

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

投資不動産物件

(2010年9月30日現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

有価証券先物取引等

(2010年9月30日現在)

資産の種類	地域	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	評価額金額	評価額金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	S&P500 EMINI	買建	32	米ドル	1,785,336	1,825,440	153,008,380	0.40
	カナダ	モントリオール取引所	S&P/TSE 60	買建	1	カナダドル	141,344	142,620	11,577,891	0.03
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO STOXX50	買建	23	ユーロ	640,817.95	630,430	72,020,323	0.19
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI 200	買建	1	オーストラリアドル	116,728.5	116,825	9,515,396	0.02
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 100	買建	4	英ポンド	222,085.4	221,860	29,434,166	0.08

(注1) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価比率をいいます。

(注2) 評価額は、計算日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。2つ以上の取引所に上場されていて、かつ当該取引所相互間で反対売買が可能な先物取引については、取引量を勘案して評価を行う取引所を決定しております。

(3) 運用実績

純資産の推移

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

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
1期	(2006年9月19日)	41	41	1.0762	1.0762
2期	(2007年3月16日)	51	51	1.1518	1.1518
3期	(2007年9月18日)	66	66	1.1943	1.1943
4期	(2008年3月17日)	61	61	0.9033	0.9033
5期	(2008年9月16日)	67	67	0.8441	0.8441
6期	(2009年3月16日)	33	33	0.4961	0.4961
7期	(2009年9月16日)	57	57	0.6740	0.6740
8期	(2010年3月16日)	63	63	0.7112	0.7112
9期	(2010年9月16日)	62	62	0.6635	0.6635
	2009年9月末日	57	-	0.6722	-
	2009年10月末日	57	-	0.6856	-
	2009年11月末日	56	-	0.6660	-
	2009年12月末日	61	-	0.7210	-
	2010年1月末日	57	-	0.6730	-
	2010年2月末日	58	-	0.6731	-
	2010年3月末日	64	-	0.7435	-
	2010年4月末日	68	-	0.7704	-
	2010年5月末日	59	-	0.6658	-
	2010年6月末日	56	-	0.6193	-
	2010年7月末日	61	-	0.6596	-
	2010年8月末日	56	-	0.6063	-
	2010年9月末日	62	-	0.6668	-

(注) 表中の末日とはその月の最終営業日を指します。

分配の推移

期	計算期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	自 2006年2月28日 至 2006年9月19日	0.0000
第2期	自 2006年9月20日 至 2007年3月16日	0.0000
第3期	自 2007年3月17日 至 2007年9月18日	0.0000
第4期	自 2007年9月19日 至 2008年3月17日	0.0000
第5期	自 2008年3月18日 至 2008年9月16日	0.0000
第6期	自 2008年9月17日 至 2009年3月16日	0.0000
第7期	自 2009年3月17日 至 2009年9月16日	0.0000
第8期	自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	0.0000
第9期	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日	0.0000

収益率の推移

期	計算期間	収益率（%）
第1期	自 2006年2月28日 至 2006年9月19日	7.6
第2期	自 2006年9月20日 至 2007年3月16日	7.0
第3期	自 2007年3月17日 至 2007年9月18日	3.7
第4期	自 2007年9月19日 至 2008年3月17日	24.4
第5期	自 2008年3月18日 至 2008年9月16日	6.6
第6期	自 2008年9月17日 至 2009年3月16日	41.2
第7期	自 2009年3月17日 至 2009年9月16日	35.9
第8期	自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	5.5
第9期	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日	6.7

第2【財務ハイライト情報】

原届出書の「第二部 ファンド情報 第2 財務ハイライト情報」については、以下の内容に更新されます。

< 訂正・更新後 >

- (1) 以下の情報は、「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」に記載された情報を抜粋して記載したものです。
- (2) 「第三部 ファンドの詳細情報」の「第4 ファンドの経理状況」の「1 財務諸表」については、あらた監査法人による監査を受けており、当該監査報告書は当有価証券届出書に添付されております。

1【財務諸表】

【GS外国株式インデックス・プラス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	63,455,965	63,213,916
流動資産合計	63,455,965	63,213,916
資産合計	63,455,965	63,213,916
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	18,516	19,539
未払委託者報酬	401,092	423,232
その他未払費用	14,629	15,441
流動負債合計	434,237	458,212
負債合計	434,237	458,212
純資産の部		
元本等		
元本	88,615,190	94,587,772
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,593,462	31,832,068
（分配準備積立金）	4,245,958	4,280,208
元本等合計	63,021,728	62,755,704
純資産合計	63,021,728	62,755,704
負債純資産合計	63,455,965	63,213,916

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,785,695	3,739,377
営業収益合計	3,785,695	3,739,377
営業費用		
受託者報酬	18,516	19,539
委託者報酬	401,092	423,232
その他費用	14,629	15,441
営業費用合計	434,237	458,212
営業利益又は営業損失()	3,351,458	4,197,589
経常利益又は経常損失()	3,351,458	4,197,589
当期純利益又は当期純損失()	3,351,458	4,197,589
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()	242,355	229,511
期首剰余金又は期首欠損金()	27,588,422	25,593,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,625,559	2,710,299
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,625,559	2,710,299
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,739,702	4,980,827
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,739,702	4,980,827
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	25,593,462	31,832,068

[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8期 自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託 受益証券の基準価額で評価して おります。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	84,630,366円	88,615,190円
期中追加設定元本額	15,123,959円	15,335,279円
期中一部解約元本額	11,139,135円	9,362,697円
2. 計算期間末日における受益権 の総数	88,615,190口	94,587,772口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 25,593,462円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 31,832,068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8期 自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	496,685円	454,999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	14,767,987円	16,492,602円
分配準備積立金額	3,749,273円	3,825,209円
本ファンドの分配対象収益額	19,013,945円	20,772,810円
本ファンドの期末残存口数	88,615,190口	94,587,772口
1口当たり収益分配対象額	0.214567円	0.219614円
1口当たり分配金額	円	円
収益分配金金額	円	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9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 金融商品に対する取組方針 2. 金融商品の内容及びそのリスク 3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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> <p>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。</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> <p>コンプライアンス部では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等を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>リスク管理・分析部門では、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、リスク管理・分析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>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法 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>貸借対照表に計上されている各科目の貸借対照表日における時価は、貸借対照表計上額と同額であるため、記載を省略しております。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 有価証券 「(3) 注記表（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>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>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期(2010年3月16日現在)	
	貸借対照表計上額 (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	63,455,965	3,600,910
合計	63,455,965	3,600,910

種類	第9期(2010年9月16日現在)	
	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	3,479,892	
合計	3,479,892	

(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8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
1口当たり純資産額	0.7112円	0.6635円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

参考情報

本ファンドは、「GS外国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。

なお、同親投資信託の状況は以下の通りです。

「GS外国株計量運用ポートフォリオマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		126,034,275	167,839,967
コール・ローン		941,448,080	295,044,846
株式		51,641,167,330	37,336,823,846
投資証券		-	805,342,202
派生商品評価勘定		978,695	699,364
未収入金		4,103,968	2,111,315
未収配当金		65,983,286	31,662,263
未収利息		2,739	861
差入委託証拠金		79,668,155	29,177,383
流動資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047
資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		800,548	238,030
未払金		-	19,082,243
未払解約金		500,000,000	-
流動負債合計		500,800,548	19,320,273
負債合計		500,800,548	19,320,273
純資産の部			
元本等			
元本		56,861,449,174	44,651,246,452
剰余金			
欠損金		4,502,863,194	6,001,864,678
剰余金合計		4,502,863,194	6,001,864,678
元本等合計		52,358,585,980	38,649,381,774
純資産合計		52,358,585,980	38,649,381,774
負債・純資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047

(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 2009年 9月17日 至 2010年 3月16日	自 2010年 3月17日 至 2010年 9月16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、投資証券 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	74,339,884,868円	56,861,449,174円
期中追加設定元本額	612,558,919円	2,398,965,791円
期中一部解約元本額	18,090,994,613円	14,609,168,513円
期末元本額	56,861,449,174円	44,651,246,452円
元本の内訳		
GS 外国株式インデックス・プラス	68,913,950円	73,029,016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)	10,592,184,536円	9,616,438,018円
GS ダイバーシファイド・ベータ・ポートフォリオ(適格機関投資家専用)	1,459,217,034円	1,656,678,299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)	236,288,004円	464,367,288円
GS 外国株計量運用ポートフォリオ(投資一任契約用)	44,504,845,650円	32,840,733,831円
2. 計算期間末日における受益権の総数	56,861,449,174口	44,651,246,452口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,502,863,194円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,001,864,678円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2010年3月17日 至 2010年9月16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。
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株式および投資証券であり、売買目的で保有しております。
	デリバティブ取引には、通貨関連では為替予約取引、株式関連では先物取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。
	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。
	コンプライアンス部では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等を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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理・分析部門では、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、リスク管理・分析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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表に計上されている各科目の貸借対照表日における時価は、貸借対照表計上額と同額であるため、記載を省略しております。
2. 時価の算定方法	(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。 (2) 有価証券 「(2) 注記表（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。 (3) デリバティブ取引 「(2) 注記表（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」に記載しております。
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。 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	(2010年3月16日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	51,641,167,330	7,896,185,705
合計	51,641,167,330	7,896,185,705

(注) 当親投資信託の前計算期間は2009年3月17日から2010年3月16日となっており、上記の前期の当計算期間の損益に含まれた評価差額は同計算期間に対応するものとなっております。

種類	(2010年9月16日現在)	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	547,128,574	
投資証券	94,403,632	
合計	452,724,942	

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

自 2009年 9月17日 至 2010年 3月16日	自 2010年 3月17日 至 2010年 9月16日
<p>1. 取引の内容 当投資信託の利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引、株式関連では先物取引であります。</p> <p>2. 取引に対する取組方針 デリバティブ取引は、信託約款に定める運用の基本方針に従う方針であります。</p> <p>3. 取引の利用目的 デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。</p> <p>4. 取引に係るリスクの内容 当投資信託の利用しているデリバティブ取引に係るリスクとしては、株価、為替などの市場価格が変動する事によって発生するマーケットリスク及び取引相手先が契約を履行できなくなる場合、すなわちデフォルト状態となった時に発生する取引先リスクがあります。</p> <p>5. 取引に係るリスク管理体制 デリバティブ取引の執行・管理については、運用・執行を担当する部署により行っております。また、法令などに基づく損失限度額のモニタリングは別途コンプライアンス部により行われております。</p> <p>6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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>	

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	(2010年 3月16日現在)			(2010年 9月16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	328,477,182		328,655,329	178,147	274,975,042		275,436,376	461,334
	合計	328,477,182		328,655,329	178,147	274,975,042		275,436,376	461,334

(注) 時価の算定方法

・先物取引

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

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	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
1口当たり純資産額	0.9208円	0.8656円

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

第4【ファンドの経理状況】

原届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」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、第8期計算期間（2009年9月17日から2010年3月16日まで）については、改正前の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しており、第9期計算期間（2010年3月17日から2010年9月16日まで）については、改正後の「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。

なお、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8期計算期間（2009年9月17日から2010年3月16日まで）及び第9期計算期間（2010年3月17日から2010年9月16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外国株式インデックス・プラス】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	63,455,965	63,213,916
流動資産合計	63,455,965	63,213,916
資産合計	63,455,965	63,213,916
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	18,516	19,539
未払委託者報酬	401,092	423,232
その他未払費用	14,629	15,441
流動負債合計	434,237	458,212
負債合計	434,237	458,212
純資産の部		
元本等		
元本	88,615,190	94,587,772
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,593,462	31,832,068
(分配準備積立金)	4,245,958	4,280,208
元本等合計	63,021,728	62,755,704
純資産合計	63,021,728	62,755,704
負債純資産合計	63,455,965	63,213,916

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第 8 期 自 2009年 9 月17日 至 2010年 3 月16日	第 9 期 自 2010年 3 月17日 至 2010年 9 月16日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,785,695	3,739,377
営業収益合計	3,785,695	3,739,377
営業費用		
受託者報酬	18,516	19,539
委託者報酬	401,092	423,232
その他費用	14,629	15,441
営業費用合計	434,237	458,212
営業利益又は営業損失()	3,351,458	4,197,589
経常利益又は経常損失()	3,351,458	4,197,589
当期純利益又は当期純損失()	3,351,458	4,197,589
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()	242,355	229,511
期首剰余金又は期首欠損金()	27,588,422	25,593,462
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,625,559	2,710,299
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,625,559	2,710,299
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,739,702	4,980,827
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,739,702	4,980,827
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	25,593,462	31,832,068

[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8期 自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託 受益証券の基準価額で評価してお ります。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	第8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	84,630,366円	88,615,190円
期中追加設定元本額	15,123,959円	15,335,279円
期中一部解約元本額	11,139,135円	9,362,697円
2. 計算期間末日における受益権 の総数	88,615,190口	94,587,772口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 25,593,462円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総 額を下回っており、その差額は 31,832,068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8期 自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	496,685円	454,999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	14,767,987円	16,492,602円
分配準備積立金額	3,749,273円	3,825,209円
本ファンドの分配対象収益額	19,013,945円	20,772,810円
本ファンドの期末残存口数	88,615,190口	94,587,772口
1口当たり収益分配対象額	0.214567円	0.219614円
1口当たり分配金額	円	円
収益分配金金額	円	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9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 金融商品に対する取組方針 2. 金融商品の内容及びそのリスク 3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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> <p>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。</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> <p>コンプライアンス部では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等を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>リスク管理・分析部門では、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、リスク管理・分析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>

金融商品の時価等に関する事項

区分	第9期 自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額 2. 時価の算定方法 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>貸借対照表に計上されている各科目の貸借対照表日における時価は、貸借対照表計上額と同額であるため、記載を省略しております。</p> <p>(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。</p> <p>(2) 有価証券 「(3) 注記表（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>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>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期(2010年3月16日現在)	
	貸借対照表計上額 (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	63,455,965	3,600,910
合計	63,455,965	3,600,910

種類	第9期(2010年9月16日現在)	
	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	3,479,892	
合計	3,479,892	

(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8期 (2010年3月16日現在)	第9期 (2010年9月16日現在)
1口当たり純資産額	0.7112円	0.6635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 外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド	73,029,016	63,213,916	
合計			73,029,016	63,213,916	

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外国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。

なお、同親投資信託の状況は以下の通りです。

「GS外国株計量運用ポートフォリオマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		126,034,275	167,839,967
コール・ローン		941,448,080	295,044,846
株式		51,641,167,330	37,336,823,846
投資証券		-	805,342,202
派生商品評価勘定		978,695	699,364
未収入金		4,103,968	2,111,315
未収配当金		65,983,286	31,662,263
未収利息		2,739	861
差入委託証拠金		79,668,155	29,177,383
流動資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047
資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		800,548	238,030
未払金		-	19,082,243
未払解約金		500,000,000	-
流動負債合計		500,800,548	19,320,273
負債合計		500,800,548	19,320,273
純資産の部			
元本等			
元本		56,861,449,174	44,651,246,452
剰余金			
欠損金		4,502,863,194	6,001,864,678
剰余金合計		4,502,863,194	6,001,864,678
元本等合計		52,358,585,980	38,649,381,774
純資産合計		52,358,585,980	38,649,381,774
負債・純資産合計		52,859,386,528	38,668,702,047

(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 2009年 9月17日 至 2010年 3月16日	自 2010年 3月17日 至 2010年 9月16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、投資証券 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2) 先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資信託協会規則に従い、時価評価しております。	(1) 為替予約取引 同左 (2) 先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。 但し、同61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	74,339,884,868円	56,861,449,174円
期中追加設定元本額	612,558,919円	2,398,965,791円
期中一部解約元本額	18,090,994,613円	14,609,168,513円
期末元本額	56,861,449,174円	44,651,246,452円
元本の内訳		
GS 外国株式インデックス・プラス	68,913,950円	73,029,016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)	10,592,184,536円	9,616,438,018円
GS ダイバーシファイド・ベータ・ポートフォリオ(適格機関投資家専用)	1,459,217,034円	1,656,678,299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)	236,288,004円	464,367,288円
GS 外国株計量運用ポートフォリオ(投資一任契約用)	44,504,845,650円	32,840,733,831円
2. 計算期間末日における受益権の総数	56,861,449,174口	44,651,246,452口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,502,863,194円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は6,001,864,678円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>2. 金融商品の内容及びそのリスク</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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> <p>本ファンドが保有する主な金融資産は株式および投資証券であり、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、通貨関連では為替予約取引、株式関連では先物取引が含まれております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。</p> <p>投資対象とする金融商品の主なリスクは価格が変動する事によって発生する市場リスク、金融商品の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合に発生する信用リスク、及び金融商品の取引量が著しく乏しい場合に発生する流動性リスクがあります。</p> <p>コンプライアンス部では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等を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>リスク管理・分析部門では、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、リスク管理・分析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>

金融商品の時価等に関する事項

区分	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	貸借対照表に計上されている各科目の貸借対照表日における時価は、貸借対照表計上額と同額であるため、記載を省略しております。
2. 時価の算定方法	(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。 (2) 有価証券 「(2) 注記表（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。 (3) デリバティブ取引 「(2) 注記表（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」に記載しております。
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。 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	(2010年3月16日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
株式	51,641,167,330	7,896,185,705
合計	51,641,167,330	7,896,185,705

(注) 当親投資信託の前計算期間は2009年3月17日から2010年3月16日となっており、上記の前期の当計算期間の損益に含まれた評価差額は同計算期間に対応するものとなっております。

種類	(2010年9月16日現在)	
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	
株式	547,128,574	
投資証券	94,403,632	
合計	452,724,942	

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

自 2009年 9月17日 至 2010年 3月16日	自 2010年 3月17日 至 2010年 9月16日
<p>1. 取引の内容 当投資信託の利用しているデリバティブ取引は、通貨関連では為替予約取引、株式関連では先物取引であります。</p> <p>2. 取引に対する取組方針 デリバティブ取引は、信託約款に定める運用の基本方針に従う方針であります。</p> <p>3. 取引の利用目的 デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避する目的で利用しています。</p> <p>4. 取引に係るリスクの内容 当投資信託の利用しているデリバティブ取引に係るリスクとしては、株価、為替などの市場価格が変動する事によって発生するマーケットリスク及び取引相手先が契約を履行できなくなる場合、すなわちデフォルト状態となった時に発生する取引先リスクがあります。</p> <p>5. 取引に係るリスク管理体制 デリバティブ取引の執行・管理については、運用・執行を担当する部署により行っております。また、法令などに基づく損失限度額のモニタリングは別途コンプライアンス部により行われております。</p> <p>6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明 取引の時価等に関する事項についての契約額等は、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>	

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	(2010年 3月16日現在)			(2010年 9月16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	328,477,182		328,655,329	178,147	274,975,042		275,436,376	461,334
	合計	328,477,182		328,655,329	178,147	274,975,042		275,436,376	461,334

(注) 時価の算定方法

・先物取引

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

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	(2010年3月16日現在)	(2010年9月16日現在)
1口当たり純資産額	0.9208円	0.8656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	
米ドル	ENERGY CORP	2,467	78.37	193,338.79	
	EXXON MOBIL CORPORATION	186,366	61.00	11,368,326.00	
	BP PLC-SPONS ADR	22,375	38.18	854,277.50	
	CONSTELLATION ENERGY GROUP	4,815	31.44	151,383.60	
	DOMINION RESOURCES INC/VA	7,344	43.48	319,317.12	
	DUKE ENERGY CORP	61,398	17.58	1,079,376.84	
	EXELON CORP	52,943	42.29	2,238,959.47	
	INTEGRYS ENERGY GROUP INC	10,754	50.75	545,765.50	
	ASHLAND INC	3,164	48.71	154,118.44	
	EASTMAN CHEMICAL COMPANY	21,784	66.93	1,458,003.12	
	HUNTSMAN CORP	49,382	10.18	502,708.76	
	MOSAIC CO/THE	4,027	57.59	231,914.93	
	DOMTAR CORP	4,503	64.14	288,822.42	
	INTERNATIONAL PAPER CO	53,288	22.90	1,220,295.20	
	MEADWESTVACO CORPORATION	24,111	23.77	573,118.47	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,957	32.83	162,738.31	
	RELIANCE STEEL & ALUMINUM	26,257	40.60	1,066,034.20	
	SCHNITZER STEEL INDS INC-A	3,054	47.49	145,034.46	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,030	43.57	175,587.10	
	NORTHROP GRUMMAN CORP	72,992	57.99	4,232,806.08	
	RAYTHEON COMPANY	11,111	45.84	509,328.24	
	COMPUTER SCIENCES CORP	4,771	43.23	206,250.33	
	DELL INC	156,694	12.31	1,928,903.14	
	MICROSOFT CORP	391,715	25.09	9,828,129.35	
	ORACLE CORP	157,727	25.71	4,055,161.17	
	SEAGATE TECHNOLOGY	79,217	11.38	901,489.46	
	WESTERN DIGITAL CORP	14,946	27.31	408,175.26	
	FLEXTRONICS INTERNATIONAL LTD.	32,891	5.72	188,136.52	
	GENERAL ELECTRIC CO	269,093	16.34	4,396,979.62	
	HARMAN INTERNATIONAL	8,754	32.97	288,619.38	
	ADVANCED MICRO DEVICES	49,580	6.22	308,387.60	
	ARROW ELECTRONICS INC	18,538	25.54	473,460.52	
	EMERSON ELECTRIC CO	3,538	50.05	177,076.90	
	GARMIN LTD	25,289	29.68	750,577.52	
INTEL CORP	405,663	18.72	7,594,011.36		
JOHNSON CONTROLS INC	50,886	28.71	1,460,937.06		

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	MICRON TECHNOLOGY INC	58,125	6.94	403,387.50	
	MOTOROLA INC	102,106	8.36	853,606.16	
	TYCO ELECTRONICS LTD	53,331	27.18	1,449,536.58	
	VISHAY INTERTECHNOLOGY INC	41,481	9.13	378,721.53	
	AGCO CORP	7,665	38.92	298,321.80	
	WHIRLPOOL CORP	6,177	72.77	449,500.29	
	BORGWARNER INC	5,034	47.68	240,021.12	
	CUMMINS INC	5,856	83.32	487,921.92	
	FEDERAL-MOGUL CORP	48,562	17.59	854,205.58	
	TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,376	34.94	257,717.44	
	COCA-COLA CO/THE	11,395	57.42	654,300.90	
	DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	3,716	35.60	132,289.60	
	HANSEN NATURAL CORPORATION	16,453	46.16	759,470.48	
	LORILLARD INC	140,508	81.12	11,398,008.96	
	PEPSICO INC	39,308	66.50	2,613,982.00	
	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,579	55.54	143,237.66	
	STARBUCKS CORP	70,386	25.75	1,812,439.50	
	MCDONALD'S CORPORATION	3,330	74.71	248,784.30	
	TYSON FOODS INC -CL A	114,240	17.10	1,953,504.00	
	AMGEN INC	87,057	55.30	4,814,252.10	
	CARDINAL HEALTH INC	86,162	32.98	2,841,622.76	
	CAREFUSION CORPORATION	48,825	24.49	1,195,724.25	
	HERBALIFE LTD	2,693	59.11	159,183.23	
	HUMANA INC	13,346	51.79	691,189.34	
	MCKESSON CORP	3,820	62.96	240,507.20	
	PFIZER INC	387,358	17.27	6,689,672.66	
	PROCTER & GAMBLE CO	120,190	61.11	7,344,810.90	
	GUESS? INC	8,689	37.69	327,488.41	
	MOHAWK INDUSTRIES INC	11,849	48.49	574,558.01	
	NIKE INC -CL B	9,910	76.56	758,709.60	
	COMCAST CORP-CL A	87,929	18.02	1,584,480.58	
	DISH NETWORK CORP-A	148,906	18.68	2,781,564.08	
	MANPOWER INC	4,148	48.10	199,518.80	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	71,139	19.71	1,402,149.69	
	CARNIVAL CORP	6,795	35.60	241,902.00	
	EXPEDIA INC	14,416	26.66	384,330.56	
	AMAZON.COM INC	13,113	145.45	1,907,285.85	
	ARCHER-DANIELS-MIDLAND	61,391	32.55	1,998,277.05	
	PETSMART INC	60,781	35.01	2,127,942.81	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ROSS STORES INC	21,047	54.06	1,137,906.05	
	WILLIAMS-SONOMA INC	14,390	29.96	431,124.40	
	AT&T INC	167,615	28.00	4,693,220.00	
	CISCO SYSTEMS	131,606	21.59	2,841,373.54	
	DIRECTV-CLASS A	18,929	40.99	775,899.71	
	SPRINT NEXTEL CORP	274,072	4.58	1,255,249.76	
	TELLABS INC	25,174	7.53	189,560.22	
	TIME WARNER INC	80,893	31.75	2,568,352.75	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	21,162	31.19	660,042.78	
	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	74,190	25.27	1,874,781.30	
	BOEING CO/THE	30,452	62.73	1,910,253.96	
	COPA HOLDINGS SA-CLASS A	5,249	50.81	266,701.69	
	FEDEX CORP	7,717	85.94	663,198.98	
	BANK OF AMERICA CORP	284,300	13.71	3,897,753.00	
	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	98,403	25.68	2,526,989.04	
	JPMORGAN CHASE & CO	136,246	40.98	5,583,361.08	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11,865	54.83	650,557.95	
	US BANCORP	59,489	22.67	1,348,615.63	
	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,545	39.09	1,428,544.05	
	NEW YORK COMMUNITY BANCORP INC	27,175	16.73	454,637.75	
	ACE LTD	15,835	57.71	913,837.85	
	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	15,124	36.16	546,883.84	
	ASSURANT INC	8,836	40.19	355,118.84	
	LOEWS CORP	27,505	36.89	1,014,659.45	
	UNUM GROUP	108,649	22.15	2,406,575.35	
	WELLPOINT INC	25,907	54.64	1,415,558.48	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	25,656	81.40	2,088,398.40	
	NEWMONT MINING CORP	15,416	62.90	969,666.40	
	CHEVRON CORP	87,400	79.21	6,922,954.00	
	CIMAREX ENERGY CO	11,602	68.78	797,985.56	
	CONOCOPHILLIPS	81,859	55.56	4,548,086.04	
	EXTERRAN HOLDINGS INC	16,836	23.35	393,120.60	
	HESS CORP	13,791	55.00	758,505.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	8,549	41.13	351,620.37	
	OIL STATES INTERNATIONAL INC	7,974	44.27	353,008.98	
	SUNOCO INC	5,866	35.81	210,061.46	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	VALERO ENERGY CORP	165,413	17.34	2,868,261.42	
	BB&T CORP	20,360	23.60	480,496.00	
	CITIGROUP INC	369,973	3.92	1,450,294.16	
	HUDSON CITY BANCORP INC	44,708	12.30	549,908.40	
	WELLS FARGO & CO	111,439	26.32	2,933,074.48	
	ACCENTURE PLC-CL A	144,534	39.64	5,729,327.76	
	GOOGLE INC-CL A	11,950	480.64	5,743,648.00	
	INGRAM MICRO INC-CL A	166,855	16.00	2,669,680.00	
	SYMANTEC CORP	136,602	14.99	2,047,663.98	
	VERISIGN INC	27,882	31.41	875,773.62	
	LEXMARK INTERNATIONAL INC-A	14,149	41.60	588,598.40	
	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	7,348	83.48	613,411.04	
	SCHLUMBERGER LTD	24,460	58.19	1,423,327.40	
	TIMKEN CO	6,274	37.52	235,400.48	
	BIOGEN IDEC INC	5,574	58.42	325,633.08	
	CEPHALON INC	18,379	62.46	1,147,952.34	
	ELI LILLY & CO	215,848	35.70	7,705,773.60	
	GILEAD SCIENCES INC	72,667	34.84	2,531,718.28	
	HEALTH NET INC	24,341	26.67	649,174.47	
	TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,583	54.26	1,116,833.58	
	EATON CORP	15,037	79.23	1,191,381.51	
	ILLINOIS TOOL WORKS	4,201	47.07	197,741.07	
	OSHKOSH CORP	57,596	27.35	1,575,250.60	
	ROCKWELL AUTOMATION INC	23,352	59.35	1,385,941.20	
	TORO CO	37,251	53.65	1,998,516.15	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	39,315	67.66	2,660,052.90	
	AUTOLIV INC	8,478	60.85	515,886.30	
小計				234,506,561.42 (20,078,451,788)	
カナダドル	CANADIAN NATURAL RESOURCES	42,700	34.23	1,461,621.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	2,000	48.47	96,940.00	
	ENCANA CORP	14,900	28.99	431,951.00	
	AGRIUM INC	3,900	74.37	290,043.00	
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	3,200	150.52	481,664.00	
	BOMBARDIER INC (B)	24,100	4.88	117,608.00	
	RESEARCH IN MOTION	600	46.71	28,026.00	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	2,500	79.69	199,225.00	
	LOBLAW COMPANIES LTD	1,100	41.29	45,419.00	
	METRO INC -A	1,600	45.02	72,032.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	TIM HORTONS INC	1,100	37.20	40,920.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	5,400	37.27	201,258.00	
	YELLOW PAGES INCOME FUND	16,500	5.40	89,100.00	
	CGI GROUP INC - CL A	7,600	14.45	109,820.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	23,500	22.26	523,110.00	
	TELUS CORP	4,000	43.27	173,080.00	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,700	66.12	443,004.00	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8,100	64.14	519,534.00	
	BANK OF MONTREAL	10,700	61.26	655,482.00	
	BANK OF NOVA SCOTIA	6,500	53.75	349,375.00	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,900	74.65	1,634,835.00	
	NATIONAL BANK OF CANADA	7,900	66.10	522,190.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	9,300	54.49	506,757.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	30,700	13.22	405,854.00	
	BROOKFIELD PROPERTIES CORP	10,400	16.06	167,024.00	
	ONEX CORPORATION	21,000	28.87	606,270.00	
	BARRICK GOLD CORP	14,800	46.19	683,612.00	
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	7,800	31.44	245,232.00	
	GOLDCORP INC	11,100	43.70	485,070.00	
	KINROSS GOLD CORP	69,800	18.02	1,257,796.00	
	YAMANA GOLD INC	12,400	10.79	133,796.00	
	PENN WEST ENERGY TRUST	17,000	19.34	328,780.00	
	TALISMAN ENERGY INC	100,000	16.97	1,697,000.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	5,700	43.92	250,344.00	
小計				15,253,772.00	
				(1,271,249,358)	
ユーロ	RWE AG	12,576	52.45	659,611.20	
	CRH PLC	33,280	13.07	434,969.60	
	AKZO NOBEL	41,736	45.87	1,914,639.00	
	BASF SE	3,051	45.02	137,356.02	
	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,251	39.63	762,917.13	
	KONINKLIJKE DSM NV	109,872	36.37	3,996,044.64	
	UMICORE	36,449	31.30	1,140,853.70	
	VOESTALPINE AG	14,062	26.00	365,612.00	
	SAP AG	9,379	36.59	343,177.61	
	LEGRAND SA	48,068	24.66	1,185,597.22	
	STMICROELECTRONICS NV	204,705	5.57	1,140,820.96	
	ASML HOLDING NV	7,047	21.52	151,686.67	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	156,686	4.45	697,566.07	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	FIAT SPA	29,487	10.44	307,844.28	
	PEUGEOT SA	83,316	24.28	2,022,912.48	
	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	14,001	38.68	541,558.68	
	RENAULT SA	24,364	36.40	886,849.60	
	VOLKSWAGEN AG	2,066	79.00	163,214.00	
	HEINEKEN HOLDING NV	33,974	32.00	1,087,168.00	
	KERRY GROUP PLC-A	10,307	25.65	264,374.55	
	PARMALAT SPA	220,785	1.98	437,154.30	
	SOLVAY SA	21,672	78.90	1,709,920.80	
	SUEDZUCKER AG	8,009	14.97	119,934.77	
	UNILEVER NV-CVA	71,896	21.58	1,551,515.68	
	CHRISTIAN DIOR	20,879	89.31	1,864,703.49	
	L'OREAL	9,085	83.01	754,145.85	
	SANOFI-AVENTIS	7,920	49.44	391,564.80	
	UCB SA	45,584	24.27	1,106,551.60	
	BOUYGUES SA	7,832	32.79	256,850.44	
	TNT NV	34,055	19.59	667,137.45	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	75,720	19.58	1,482,976.20	
	VIVENDI	11,468	19.52	223,855.36	
	TUI AG	43,989	8.27	364,008.97	
	DELHAIZE GROUP	52,495	54.00	2,834,730.00	
	KONINKLIJKE AHOLD NV	28,332	10.03	284,311.62	
	PPR	1,574	115.75	182,190.50	
	FRANCE TELECOM SA	164,216	16.40	2,693,142.40	
	MOBISTAR SA	6,372	45.02	286,899.30	
	AIR FRANCE-KLM	15,684	11.17	175,268.70	
	BANCO DE SABADELL SAL	117,347	3.97	465,867.59	
	BNP PARIBAS	14,476	55.67	805,878.92	
	COMMERZBANK AG	47,328	6.48	306,780.09	
	CREDIT AGRICOLE SA	38,492	11.52	443,620.30	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	18,344	48.47	889,133.68	
	DEXIA SA	134,680	3.35	451,986.08	
	KBC GROEP NV	34,674	36.40	1,262,133.60	
	RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	23,674	35.98	851,908.89	
	BANCO SANTANDER SA	370,868	9.93	3,685,686.18	
	DEUTSCHE BOERSE AG	3,930	51.19	201,176.70	
	SOCIETE GENERALE-A	3,874	45.92	177,913.45	
	AGEAS	412,573	2.10	866,403.30	
	AXA SA	43,017	13.19	567,394.23	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	ING GROEP NV-CVA	106,039	7.86	833,466.54	
	SCOR SE	11,418	17.83	203,582.94	
	IMMOFINANZ AG	185,162	2.83	524,934.27	
	LAGARDERE S.C.A.	47,011	29.72	1,397,401.97	
	OMV AG	84,018	26.81	2,252,522.58	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	102,051	22.35	2,280,839.85	
	TOTAL SA	117,147	38.78	4,543,546.39	
	FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	23,400	20.41	477,594.00	
	TECHNIP SA	12,970	55.39	718,408.30	
	VINCI SA	15,531	37.21	577,986.16	
	ALLIANZ SE-REG	10,732	85.98	922,737.36	
	VIENNA INSURANCE GROUP AG	7,512	38.71	290,789.52	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	6,905	69.30	478,516.50	
	E.ON AG	160,439	22.51	3,612,284.08	
	KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	48,899	23.01	1,125,165.99	
	SIEMENS AG-REG	3,398	75.79	257,534.42	
	CELESIO AG	26,107	16.17	422,150.19	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	121,192	43.30	5,247,613.60	
	ERSTE GROUP BANK AG	24,070	28.92	696,104.40	
小計				73,430,697.71 (8,164,759,278)	
英ポンド	INTERNATIONAL POWER PLC	17,508	3.88	68,036.08	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	52,401	11.62	608,899.62	
	JOHNSON MATTHEY PLC	13,704	17.70	242,560.80	
	BHP BILLITON PLC	17,061	19.63	334,907.43	
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	64,435	8.66	558,007.10	
	KAZAKHMYS PLC	19,445	13.55	263,479.75	
	VEDANTA RESOURCES PLC	53,227	21.37	1,137,460.99	
	XSTRATA PLC	6,488	11.60	75,260.80	
	IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	49,472	19.25	952,336.00	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	64,644	10.64	687,812.16	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	370,338	2.98	1,105,458.93	
	NEXT PLC	4,051	21.76	88,149.76	
	PEARSON PLC	13,045	10.01	130,580.45	
	THOMAS COOK GROUP PLC	468,106	1.96	917,955.86	
	KINGFISHER PLC	133,306	2.18	291,806.83	
	SAINSBURY (J)PLC	25,250	3.80	96,076.25	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
	BAE SYSTEMS PLC	329,611	3.40	1,123,314.28	
	BARCLAYS PLC	171,786	3.16	544,132.15	
	HSBC HOLDINGS PLC	380,967	6.76	2,577,622.72	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	824,918	0.77	637,991.58	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	84,018	0.49	41,723.33	
	AVIVA PLC	135,478	4.17	565,891.60	
	RESOLUTION LTD	13,209	2.54	33,564.06	
	ANGLO AMERICAN PLC	4,030	25.50	102,765.00	
	RIO TINTO PLC - REG	15,449	35.72	551,915.52	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	87,885	18.07	1,588,521.37	
	MAN GROUP PLC	103,082	2.35	242,861.19	
	SEVERN TRENT PLC	20,978	13.88	291,174.64	
	ASTRAZENECA PLC	71,873	33.48	2,406,308.04	
小計				18,266,574.29 (2,444,432,971)	
スイスフラン	SIKA AG-BR	139	1,773.00	246,447.00	
	GAM HOLDING AG	131,413	13.85	1,820,070.05	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES-REG	1,749	240.30	420,284.70	
	PARGESA HOLDING SA-BR	2,847	70.10	199,574.70	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,543	139.50	494,248.50	
	LONZA GROUP AG-REG	8,635	88.50	764,197.50	
小計				3,944,822.45 (337,124,526)	
スウェーデン クローナ	SVENSKA CELLULOSA AB-B	31,367	104.20	3,268,441.40	
	BOLIDEN AB	44,072	98.65	4,347,702.80	
	SKF AB-B SHARES	68,080	143.80	9,789,904.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,106	121.80	6,468,310.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	31,521	110.40	3,479,918.40	
	SANDVIK AB	136,879	97.70	13,373,078.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	66,272	157.00	10,404,704.00	
	VOLVO AB-B SHS	35,605	95.70	3,407,398.50	
	SWEDISH MATCH AB	16,538	176.50	2,918,957.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B	62,711	253.00	15,865,883.00	
	ERICSSON LM-B SHS	82,035	78.25	6,419,238.75	
	TELE2 AB-B SHS	58,543	139.50	8,166,748.50	
	TELIASONERA AB	805,378	53.80	43,329,336.40	
	NORDEA BANK AB	531,620	70.50	37,479,210.00	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
小計	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	166,980	48.44	8,088,511.20	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	58,924	213.00	12,550,812.00	
	SKANSKA AB-B SHS	214,529	120.90	25,936,556.10	
	INVESTOR AB-B SHS	80,277	133.60	10,725,007.20	
	ALFA LAVAL AB	111,768	116.50	13,020,972.00	
	ASSA ABLOY AB-B	6,329	163.70	1,036,057.30	
				240,076,747.65	
				(2,892,924,809)	
ノルウェーク ローネ	NORSK HYDRO ASA	393,896	33.09	13,034,018.64	
	STATOIL ASA	279,591	124.60	34,837,038.60	
	TELENOR ASA	301,581	92.25	27,820,847.25	
	DNB NOR ASA	226,713	77.45	17,558,921.85	
	ORKLA ASA	186,118	53.35	9,929,395.30	
小計				103,180,221.64	
				(1,446,586,707)	
オーストラリ アドル	AGL ENERGY LTD	4,652	15.82	73,594.64	
	PALADIN ENERGY LTD	8,427	3.75	31,601.25	
	WORLEYPARSONS LTD	3,054	23.34	71,280.36	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	18,543	12.09	224,184.87	
	FOSTER'S GROUP LTD	2,512	6.12	15,373.44	
	CSL LTD	527	32.23	16,985.21	
	FAIRFAX MEDIA LTD	24,641	1.51	37,207.91	
	TRANSURBAN GROUP	5,260	5.04	26,510.40	
	TABCORP HOLDING LIMITED	1,419	6.73	9,549.87	
	TELSTRA CORP LTD	9,160	2.78	25,464.80	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	9,963	2.64	26,302.32	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	11,684	53.80	628,599.20	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,263	25.94	84,642.22	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	1,156	23.63	27,316.28	
	INTOLL GROUP	3,967	1.47	5,851.32	
	ONESTEEL LTD	35,745	3.12	111,524.40	
	OZ MINERALS LTD	101,295	1.47	149,410.12	
	RIO TINTO LTD	2,690	75.30	202,557.00	
	MACARTHUR COAL LTD	1,171	12.22	14,309.62	
	小計				1,782,265.23
				(143,115,897)	
ニュージーラ ンドドル	FLETCHER BUILDING LTD	16,195	8.35	135,228.25	

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考	
			単価	金額		
小計	CONTACT ENERGY LIMITED	1,669	5.78	9,646.82		
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	9,898	2.88	28,506.24		
	TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	34,237	2.06	70,528.22		
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	15,755	2.09	32,927.95		
				276,837.48		
				(17,199,912)		
シンガポール ドル	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	138,000	4.50	621,000.00		
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	37,000	1.75	64,750.00		
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	24,000	38.12	914,880.00		
	FRASER AND NEAVE LTD	80,000	6.03	482,400.00		
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	249,000	3.07	764,430.00		
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,000	16.00	416,000.00		
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	69,000	14.06	970,140.00		
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	101,000	8.85	893,850.00		
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	35,000	18.74	655,900.00		
	UOL GROUP LTD	178,000	4.19	745,820.00		
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	14,000	1.69	23,660.00		
	SEMBCORP MARINE LIMITED	70,000	3.95	276,500.00		
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	850,000	0.59	505,750.00		
	NOBLE GROUP LTD	101,000	1.79	180,790.00		
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	5,000	8.26	41,300.00		
					7,557,170	
					(483,507,736)	
小計	ISRAEL CHEMICALS LTD	3,701	50.70	187,640.70		
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	17,221	8.89	153,232.45		
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	3,918	65.42	256,315.56		
	BANK HAPOALIM BM	52,639	15.59	820,642.01		
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	57,154	15.75	900,175.50		
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	27,957	7.13	199,333.41		
				2,517,339.63		
				(57,470,863)		
合計				37,336,823,846		
				(37,336,823,846)		

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 138銘柄	100.0%	53.8%
カナダドル	株式 34銘柄	100.0%	3.4%
ユーロ	株式 71銘柄	100.0%	21.9%
英ポンド	株式 29銘柄	100.0%	6.5%
スイスフラン	株式 6銘柄	100.0%	0.9%
スウェーデンクローナ	株式 20銘柄	100.0%	7.7%
ノルウェークローネ	株式 5銘柄	100.0%	3.9%
オーストラリアドル	株式 19銘柄	100.0%	0.4%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.0%
シンガポールドル	株式 15銘柄	100.0%	1.3%
イスラエルシケル	株式 6銘柄	100.0%	0.2%

(イ) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	口数	評価額単価	評価額金額	備考
米ドル	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,155	111.58	352,034.90	
		RAYONIER INC	36,656	48.51	1,778,182.56	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	58,347	95.42	5,567,470.74	
小計				7,697,688.20 (659,076,064)		
ユーロ	投資証券	ICADE	4,316	79.00	340,964.00	
		UNIBAIL - RODAMCO SE	2,454	161.60	396,566.40	
小計				737,530.40 (82,006,005)		
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	42,804	6.39	273,731.58	
小計				273,731.58 (36,630,760)		
オーストラリアドル	投資証券	WESTFIELD GROUP	10,927	12.62	137,898.74	
小計				137,898.74 (11,073,269)		
シンガポールドル	投資証券	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	25,000	2.19	54,750.00	
		CAPITAMALL TRUST	101,000	2.02	204,020.00	
小計				258,770.00 (16,556,105)		
合計					805,342,202 (805,342,202)	

(注) 1. 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 3 銘柄	100.0%	81.8%
ユーロ	投資証券 2 銘柄	100.0%	10.2%
英ポンド	投資証券 1 銘柄	100.0%	4.5%
オーストラリアドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	1.4%
シンガポールドル	投資証券 2 銘柄	100.0%	2.1%

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

「(2) 注記表（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。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

(2010年9月30日現在)

資産総額	63,293,714円
負債総額	335,660円
純資産総額（ - ）	62,958,054円
発行済口数	94,422,828口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6668円

参考情報

< G S 外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド >

純資産額計算書

(2010年9月30日現在)

資産総額	38,783,560,313円
負債総額	53,813,182円
純資産総額（ - ）	38,729,747,131円
発行済口数	44,496,821,914口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8704円

第5【設定及び解約の実績】

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

< 訂正・更新後 >

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

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）	発行済み口数（口）
第1期	自 2006年2月28日 至 2006年9月19日	38,672,324 (0)	()	38,672,324 (0)
第2期	自 2006年9月20日 至 2007年3月16日	6,460,440 (0)	132,966 (0)	44,999,798 (0)
第3期	自 2007年3月17日 至 2007年9月18日	12,117,575 (0)	1,069,331 (0)	56,048,042 (0)
第4期	自 2007年9月19日 至 2008年3月17日	15,488,825 (0)	3,655,514 (0)	67,881,353 (0)
第5期	自 2008年3月18日 至 2008年9月16日	19,119,514 (0)	6,563,378 (0)	80,437,489 (0)
第6期	自 2008年9月17日 至 2009年3月16日	23,817,129 (0)	36,538,732 (0)	67,715,886 (0)
第7期	自 2009年3月17日 至 2009年9月16日	36,348,046 (0)	19,433,566 (0)	84,630,366 (0)
第8期	自 2009年9月17日 至 2010年3月16日	15,123,959 (0)	11,139,135 (0)	88,615,190 (0)
第9期	自 2010年3月17日 至 2010年9月16日	15,335,279 (0)	9,362,697 (0)	94,587,772 (0)

(注1) ()内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。

(注2) 設定口数には当初募集期間中の設定口数を含みます。

第四部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

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

<訂正・更新後>

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額：金 4 億9,000万円

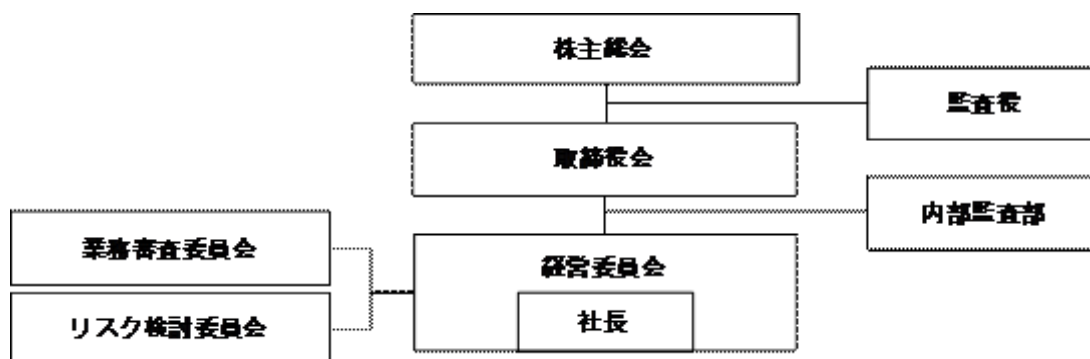
発行する株式の総数：8,000株

発行済株式の総数：6,400株

最近5年間における主な資本の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社等の機構

委託会社の業務運営の組織体系は以下の通りです。



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

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

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

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

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

投資運用の意思決定機構

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



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

2 事業の内容及び営業の概況

事業の内容

投資信託及び投資法人に関する法律に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに金融商品取引法に定める金融商品取引業者としてその投資運用業務および投資助言業務を行っています。また、金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業務および第二種金融商品取引業務を行っています。

委託会社の運用するファンド

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

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

[次へ](#)

3 委託会社等の経理状況

1. 財務諸表の作成方法について

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

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

2. 監査証明について

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

(1) 貸借対照表

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

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

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

(2) 損益計算書

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

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

第14期
（自平成20年4月1日 至平成21年3月31日）

(単位：千円)

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

第15期
（自平成21年4月1日 至平成22年3月31日）

(単位：千円)

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

重要な会計方針

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

区分	第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 役員及び従業員に付与されており ます、ザ・ゴールドマン・サックス・グ ループ・インク株式に係る報酬につい ては、企業会計基準第8号「ストック ・オプション等に関する会計基準」及 び企業会計基準適用指針第11号「ス tock・オプション等に関する会計基 準の適用指針」に準じて、権利付与日 公正価値及び付与された株数に基づき 計算される費用を権利確定計算期間に わたり人件費(営業費用及び一般管理 費)として処理しております。また、ザ ・ゴールドマン・サックス・グループ ・インクおよびゴールドマン・サック ス・ジャパン・ホールディングス有限 会社との契約に基づき当社が負担す る、権利付与日以降の株価の変動によ り発生する損益については営業外損益 として処理しております。</p> <p>(2) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、 税抜方式によっております。</p>	<p>(1) 株式従業員報酬の会計処理方法 同左</p> <p>(2) 消費税等の会計処理 同左</p>

注記事項

(貸借対照表関係)

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

（損益計算書関係）

第14期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第15期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<p>* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますが、ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。</p> <p>* 2 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <p>営業収益</p> <p>運用受託報酬 1,147,752千円</p> <p>その他営業収益 1,221,154千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 1,550,484千円</p> <p>株式従業員報酬 10,698千円</p> <p>営業外収益</p> <p>株式従業員報酬 221,263千円</p> <p>営業外費用</p> <p>支払利息 35,664千円</p>	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <p>営業収益</p> <p>運用受託報酬 275,256千円</p> <p>その他営業収益 2,755,632千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 3,125,049千円</p> <p>株式従業員報酬 108,229千円</p> <p>営業外費用</p> <p>株式従業員報酬 175,228千円</p>

（株主資本等変動計算書関係）

第14期（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

第15期（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

（リース取引関係）

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

（金融商品に関する注記）

第15期
（自 平成21年4月1日
至 平成22年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

信用リスク

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

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

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

市場リスク

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

流動性および資金調達リスク

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：千円)

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

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権の償還予定額

(単位：千円)

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

（有価証券関係）

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

（デリバティブ取引関係）

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

(退職給付関係)

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

（税効果会計関係）

第14期 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）	第15期 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <p>未払費用 240,294千円</p> <p>その他 50,980</p> <p style="text-align: right;">小計 291,274</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p>未収事業税 82,091</p> <p style="text-align: right;">小計 82,091</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 209,183</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 827,893</p> <p>役員退職慰労引当金 315,022</p> <p>投資有価証券評価減 76,931</p> <p>その他 47,648</p> <p style="text-align: right;">小計 1,267,494</p> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <p>その他有価証券評価差額金 12,920</p> <p style="text-align: right;">小計 12,920</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 1,254,574</p> <p style="text-align: right;">1,463,757千円</p>	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <p>未払費用 542,061千円</p> <p>未払事業税 69,035</p> <p>その他 17,214</p> <p style="text-align: right;">小計 628,311</p> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <p style="text-align: right;">小計 -</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 628,311</p> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <p>長期未払費用 1,106,725</p> <p>役員退職慰労引当金 356,410</p> <p>その他 24,188</p> <p style="text-align: right;">小計 1,487,324</p> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <p>その他有価証券評価差額金 29,326</p> <p style="text-align: right;">小計 29,326</p> <p style="text-align: right;">繰延税金資産の純額 1,457,997千円</p>
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.69 %</p> <p>（調整）</p> <p>役員賞与等永久に損金に算入されない項目 3.12</p> <p>その他 0.06</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 37.49 %</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率 40.69 %</p> <p>（調整）</p> <p>役員賞与等永久に損金に算入されない項目 49.38</p> <p>その他 1.33</p> <p style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率 88.75 %</p>
<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>該当事項はありません。</p>	<p>3 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正</p> <p>該当事項はありません。</p>
<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合その内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>	<p>4 決算日後に法人税等の税率の変更があった場合その内容及び影響</p> <p>該当事項はありません。</p>

(関連当事者との取引)

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

第14期
(自平成20年4月1日
至平成21年3月31日)

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

第15期
(自平成21年4月1日
至平成22年3月31日)

親会社及び法人主要株主等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第15期
(自平成21年4月1日
至平成22年3月31日)

兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)

（1株当たり情報）

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

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

4 利害関係人との取引制限

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

- (1) 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）、
- (3) 通常の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、定款の変更、営業譲渡および営業譲受、出資の状況その他の重要な事項は予定されておりません。
- (2) 本書提出日現在の前1年以内において、訴訟事件その他委託会社等に重要な影響を及ぼした事実および重要な影響を及ぼすことが予想される事実は存在しておりません。

第2【その他の関係法人の概況】

原届出書の「第四部 特別情報 第2 その他の関係法人の概況」については、以下の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

1 名称、資本金の額及び事業の内容

(1) 投資顧問会社

(2009年12月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー (G S A Mニューヨーク)	206.4百万米ドル (19,008百万円、 1米ドル=92.10円)	G S A Mニューヨークは、米国において、内外の有価証券等に係る投資顧問業務およびその他付帯関連する一切の業務を営んでいます。

(2) 受託銀行

(2010年3月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
住友信託銀行株式会社	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

(3) 販売会社

(2010年3月末日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
ゴールドマン・サックス証券株式会社	83,616百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を中心としたサービスを提供しています。
損保ジャパンDC証券株式会社 (注1)	3,000百万円	
日興コーディアル証券株式会社	10,000百万円	
マネックス証券株式会社	7,425百万円	
野村證券株式会社(注2)	10,000百万円	
楽天証券株式会社	7,477百万円	

(注1) 確定拠出年金のみのお取扱いとなります。

(注2) 新規の申込みのお取扱いはいりません。

2 関係業務の概要

(1) 投資顧問会社

G S A Mニューヨークは本ファンドの投資顧問会社であり、本ファンドに関し、委託会社より世界株式（除く日本）および為替の運用の指図に関する権限の委託を受けて投資判断・発注等を行っています。

(2) 受託銀行

本ファンドの受託者として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行います。

(3) 販売会社

本ファンドの販売会社として、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行います。

3 資本関係

(1) 投資顧問会社

G S A Mニューヨークおよび委託会社はいずれもザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクの子会社です。G S A Mニューヨークは、委託会社の発行済株式総数の99%を所有する親会社です。

(2) 受託銀行

該当事項はありません。

(3) 販売会社

ゴールドマン・サックス証券株式会社および委託会社は、いずれもザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インクの子会社です。

独立監査人の監査報告書

平成22年4月21日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
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外国株式インデックス・プラスの平成21年9月17日から平成22年3月16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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、GS外国株式インデックス・プラスの平成22年3月16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。

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

以上

(注1) 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年5月27日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第14期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成22年10月20日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
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外国株式インデックス・プラスの平成22年3月17日から平成22年9月16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。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、GS外国株式インデックス・プラスの平成22年9月16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。

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

以上

(注1) 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年 5月26日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 大畑 茂
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第15期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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