

【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24年12月14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 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24年6月15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)

属性区分表

(中略)

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

(中略)

<ファンドの投資対象>

日本を除く先進国の株式を主要投資対象とするMSCIコクサイ・インデックス（配当なし/円換算ベース）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安定的に獲得することを目指します。

MSCIコクサイ・インデックスとは

モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル社が作成・発表している先進国・地域（除く日本）の株式で構成された指数です。

<インデックスのポイント>

外国株式市場全体の動きを把握	構成銘柄数：約1,300銘柄 構成国：先進23カ国・地域
世界を代表する企業を中心に構成	算出基準：時価総額（株価×上場株式数 ^{*1} ）
世界の経済動向を反映	時価総額：約1,860兆円 ^{*2}

2012年3月末現在

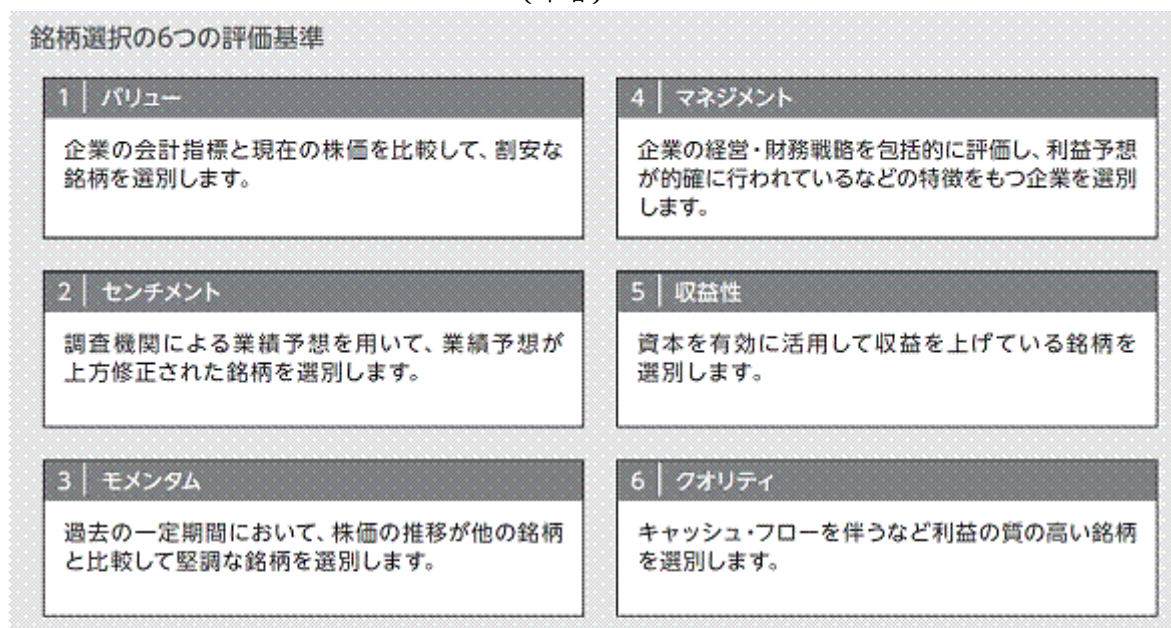
*1 浮動株が調整されています。浮動株とは、一部の株主に固定的に保有されていない、通常株式市場に流通する可能性がある株式を指します。

*2 2012年3月末現在の為替レートにより円換算しています。

< ファンドの運用手法 >

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な評価基準に基づいて国別（株式市場・通貨）配分、銘柄選択を行います。

（中略）



本ファンドは上記の評価基準によって、国別（株式市場・通貨）配分、個別銘柄選択を行います。多様な視点から銘柄を評価することによって、様々な市場局面でも安定した付加価値の獲得を追求します。

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

（中略）

(3) ファンドの仕組み

（中略）

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 >

（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、2011年12月末現在、グループ全体で7,058億米ドル（約54.9兆円^{*}）の資産を運用しています。

^{*}米ドルの円貨換算は便宜上、2011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＝77.74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)

属性区分表

(中略)

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

(中略)

<ファンドの投資対象>

日本を除く先進国の株式から構成されるMSCIコクサイ・インデックス（配当なし/円換算ベース）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安定的に獲得することを目指します。

MSCIコクサイ・インデックスとは

モルガン・スタンレー・キャピタル・インターナショナル社が作成・発表している先進国・地域（除く日本）の株式で構成された指数です。

<インデックスのポイント>

外国株式市場全体の動きを把握	構成銘柄数：約1,300銘柄 構成国：先進23カ国・地域
世界を代表する企業を中心に構成	算出基準：時価総額（株価×上場株式数 ^{*1} ）
世界の経済動向を反映	時価総額：約1,790兆円 ^{*2}

2012年9月末現在

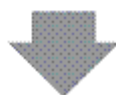
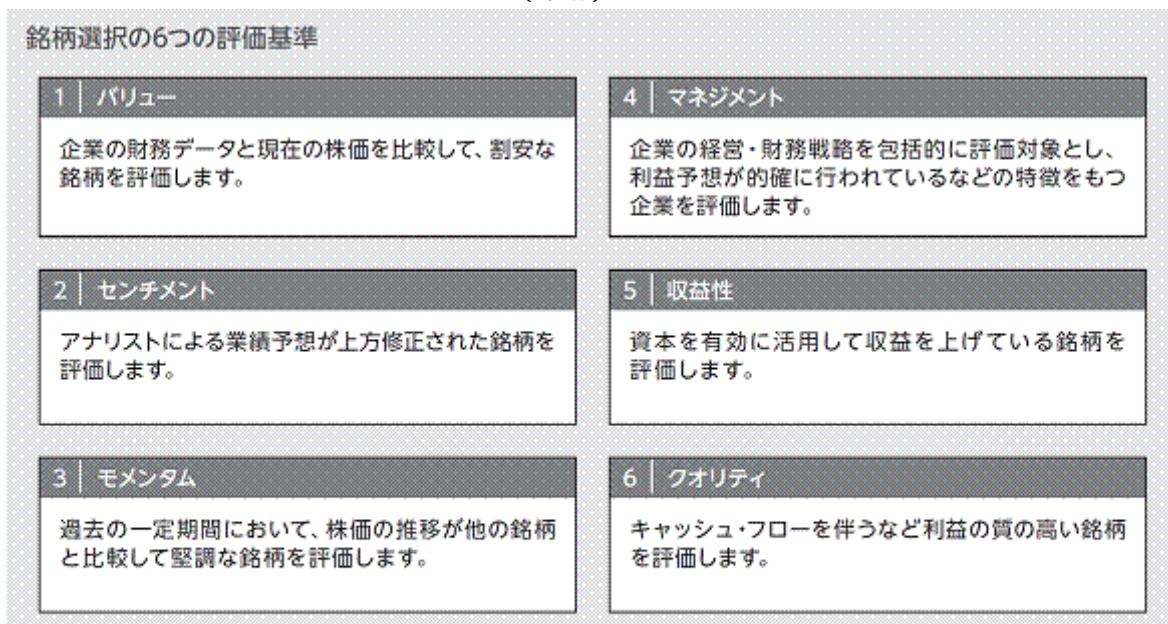
*1 浮動株が調整されています。浮動株とは、一部の株主に固定的に保有されていない、通常株式市場に流通する可能性がある株式を指します。

*2 2012年9月末現在の為替レートにより円換算しています。

< ファンドの運用手法 >

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な評価基準に基づいて国別（株式市場・通貨）配分、銘柄選択を行います。

（中略）



本ファンドは上記の評価基準によって、国別（株式市場・通貨）配分、個別銘柄選択を行います。多様な視点から銘柄を評価することによって、様々な市場局面でも安定した付加価値の獲得を追求します。

上記6つの評価基準についての各記述部分は、それぞれの評価基準に含まれる評価対象項目の例を示しております。

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はありません。

（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）

< 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・マネジメントは、1988年の設立以来、世界各国の投資家に資産運用サービスを提供しており、2012年6月末現在、グループ全体で7,161億米ドル（約56.8兆円^{*}）の資産を運用しています。

^{*}米ドルの円貨換算は便宜上、2012年6月29日現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値（1米ドル = 79.31円）により計算しております。

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

（後略）

[次へ](#)

2 投資方針

(1) 投資方針

<訂正前>

a. 基本方針

本ファンドは、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

b. 本ファンドの運用方針

- ・ 主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、マザーファンドの組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げられる場合もあります。）。なお、有価証券等に直接投資する場合があります。
- ・ 信託財産は、マザーファンドを通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、株式の組入れ比率を高位に保ちながら、長期的に外国株式市場のもたらすリターンを享受することを目指します。
- ・ 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
- ・ M S C I 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。
- ・ 運用の効率化を図るため、G S A M ニューヨークに世界株式(除く日本)および為替の運用の指図に係る権限(デリバティブ取引等に係る運用の指図を含みます。)を委託します。
- ・ 市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

c. マザーファンドの運用方針

- ・ 主として、日本を除く世界各国の株式に投資し、株式の組入れ比率を高位に保ちながら、長期的に外国株式市場のもたらすリターンを享受することを目指します。
- ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ・ M S C I コクサイ・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・ G S A M ニューヨークに世界株式(除く日本)および為替の運用の指図に関する権限(デリバティブ取引等にかかる運用の指図を含みます。)を委託します。
- ・ 市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

<訂正後>

a. 基本方針

本ファンドは、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

b. 本ファンドの運用方針

- ・ 主としてマザーファンドの受益証券に投資し、原則として、マザーファンドの組入れ比率は高位に保ちます（ただし、投資環境等により、当該受益証券の組入れ比率を引き下げられる場合もあります。）。なお、有価証券等に直接投資する場合があります。
- ・ 信託財産は、マザーファンドを通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、株式の組入れ比率を高位に保ちながら、長期的に外国株式市場のもたらすリターンを享受することを目指します。
- ・ 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。
- ・ M S C I 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。
- ・ 市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

c. マザーファンドの運用方針

- ・ 主として、日本を除く世界各国の株式に投資し、株式の組入れ比率を高位に保ちながら、長期的に外国株式市場のもたらすリターンを享受することを目指します。
- ・ 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ・ M S C I コクサイ・インデックス(円換算ベース)をベンチマークとします。
- ・ 市況動向や資金動向その他の要因等によっては、運用方針に従った運用ができない場合があります。

なお、本ファンドおよびマザーファンドでは、運用の効率化を図るため、関連会社に運用の指図にかかる権限を以下の通り委託します。

委託先の名称	委託先の所在地	委託の内容	委託にかかる費用
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)	アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク市	世界株式(除く日本) および為替の運用の 指図(デリバティブ 取引等にかかる運用 を含みます。)	別に定める取り決めに基 づく金額が委託会社から原則 として毎月支払われるもの とし、信託財産からの直接的 な支弁は行いません。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

(5) 課税上の取扱い

< 訂正前 >

(前略)

個人の受益者の場合^{*1}

時期	項目	税金
収益分配時	所得税および地方税	普通分配金 × 10% ^{*2}
換金時 (解約請求による場合)	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*2}
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*22}

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

*2 2012年12月31日までの期間については、10%（所得税7%、地方税3%）の税率が適用されます。詳しくは、後記「収益分配金の課税について」「換金時および償還時の課税について」をご覧ください。

(中略)

< 収益分配金の課税について >

(中略)

個人の受益者に対する課税

(中略)

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

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損・解約（償還）差損を含みます。）との損益通算が可能です。

(後略)

< 訂正後 >

(前略)

個人の受益者の場合^{*1}

時期	項目	税金
収益分配時	所得税および地方税	普通分配金 × 10% ^{*2}
換金時 (解約請求による場合)	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*2}
償還時	所得税および地方税	譲渡益 × 10% ^{*22}

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

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

(中略)

< 収益分配金の課税について >

(中略)

個人の受益者に対する課税

(中略)

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

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。

(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

(2012年9月28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		71,308,130	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29,284	0.04
合計(純資産総額)		71,278,846	100.00

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

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>

(2012年9月28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	11,438,844,491	56.06
	カナダ	1,174,799,664	5.76
	ドイツ	1,441,987,945	7.07
	イタリア	49,510,236	0.24
	フランス	164,951,531	0.81
	オーストラリア	872,071	0.00
	イギリス	2,228,017,422	10.92
	スイス	412,938,155	2.02
	バミューダ	138,088,394	0.68
	香港	520,993,341	2.55
	シンガポール	16,021,942	0.08
	ニュージーランド	10,576,274	0.05
	オランダ	459,380,471	2.25
	スペイン	3,360,606	0.02
	ベルギー	313,804,747	1.54
	スウェーデン	100,799,664	0.49
	ノルウェー	249,192,801	1.22
	オーストリア	21,471,513	0.11
	ルクセンブルク	84,153,225	0.41
	フィンランド	8,379,027	0.04
	デンマーク	111,436,948	0.55
	アイルランド	170,406,886	0.84
	イスラエル	54,588,004	0.27
ケイマン	174,254,926	0.85	
パナマ	186,212,917	0.91	
ジャージー	159,357,270	0.78	
小計		19,694,400,471	96.52

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	393,571,530	1.93
	カナダ	4,162,130	0.02
	イギリス	24,457,544	0.12
	香港	21,429,007	0.11
	シンガポール	2,669,791	0.01
小計		446,290,002	2.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		262,637,939	1.29
合計(純資産総額)		20,403,328,412	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

(2012年9月28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	G S 外国株計量運用ポートフォリオ マザーファンド	74,824,901	0.9756	73,005,297	0.9530	71,308,130	100.04

種類別及び業種別投資比率

(2012年9月28日現在)

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.04
合計	100.04

(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

(2012年9月28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

(2012年9月28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

(2012年9月28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	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび 機器	11,178	45,425.48	507,766,104	52,877.41	591,063,756	2.90
2	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	64,600	6,655.75	429,961,579	7,123.68	460,189,728	2.26
3	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバ コ	48,100	6,665.84	320,626,904	7,035.21	338,393,889	1.66
4	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	185,119	1,564.41	289,603,125	1,763.84	326,521,777	1.60
5	オランダ	株式	LYONDELLBASELL INDU-CL A	素材	77,468	3,773.66	292,338,536	4,025.88	311,877,491	1.53
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	95,154	3,237.63	308,073,638	3,156.76	300,379,102	1.47
7	アメリカ	株式	LORILLARD INC	食品・飲料・タバ コ	32,632	10,096.68	329,474,973	9,200.25	300,222,753	1.47
8	アメリカ	株式	AMGEN INC	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	45,339	5,510.37	249,834,937	6,538.96	296,470,088	1.45
9	アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・ サービス	4,986	47,020.16	234,442,557	58,704.39	292,700,138	1.43
10	アメリカ	株式	CONOCOPHILLIPS	エネルギー	65,262	4,610.18	300,869,582	4,453.46	290,641,967	1.42
11	アメリカ	投資 証券	AMERICAN TOWER CORP	不動産	51,515	5,276.55	271,821,632	5,514.25	284,066,897	1.39
12	アメリカ	株式	MARATHON PETROLEUM CORP	エネルギー	65,987	2,933.80	193,592,848	4,231.52	279,225,838	1.37
13	アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・ サービス	109,050	2,328.77	253,953,022	2,422.28	264,150,070	1.29
14	ドイツ	株式	HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	家庭用品・パーソ ナル用品	41,000	5,399.14	221,364,815	6,235.93	255,673,146	1.25
15	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	12,057	16,720.47	201,598,730	19,920.69	240,183,831	1.18
16	アメリカ	株式	DIRECTV	メディア	59,491	3,673.58	218,545,185	4,034.81	240,035,000	1.18
17	イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	電気通信サービス	103,759	2,213.75	229,696,755	2,244.19	232,855,117	1.14
18	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	96,902	2,533.63	245,514,783	2,343.51	227,091,775	1.11
19	アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	72,698	2,525.80	183,620,949	2,948.02	214,315,448	1.05
20	ベルギー	株式	ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	食品・飲料・タバ コ	31,326	6,158.74	192,928,864	6,696.03	209,759,898	1.03
21	アメリカ	株式	NETAPP INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび 機器	80,321	2,706.59	217,396,539	2,580.19	207,244,244	1.02
22	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	105,327	1,700.21	179,078,650	1,936.89	204,007,444	1.00
23	ドイツ	株式	BASF SE	素材	29,960	5,813.91	174,185,043	6,670.97	199,862,321	0.98
24	イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC-SPON ADR	医薬品・バイオテ クノロジー・ライ フサイエンス	55,061	3,476.72	191,431,857	3,629.35	199,835,750	0.98
25	アメリカ	株式	AFLAC INC	保険	51,470	3,601.67	185,378,205	3,703.07	190,597,115	0.93
26	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	保険	26,860	6,470.91	173,808,863	6,848.97	183,963,495	0.90
27	アメリカ	株式	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	素材	10,700	14,900.75	159,438,046	17,081.31	182,770,038	0.90
28	アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・ サービス	5,132	34,063.05	174,811,590	35,088.39	180,073,627	0.88
29	イギリス	株式	BG GROUP PLC	エネルギー	113,340	1,780.24	201,773,492	1,574.75	178,482,165	0.87
30	アメリカ	株式	MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	消費者サービス	58,018	3,100.61	179,891,515	3,071.40	178,196,949	0.87

種類別及び業種別投資比率

(2012年9月28日現在)

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	12.18
		素材	7.49
		資本財	5.00
		商業・専門サービス	0.03
		運輸	3.34
		自動車・自動車部品	0.37
		耐久消費財・アパレル	0.49
		消費者サービス	3.21
		メディア	3.02
		小売	3.23
		食品・生活必需品小売り	1.63
		食品・飲料・タバコ	7.54
		家庭用品・パーソナル用品	2.45
		ヘルスケア機器・サービス	0.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.68
		銀行	5.50
		各種金融	3.67
		保険	4.33
		不動産	1.16
		ソフトウェア・サービス	8.05
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.96		
電気通信サービス	3.17		
公益事業	2.97		
半導体・半導体製造装置	0.40		
投資証券	外国	不動産	2.19
合計			98.71

(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

(2012年9月28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

(2012年9月28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	17	米ドル	1,235,122.25	1,224,935	95,054,956	0.47
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	EURO STOXX50	買建	18	ユーロ	459,749.7	450,000	45,108,000	0.22
	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	2	英ポンド	117,362.7	115,090	14,499,038	0.07

(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

2012年9月28日及び同日前1年以内における各月末ならびに下記計算期末の純資産の推移は次の通りです。

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1期	(2006年9月19日)	41	41	1.0762	1.0762
第2期	(2007年3月16日)	51	51	1.1518	1.1518
第3期	(2007年9月18日)	66	66	1.1943	1.1943
第4期	(2008年3月17日)	61	61	0.9033	0.9033
第5期	(2008年9月16日)	67	67	0.8441	0.8441
第6期	(2009年3月16日)	33	33	0.4961	0.4961
第7期	(2009年9月16日)	57	57	0.6740	0.6740
第8期	(2010年3月16日)	63	63	0.7112	0.7112
第9期	(2010年9月16日)	62	62	0.6635	0.6635
第10期	(2011年3月16日)	69	69	0.7040	0.7040
第11期	(2011年9月16日)	60	60	0.5959	0.5959
第12期	(2012年3月16日)	75	75	0.7504	0.7504
第13期	(2012年9月18日)	73	73	0.7262	0.7262
	2011年9月末日	58	-	0.5725	-
	2011年10月末日	67	-	0.6520	-
	2011年11月末日	61	-	0.5986	-
	2011年12月末日	64	-	0.6184	-
	2012年1月末日	66	-	0.6383	-
	2012年2月末日	73	-	0.7156	-
	2012年3月末日	75	-	0.7348	-
	2012年4月末日	74	-	0.7208	-
	2012年5月末日	66	-	0.6438	-
	2012年6月末日	67	-	0.6570	-
	2012年7月末日	68	-	0.6781	-
	2012年8月末日	69	-	0.6922	-
	2012年9月末日	71	-	0.7090	-

(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
第10期	自 2010年9月17日 至 2011年3月16日	0.0000
第11期	自 2011年3月17日 至 2011年9月16日	0.0000
第12期	自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	0.0000
第13期	自 2012年3月17日 至 2012年9月18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10期	自 2010年9月17日 至 2011年3月16日	6.1
第11期	自 2011年3月17日 至 2011年9月16日	15.4
第12期	自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	25.9
第13期	自 2012年3月17日 至 2012年9月18日	3.2

(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	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)
第10期	自 2010年9月17日 至 2011年3月16日	14,059,123 (0)	9,331,663 (0)	99,315,232 (0)
第11期	自 2011年3月17日 至 2011年9月16日	12,324,431 (0)	10,365,526 (0)	101,274,137 (0)
第12期	自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	10,176,145 (0)	10,317,627 (0)	101,132,655 (0)
第13期	自 2012年3月17日 至 2012年9月18日	11,263,497 (0)	11,513,448 (0)	100,882,704 (0)

(注1) ()内の数字は本邦外における設定、解約及び発行済み口数です。

(注2) 設定口数には当初募集期間中の設定口数を含みます。

[次へ](#)

(参考) 運用実績

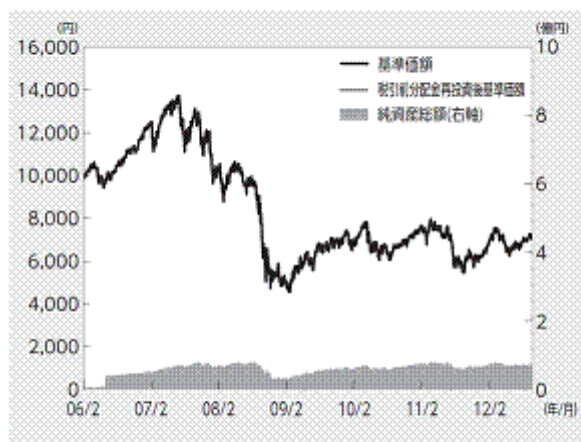
最新の運用実績は委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

下記は過去の実績であり、将来の成果を保証するものではありません。

2012年9月28日現在

基準価額・純資産の推移

2006年2月28日(設定日)～2012年9月28日



基準価額・純資産総額

基準価額	7,090円
純資産総額	0.7億円

期間別騰落率(%) (税引前分配金再投資)

期間	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	5年	設定来
ファンド	2.43	7.91	-3.51	23.84	5.47	-43.47	-29.10

分配の推移(円) (1万口当たり、税引前)

決算日	10/9/16	11/3/16	11/9/16	12/3/16	12/9/18	設定来累計
分配金	0	0	0	0	0	0

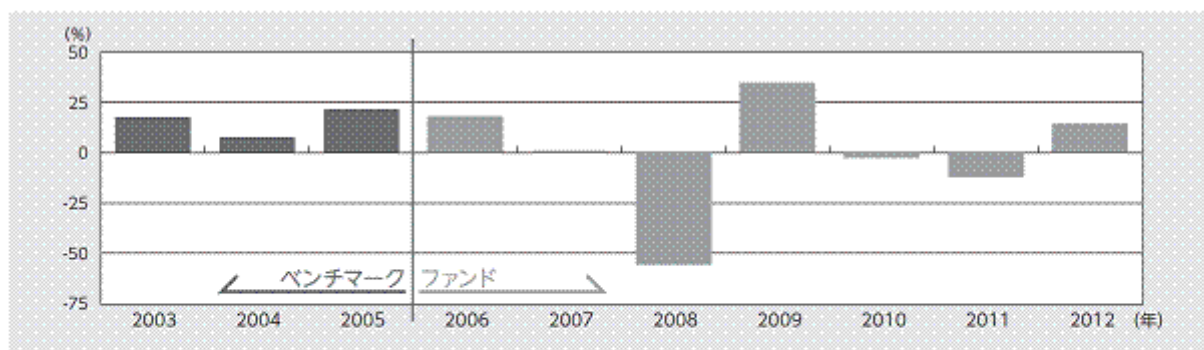
●税引前分配金再投資後基準価額および期間別騰落率(税引前分配金再投資)とは、本ファンドの決算時に収益の分配があった場合に、その分配金(税引前)で本ファンドを購入(再投資)した場合の基準価額および騰落率です。●運用状況によっては、分配金の金額が変わる場合、あるいは分配金が支払われない場合があります。

主要な資産の状況

組入上位銘柄

	銘柄名	投資国	セクター	比率
1	アップル	アメリカ	情報技術	2.9%
2	エクソン・モービル	アメリカ	エネルギー	2.3%
3	フィリップモリスインターナショナル	アメリカ	生活必需品	1.7%
4	ゼネラル・エレクトリック	アメリカ	資本財・サービス	1.6%
5	ライオンデルパゼル	オランダ	素材	1.5%
6	J.P.モルガン・チェース	アメリカ	金融	1.5%
7	ロリロード	アメリカ	生活必需品	1.5%
8	アムジェン	アメリカ	ヘルスケア	1.5%
9	グーグル	アメリカ	情報技術	1.4%
10	コノコフィリップス	アメリカ	エネルギー	1.4%

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。
- 2003年から2005年まではベンチマークの収益率を表示しています。
- ベンチマークはあくまで参考情報であり、本ファンドの運用実績ではありません。
- 2006年は設定日(2月28日)から年末までの騰落率、2012年は1月から9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 ファンドの情報 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13期計算期間（2012年3月17日から2012年9月18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12期 (2012年3月16日現在)	第13期 (2012年9月18日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	76,366,965	73,796,640
流動資産合計	76,366,965	73,796,640
資産合計	76,366,965	73,796,640
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	20,463	22,746
未払委託者報酬	443,209	492,771
その他未払費用	16,171	17,978
流動負債合計	479,843	533,495
負債合計	479,843	533,495
純資産の部		
元本等		
元本	101,132,655	100,882,704
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,245,533	27,619,559
(分配準備積立金)	5,115,364	5,035,232
元本等合計	75,887,122	73,263,145
純資産合計	75,887,122	73,263,145
負債純資産合計	76,366,965	73,796,640

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	第13期 自 2012年3月17日 至 2012年9月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	16,623,847	2,073,590
営業収益合計	16,623,847	2,073,590
営業費用		
受託者報酬	20,463	22,746
委託者報酬	443,209	492,771
その他費用	16,171	17,978
営業費用合計	479,843	533,495
営業利益又は営業損失()	16,144,004	2,607,085
経常利益又は経常損失()	16,144,004	2,607,085
当期純利益又は当期純損失()	16,144,004	2,607,085
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()	783,624	726,779
期首剰余金又は期首欠損金()	40,928,839	25,245,533
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,159,738	2,908,678
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,159,738	2,908,678
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,836,812	3,402,398
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,836,812	3,402,398
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	25,245,533	27,619,559

[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12期 自 2011年 9月17日 至 2012年 3月16日	第13期 自 2012年 3月17日 至 2012年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託 受益証券の基準価額で評価して おります。	親投資信託受益証券 同左
2. その他財務諸表作成のための 基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 2012年 9月16日及びその翌日が休 業日のため、当計算期間末日は2012 年 9月18日としております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第12期 (2012年 3月16日現在)	第13期 (2012年 9月18日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	101,274,137円	101,132,655円
期中追加設定元本額	10,176,145円	11,263,497円
期中一部解約元本額	10,317,627円	11,513,448円
2. 受益権の総数	101,132,655口	100,882,704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25,245,533円であ ります。	純資産額が元本総額を下回って おり、その差額は27,619,559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12期 自 2011年 9月17日 至 2012年 3月16日	第13期 自 2012年 3月17日 至 2012年 9月18日
分配金の計算過程		
費用控除後の配当等収益額	744,302円	462,998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	19,271,565円	19,774,821円
分配準備積立金額	4,371,062円	4,572,234円
本ファンドの分配対象収益額	24,386,929円	24,810,053円
本ファンドの期末残存口数	101,132,655口	100,882,704口
1口当たり収益分配対象額	0.241138円	0.245929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12期 自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	第13期 自 2012年3月17日 至 2012年9月18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では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則しているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。 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。	コンプライアンス部門ならびにオペレーション部門では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則しているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。 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。

金融商品の時価等に関する事項

区分	第12期 自 2011年9月17日 至 2012年3月16日	第13期 自 2012年3月17日 至 2012年9月18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12期 (2012年3月16日現在)	第13期 (2012年9月18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	15,868,289	1,316,513
合計	15,868,289	1,316,513

(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12期 (2012年3月16日現在)	第13期 (2012年9月18日現在)
1口当たり純資産額	0.7504円	0.7262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	75,634,560	73,796,640	
合計			75,634,560	73,796,640	

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。

同親投資信託の状況は以下の通りです。

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(2012年3月16日現在)	(2012年9月18日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		195,658,668	110,401,039
コール・ローン		213,135,352	155,635,228
株式		22,895,298,813	20,155,356,880
投資証券		475,916,962	486,029,154
派生商品評価勘定		382,534	7,444,520
未収入金		2,174,958,091	1,171,184,798
未収配当金		60,320,947	45,320,238
未収利息		460	337
差入委託証拠金		19,676,658	9,423,786
流動資産合計		26,035,348,485	22,140,795,980
資産合計		26,035,348,485	22,140,795,980
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,373,400	-
未払金		645,351,471	1,224,131,975
流動負債合計		650,724,871	1,224,131,975
負債合計		650,724,871	1,224,131,975
純資産の部			
元本等			
元本		25,358,268,480	21,436,818,492
剰余金			
剰余金又は欠損金()		26,355,134	520,154,487
元本等合計		25,384,623,614	20,916,664,005
純資産合計		25,384,623,614	20,916,664,005
負債純資産合計		26,035,348,485	22,140,795,980

(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 2011年 9月17日 至 2012年 3月16日	自 2012年 3月17日 至 2012年 9月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券 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	(2012年3月16日現在)	(2012年9月18日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	29,744,270,964円	25,358,268,480円
期中追加設定元本額	394,241,940円	217,494,194円
期中一部解約元本額	4,780,244,424円	4,138,944,182円
期末元本額	25,358,268,480円	21,436,818,492円
元本の内訳		
GS 外国株式インデックス・プラス	76,290,675円	75,634,560円
GS グローバル・バランス・ファンド2 (適格機関投資家専用)	6,623,549,235円	6,364,795,876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)	869,865,422円	884,380,561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)	399,166,005円	385,840,445円
GS 外国株計量運用ポートフォリオ(投資一任契約用)	17,389,397,143円	13,726,167,050円
2. 受益権の総数	25,358,268,480口	21,436,818,492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520,154,487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 2011年 9月17日 至 2012年 3月16日	自 2012年 3月17日 至 2012年 9月18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及び投資証券であり、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>	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では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則しているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。</p> <p>マーケット・リスク管理専任部門では、運用チームとは独立した立場で、運用チームにより構築されたポジションのリスク水準をモニタリングし、各運用チーム、リスク検討委員会に報告します。</p> <p>リスク検討委員会は、法務部・コンプライアンス部を含む各部署の代表から構成されており、マーケット・リスク管理専任部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、検討、決定等を月次で行います。</p>	<p>コンプライアンス部門ならびにオペレーション部門では、運用チームから独立した立場で、法令や信託約款等に実際の売買取引が則しているか、また日々のポジションのモニタリングを行っております。</p> <p>マーケット・リスク管理専任部門では、運用チームとは独立した立場で、運用チームにより構築されたポジションのリスク水準をモニタリングし、各運用チーム、リスク検討委員会に報告します。</p> <p>リスク検討委員会は、法務部・コンプライアンス部を含む各部署の代表から構成されており、マーケット・リスク管理専任部門からの報告事項に対して、必要な報告聴取、調査、検討、決定等を月次で行います。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	（2012年3月16日現在）	（2012年9月18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	1,698,843,455	1,070,998,682
投資証券	15,862,959	24,426,435
合計	1,714,706,414	1,095,425,117

（注）当親投資信託の計算期間は、原則として、3月17日から翌年3月16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

（1）株式関連

区分	種類	（2012年3月16日現在）				（2012年9月18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	126,752,276	-	127,134,810	382,534	153,008,214	-	160,452,734	7,444,520
	合計	126,752,276	-	127,134,810	382,534	153,008,214	-	160,452,734	7,444,520

（2）通貨関連

区分	種類	（2012年3月16日現在）				（2012年9月18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）

市場取引以外の取引	為替予約取引								
	売建								
	米ドル	1,082,753,100	-	1,086,020,000	3,266,900	-	-	-	-
	カナダドル	160,229,900	-	160,783,800	553,900	-	-	-	-
	ユーロ	140,429,400	-	140,958,300	528,900	-	-	-	-
	英ポンド	167,052,800	-	167,897,600	844,800	-	-	-	-
	スイスフラン	15,330,600	-	15,383,300	52,700	-	-	-	-
	香港ドル	23,606,000	-	23,672,000	66,000	-	-	-	-
	シンガポールドル	15,820,800	-	15,876,000	55,200	-	-	-	-
	イスラエルシェケル	2,205,000	-	2,210,000	5,000	-	-	-	-
合計	1,607,427,600	-	1,612,801,000	5,373,400	-	-	-	-	

(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. 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。

・為替予約取引

1. 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 - (1) 予約為替の受渡し日（以下「当該日」という。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該予約為替は当該対顧客先物相場の仲値により評価しております。
 - (2) 当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - 当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートにより評価しております。
 - 当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値により評価しております。
2. 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値により評価しております。

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	(2012年3月16日現在)	(2012年9月18日現在)
1口当たり純資産額	1.0010円	0.9757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	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
米ドル	株式	BP PLC-SPONS ADR	25,071	43.27	1,084,822.17	
		CHEVRON CORP	8,694	117.14	1,018,415.16	
		CONOCOPHILLIPS	65,262	58.30	3,804,774.60	
		EXXON MOBIL CORP	64,600	91.91	5,937,386.00	
		HESS CORP	9,305	55.49	516,334.45	
		MARATHON PETROLEUM CORP	65,987	53.64	3,539,542.68	
		MCDERMOTT INTL INC	11,474	12.97	148,817.78	
		MURPHY OIL CORP	11,468	55.63	637,964.84	
		OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	15,244	90.06	1,372,874.64	
		PHILLIPS 66	4,714	46.14	217,503.96	
		SUNOCO INC	6,088	47.19	287,292.72	
		TESORO CORP	12,776	40.56	518,194.56	
		ULTRA PETROLEUM CORP	62,944	23.30	1,466,595.20	
		VALERO ENERGY CORP	8,634	32.04	276,633.36	
		WPX ENERGY INC	4,885	17.43	85,145.55	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,700	220.41	2,358,387.00	
		COMPASS MINERALS INTERNATIONAL, INC.	10,149	72.29	733,671.21	
		LYONDELLBASELL INDU-CL A	77,468	51.98	4,026,786.64	
		NEWMONT MINING CORP	3,174	56.96	180,791.04	
		ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES	8,724	46.61	406,625.64	
		BOEING CO/THE	22,910	69.92	1,601,867.20	
		EMERSON ELECTRIC CO	6,784	50.24	340,828.16	
		GENERAL ELECTRIC CO	185,119	22.05	4,081,873.95	
		HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,181	41.54	215,218.74	
		KBR INC	13,971	31.24	436,454.04	
		LOCKHEED MARTIN CORPORATION	1,352	92.21	124,667.92	
		NAVISTAR INTERNATIONAL	3,996	25.07	100,179.72	
		TORO CO	22,691	38.97	884,268.27	
		WABCO HOLDINGS INC	7,290	60.93	444,179.70	
		CLEAN HARBORS INC	1,854	53.55	99,281.70	
		CSX CORP	10,256	23.26	238,554.56	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	6,000	0.72	4,350.00	
		NORFOLK SOUTHERN CORP	33,667	74.23	2,499,101.41	
		UNION PACIFIC CORP	10,037	126.91	1,273,795.67	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	24,119	74.23	1,790,353.37			

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
		DR HORTON INC	6,328	21.58	136,558.24	
		MOHAWK INDUSTRIES INC	2,901	78.15	226,713.15	
		CARNIVAL CORP	57,437	37.64	2,161,928.68	
		MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	58,018	41.16	2,388,020.88	
		MCDONALD'S CORP	8,066	92.14	743,201.24	
		STARBUCKS CORP	10,183	49.66	505,687.78	
		WEIGHT WATCHERS INTL INC	4,909	55.37	271,811.33	
		YUM! BRANDS INC	6,330	66.54	421,198.20	
		CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	12,764	16.82	214,690.48	
		DIRECTV	59,491	54.18	3,223,222.38	
		DISH NETWORK CORP-A	37,338	32.01	1,195,189.38	
		PANDORA MEDIA INC	65,982	10.72	707,327.04	
		TIME WARNER INC	22,600	44.87	1,014,062.00	
		VIACOM INC-CLASS B	9,035	52.47	474,066.45	
		WALT DISNEY CO/THE	13,964	52.15	728,222.60	
		AMAZON.COM INC	12,057	258.00	3,110,706.00	
		FAMILY DOLLAR STORES	24,364	64.24	1,565,143.36	
		GAP INC/THE	4,737	36.05	170,768.85	
		GUESS? INC	16,881	27.96	471,992.76	
		LIMITED BRANDS INC	7,126	50.23	357,938.98	
		PETSMART INC	12,640	68.21	862,174.40	
		PRICELINE.COM INC	524	643.35	337,115.40	
		ROSS STORES INC	3,243	67.35	218,416.05	
		TJX COMPANIES INC	10,501	45.98	482,835.98	
		URBAN OUTFITTERS INC	17,423	39.82	693,783.86	
		COSTCO WHOLESALE CORP	22,798	102.25	2,331,095.50	
		CVS CAREMARK CORP	29,572	46.90	1,386,926.80	
		FLOWERS FOODS INC	4,785	20.53	98,236.05	
		LORILLARD INC	32,632	117.09	3,820,880.88	
		PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	48,100	90.69	4,362,189.00	
		REYNOLDS AMERICAN INC	39,421	43.73	1,723,880.33	
		HERBALIFE LTD	15,129	51.37	777,176.73	
		NU SKIN ENTERPRISES INC - A	2,094	42.75	89,518.50	
		AMERISOURCEBERGEN CORP	25,818	38.02	981,600.36	
		CARDINAL HEALTH INC	10,842	38.23	414,489.66	
		DENTSPLY INTERNATIONAL INC	16,277	37.37	608,271.49	
		ABBOTT LABORATORIES	5,795	69.12	400,550.40	
		AMGEN INC	45,339	82.09	3,721,878.51	
		BRISTOL-MYERS SQUIBB	3,963	33.07	131,056.41	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
		CELGENE CORP	9,059	76.81	695,821.79	
		ELI LILLY & CO	40,652	46.83	1,903,733.16	
		ENDO PHARMACEUT HLDGS INC	9,919	33.53	332,584.07	
		GILEAD SCIENCES INC	33,362	65.80	2,195,219.60	
		GLAXOSMITHKLINE PLC-SPON ADR	55,061	46.58	2,564,741.38	
		HOSPIRA INC	6,293	34.71	218,430.03	
		MERCK & CO. INC.	42,650	44.00	1,876,600.00	
		PFIZER INC	105,327	24.02	2,529,954.54	
		TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	10,545	39.95	421,272.75	
		VERTEX PHARMACEUTICALS INC	5,866	57.54	337,529.64	
		WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	97,880	12.84	1,256,779.20	
		WATSON PHARMACEUTICALS INC	11,138	81.39	906,521.82	
		BB&T CORP	6,710	33.57	225,254.70	
		COMMERCE BANCSHARES INC	5,093	41.73	212,530.89	
		EAST WEST BANCORP INC	15,239	22.41	341,505.99	
		FIRST NIAGARA FINANCIAL GRP	58,870	8.21	483,322.70	
		M & T BANK CORPORATION	2,778	94.08	261,354.24	
		PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	30,111	65.66	1,977,088.26	
		WELLS FARGO & CO	6,882	35.33	243,141.06	
		CME GROUP INC	1,456	58.72	85,496.32	
		DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,138	38.73	121,534.74	
		FRANKLIN RESOURCES INC	12,343	126.50	1,561,389.50	
		JPMORGAN CHASE & CO	95,154	41.19	3,919,393.26	
		LEUCADIA NATIONAL CORP	4,638	23.39	108,482.82	
		MORGAN STANLEY	38,335	17.80	682,363.00	
		SEI INVESTMENTS COMPANY	11,193	22.64	253,409.52	
		STATE STREET CORP	18,091	43.91	794,375.81	
		AFLAC INC	51,470	49.27	2,535,926.90	
		BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	26,860	88.52	2,377,647.20	
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,151	58.07	182,978.57	
		WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	9,076	36.76	333,633.76	
		ACCENTURE PLC-CL A	3,268	65.60	214,380.80	
		COMPUTER SCIENCES CORP	26,498	34.18	905,701.64	
		EBAY INC	14,126	50.48	713,080.48	
		GOOGLE INC-CL A	4,986	709.98	3,539,960.28	
		INTL BUSINESS MACHINES CORP	6,695	207.15	1,386,869.25	
		MASTERCARD INC-CLASS A	5,132	453.50	2,327,362.00	
		MICROSOFT CORP	96,902	31.21	3,024,311.42	
		NICE SYSTEMS LTD-SPONS ADR	634	30.92	19,603.28	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
		ORACLE CORP	109,050	33.10	3,609,555.00	
		SALESFORCE.COM INC	12,622	158.16	1,996,295.52	
		SOLERA HOLDINGS INC	7,566	43.99	332,828.34	
		SYMANTEC CORP	30,148	19.11	576,128.28	
		VERISIGN INC	12,229	47.00	574,763.00	
		APPLE INC	11,178	699.80	7,822,364.40	
		EMC CORP/MA	10,620	27.58	292,899.60	
		HEWLETT-PACKARD CO	17,846	18.21	324,975.66	
		INGRAM MICRO INC-CL A	77,892	16.41	1,278,207.72	
		NETAPP INC	80,321	35.41	2,844,166.61	
		QUALCOMM INC	33,317	64.81	2,159,274.77	
		SEAGATE TECHNOLOGY	10,802	29.75	321,359.50	
		WESTERN DIGITAL CORP	35,721	39.48	1,410,265.08	
		AT&T INC	72,698	37.60	2,733,444.80	
		CENTURYLINK INC	16,554	42.08	696,592.32	
		VODAFONE GROUP PLC-SP ADR	101,923	28.25	2,879,324.75	
		WINDSTREAM CORP	45,050	10.84	488,342.00	
		CONSOLIDATED EDISON INC	34,296	59.61	2,044,384.56	
		ENTERGY CORP	7,965	68.33	544,248.45	
		SOUTHERN CO/THE	46,311	44.93	2,080,753.23	
		FIRST SOLAR INC	27,389	23.24	636,520.36	
		INTEL CORP	19,460	23.31	453,612.60	
小計					166,455,652.62	
					(13,083,414,295)	
カナダドル	株式	CANADIAN NATURAL RESOURCES	12,000	33.13	397,560.00	
		CENOVUS ENERGY INC	26,400	35.38	934,032.00	
		ENCANA CORP	52,800	22.36	1,180,608.00	
		ENERFLEX LTD	10,700	12.65	135,355.00	
		SUNCOR ENERGY INC	36,700	34.02	1,248,534.00	
		TRANSCANADA CORPOPORATION	1,800	45.17	81,306.00	
		TRINIDAD DRILLING LTD	15,900	6.90	109,710.00	
		BARRICK GOLD CORP	24,200	41.10	994,620.00	
		CANFOR CORP	4,400	13.43	59,092.00	
		GOLDCORP INC	15,900	45.10	717,090.00	
		NEVSUN RESOURCES LTD	30,700	4.39	134,773.00	
		SILVER WHEATON CORP	2,600	37.98	98,748.00	
		TECK RESOURCES LTD-CLS B	4,900	31.78	155,722.00	
		WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,300	58.00	481,400.00	
		CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,900	90.99	809,811.00	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考		
				単価	金額			
ユーロ	株式	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,800	83.21	149,778.00			
		AIMIA INC	37,500	14.12	529,500.00			
		ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	1,100	45.61	50,171.00			
		JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	8,700	14.17	123,279.00			
		CML HEALTHCARE INC	3,900	8.87	34,593.00			
		NATIONAL BANK OF CANADA	27,800	74.84	2,080,552.00			
		ROYAL BANK OF CANADA	21,300	56.04	1,193,652.00			
		TORONTO-DOMINION BANK	2,200	81.66	179,652.00			
		INTACT FINANCIAL CORP	3,300	58.51	193,083.00			
		MANULIFE FINANCIAL CORP	83,900	12.28	1,030,292.00			
		BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	3,700	16.95	62,715.00			
		BELL ALIANT INC	18,300	26.07	477,081.00			
		小計					13,642,709.00	
							(1,099,875,199)	
				ENI SPA	19,830	18.51	367,053.30	
				ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5,526	27.91	154,230.66	
				TECNICAS REUNIDAS SA	916	36.77	33,685.90	
				BASF SE	29,960	66.65	1,996,834.00	
				K+S AG-REG	3,822	38.29	146,363.49	
				KONINKLIJKE PHILIPS ELECTRON	10,645	18.88	201,030.82	
				LEGRAND SA	12,235	28.73	351,511.55	
				METSO OYJ	2,934	31.78	93,242.52	
				DEUTSCHE POST AG-REG	58,391	15.40	899,221.40	
				CONTINENTAL AG	3,514	82.95	291,486.30	
				DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,117	39.80	402,656.60	
				LEONI AG	5,584	33.01	184,327.84	
				MICHELIN (CGDE)-B	1,510	62.65	94,601.50	
				HERMES INTERNATIONAL	2,028	215.45	436,932.60	
				TOMTOM	19,360	3.92	75,910.56	
				PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	11,664	20.54	239,636.88	
				METRO AG	14,634	24.68	361,167.12	
				ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	31,326	65.05	2,037,756.30	
		DANONE	8,752	48.91	428,060.32			
		BEIERSDORF AG	10,776	55.54	598,499.04			
		HENKEL AG & CO KGAA	2,859	49.32	141,005.88			
		HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	41,000	60.10	2,464,100.00			
		BAYER AG-REG	23,628	65.57	1,549,287.96			
		MERCK KGAA	18,214	94.85	1,727,597.90			

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考		
				単価	金額			
小計 英ポンド	株式	BANCA CARIGE SPA	55,933	0.80	44,746.40			
		RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	2,545	28.60	72,787.00			
		BANCA GENERALI SPA	10,055	10.64	106,985.20			
		DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	2,603	34.06	88,671.19			
		GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	7,641	58.58	447,609.78			
		EULER HERMES SA	848	55.46	47,030.08			
		HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	1,175	51.19	60,148.25			
		MUENCHENER RUECKVER AG-REG	713	124.35	88,661.55			
		SAP AG	12,842	54.90	705,025.80			
		UNITED INTERNET AG-REG SHARE	34,621	16.41	568,303.71			
		FREENET AG	9,603	12.43	119,413.30			
		RWE AG	20,460	35.73	731,035.80			
		RWE AG-NON VTG PFD	7,281	32.21	234,557.41			
		ASML HOLDING NV	3,040	43.77	133,060.80			
							18,724,236.71	
							(1,927,472,926)	
				BG GROUP PLC	113,340	12.91	1,463,219.40	
				ENQUEST PLC	43,191	1.23	53,513.64	
				PETROFAC LTD	85,206	16.78	1,429,756.68	
				TULLOW OIL PLC	55,095	14.44	795,571.80	
				WOOD GROUP (JOHN) PLC	2,467	8.42	20,784.47	
				BHP BILLITON PLC	48,514	20.25	982,651.07	
				CRODA INTERNATIONAL PLC	1,471	24.12	35,480.52	
				RANDGOLD RESOURCES LTD	1,343	74.55	100,120.65	
				RIO TINTO PLC	22,764	32.16	732,090.24	
				XSTRATA PLC	19,820	10.53	208,803.70	
				ASHTREAD GROUP PLC	15,749	3.33	52,491.41	
				BAE SYSTEMS PLC	32,752	3.42	112,011.84	
				MORGAN CRUCIBLE COMPANY PLC	72,007	2.89	208,100.23	
				SMITHS GROUP PLC	7,875	10.41	81,978.75	
				EASYJET PLC	94,010	5.69	534,916.90	
				TAYLOR WIMPEY PLC	372,860	0.56	209,547.32	
		CARNIVAL PLC	7,412	22.67	168,030.04			
		TUI TRAVEL PLC	36,311	2.32	84,277.83			
		WHITBREAD PLC	11,463	22.95	263,075.85			
		CRESTON PLC	34,336	0.91	31,417.44			
		DEBENHAMS PLC	197,530	0.99	196,443.58			
		NEXT PLC	2,716	34.01	92,371.16			
		BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	19,594	31.54	617,994.76			

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
小計		DIAGEO PLC	67,034	16.83	1,128,517.39	
		IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	22,622	23.18	524,377.96	
		TATE & LYLE PLC	89,014	6.48	576,810.72	
		UNILEVER PLC	8,918	22.68	202,260.24	
		ASTRAZENECA PLC	15,104	28.88	436,279.04	
		DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	8,139	5.69	46,310.91	
		BARCLAYS PLC	212,502	2.28	484,504.56	
		HSBC HOLDINGS PLC	280,949	5.83	1,638,494.56	
		STANDARD CHARTERED PLC	32,325	15.14	489,400.50	
		IG GROUP HOLDINGS PLC	16,304	4.66	75,976.64	
		INTERNATIONAL PERSONAL FINAN	7,151	3.22	23,076.27	
		CATLIN GROUP LTD	95,287	4.78	456,234.15	
		HISCOX LTD	40,546	4.82	195,634.45	
		LANCASHIRE HOLDINGS LTD	21,566	8.15	175,762.90	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	34,277	1.04	35,648.08	
		NATIONAL GRID PLC	150,202	6.79	1,019,871.58	
					(2,039,693,895)	
スイスフラン	株式	SYNGENTA AG-REG	3,263	341.70	1,114,967.10	
		GEBERIT AG-REG	1,575	207.00	326,025.00	
		ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3,964	175.80	696,871.20	
		JULIUS BAER GROUP LTD	8,013	34.38	275,486.94	
		UBS AG-REG	28,426	12.40	352,482.40	
		SWISS RE AG	31,589	62.70	1,980,630.30	
小計					4,746,462.94	(402,215,269)
スウェーデン クローナ	株式	LUNDIN PETROLEUM AB	4,630	159.90	740,337.00	
		ORIFLAME COSMETICS SA-SDR	31,556	243.70	7,690,197.20	
		NORDEA BANK AB	43,650	66.00	2,880,900.00	
		SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	21,790	54.50	1,187,555.00	
小計					12,498,989.20	(149,237,931)
ノルウェー クローネ	株式	SONGA OFFSHORE SE	19,908	13.20	262,785.60	
		STATOIL ASA	49,497	153.80	7,612,638.60	
		YARA INTERNATIONAL ASA	3,811	303.10	1,155,114.10	
		ORKLA ASA	37,577	44.32	1,665,412.64	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
小計		DNB ASA	35,524	73.35	2,605,685.40	
		STOREBRAND ASA	27,678	28.51	789,099.78	
		TELENOR ASA	50,223	110.20	5,534,574.60	
					19,625,310.72	
					(269,651,769)	
デンマーク クローネ	株式	PANDORA A/S	6,611	86.25	570,198.75	
		NOVO NORDISK A/S-B	9,050	879.00	7,954,950.00	
小計					8,525,148.75	
					(117,732,304)	
オーストラ リアドル	株式	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	5,501	16.30	89,666.30	
		ORIGIN ENERGY LIMITED	18,286	11.77	215,226.22	
		DULUXGROUP LTD	22,090	3.33	73,559.70	
		FORTESCUE METALS GROUP LTD	97,637	2.99	291,934.63	
		NEWCREST MINING LIMITED	5,060	29.12	147,347.20	
		OZ MINERALS LTD	15,687	7.05	110,593.35	
		RIO TINTO LTD	4,352	57.50	250,240.00	
		NRW HOLDINGS LTD	14,110	2.38	33,581.80	
		CABCHARGE AUSTRALIA LTD	21,618	5.87	126,897.66	
		WESFARMERS LTD-PPS	4,470	35.62	159,221.40	
		WOOLWORTHS LTD	11,581	28.56	330,753.36	
		SONIC HEALTHCARE LTD	8,460	12.88	108,964.80	
		CSL LTD	3,260	42.25	137,735.00	
		WESTPAC BANKING CORPORATION	30,871	24.42	753,869.82	
		SUNCORP GROUP LTD	124,425	9.46	1,177,060.50	
		TELSTRA CORP LTD	19,063	3.79	72,248.77	
小計					4,078,900.51	
					(335,040,887)	
ニュージー ランドドル	株式	NEW ZEALAND OIL & GAS LTD	19,719	0.84	16,563.96	
		AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	11,841	2.64	31,260.24	
		VECTOR LTD	4,755	2.89	13,741.95	
小計					61,566.15	
					(3,990,102)	
香港ドル	株式	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	97,200	3.12	303,264.00	
		HUTCHISON WHAMPOA	72,000	74.65	5,374,800.00	
		NWS HOLDINGS LTD	23,000	12.32	283,360.00	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
		CATHAY PACIFIC AIRWAYS	23,000	12.88	296,240.00	
		ORIENT OVERSEAS INTL LTD	9,500	46.30	439,850.00	
		YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	12,500	25.90	323,750.00	
		MGM CHINA HOLDINGS LTD	207,600	13.26	2,752,776.00	
		SANDS CHINA LTD	23,200	29.20	677,440.00	
		SJM HOLDINGS LTD	296,000	16.74	4,955,040.00	
		WYNN MACAU LTD	25,200	20.25	510,300.00	
		LI & FUNG LTD	24,000	12.76	306,240.00	
		HENGAN INTL GROUP CO LTD	11,500	75.60	869,400.00	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	225,500	24.15	5,445,825.00	
		HANG SENG BANK	25,300	114.90	2,906,970.00	
		FIRST PACIFIC COMPANY	90,000	8.66	779,400.00	
		HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	45,400	120.90	5,488,860.00	
		AIA GROUP LTD	169,000	28.85	4,875,650.00	
		CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	61,000	114.10	6,960,100.00	
		EMPEROR INTL HLDG LTD	252,000	1.86	468,720.00	
		EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	89,000	3.21	285,690.00	
		GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	21,419	23.45	502,275.55	
		GREENTOWN CHINA HOLDINGS	29,500	8.62	254,290.00	
		K WAH INTL HOLDINGS	101,000	3.51	354,510.00	
		SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	219,500	13.12	2,879,840.00	
		SOHO CHINA LTD	353,500	4.97	1,756,895.00	
		SWIRE PACIFIC LTD 'B'	32,500	18.02	585,650.00	
		SWIRE PACIFIC LTD -A-	81,000	93.75	7,593,750.00	
		WHEELLOCK & CO LTD	32,000	33.70	1,078,400.00	
		CLP HOLDINGS LTD	119,500	65.25	7,797,375.00	
		POWER ASSETS HOLDINGS LTD	15,500	63.25	980,375.00	
		SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	1,207,000	0.30	362,100.00	
小計					68,449,135.55	
					(694,074,234)	
シンガポールドル	株式	FRASER AND NEAVE LTD	1,000	8.97	8,970.00	
		KEPPEL CORP LTD	2,000	11.40	22,800.00	
		SEMBCORP INDUSTRIES LTD	1,000	5.75	5,750.00	
		SINGAPORE TECH ENGINEERING	3,000	3.48	10,440.00	
		STX OSV HOLDINGS LTD	9,000	1.63	14,715.00	
		COMFORTDELGRO CORP LTD	1,000	1.66	1,660.00	
		SIA ENGINEERING CO LTD	1,000	4.14	4,140.00	
		GENTING SINGAPORE PLC	7,000	1.40	9,800.00	

通貨	種類	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
小計		STAMFORD LAND CORP LTD	17,000	0.57	9,690.00	
		WILMAR INTERNATIONAL LTD	4,000	3.29	13,160.00	
		DBS GROUP HOLDINGS LTD	5,279	14.62	77,178.98	
		UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,000	19.80	19,800.00	
		CAPITALAND LTD	1,000	3.23	3,230.00	
		UOL GROUP LTD	5,000	5.55	27,750.00	
		M1 LTD	1,000	2.70	2,700.00	
		SINGAPORE TELECOM LTD	10,000	3.34	33,400.00	
					265,183.98	
					(17,011,552)	
イスラエル シュケル	株式	ISRAEL CHEMICALS LTD	5,110	46.00	235,060.00	
		ISRAEL CORP LIMITED/THE	18	2,339.00	42,102.00	
		DELEK GROUP LTD	100	625.00	62,500.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	219	129.70	28,404.30	
		BANK HAPOALIM BM	14,148	12.80	181,094.40	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	8,104	9.89	80,148.56	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	3,240	32.85	106,434.00	
		BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	11,423	4.70	53,688.10	
					789,431.36	
					(15,946,513)	
合計					20,155,356,880	
					(20,155,356,880)	

(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 135銘柄	100.0%	64.9%
カナダドル	株式 27銘柄	100.0%	5.5%
ユーロ	株式 38銘柄	100.0%	9.6%
英ポンド	株式 39銘柄	100.0%	10.1%
スイスフラン	株式 6銘柄	100.0%	2.0%
スウェーデンクローナ	株式 4銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	株式 7銘柄	100.0%	1.3%
デンマーククローネ	株式 2銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	株式 16銘柄	100.0%	1.7%
ニュージーランドドル	株式 3銘柄	100.0%	0.0%
香港ドル	株式 31銘柄	100.0%	3.4%
シンガポールドル	株式 16銘柄	100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%	0.1%

(イ) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額金額	備考
米ドル	投資証券	AMERICAN TOWER CORP	51,515	3,667,352.85	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,154	304,360.20	
		HEALTH CARE REIT INC	2,165	126,024.65	
		RAYONIER INC	20,286	1,030,123.08	
小計			5,127,860.78 (403,049,857)		
カナダドル	投資証券	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,400	66,816.00	
小計				66,816.00 (5,386,705)	
英ポンド	投資証券	HAMMERSON PLC	25,796	120,493.11	
		MUCKLOW (A & J) GROUP PLC	22,806	82,101.60	
小計				202,594.71 (25,853,110)	
オーストラリアドル	投資証券	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	51,478	101,411.66	
		WESTFIELD GROUP	22,577	226,221.54	
小計				327,633.20 (26,911,791)	
香港ドル	投資証券	FORTUNE REIT	34,000	202,300.00	
		LINK REIT	6,000	216,600.00	
		CHAMPION REIT	564,000	1,962,720.00	
小計				2,381,620.00 (24,149,626)	
シンガポールドル	投資証券	SUNTEC REIT	3,000	4,410.00	
		AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL	1,000	1,400.00	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	2,000	4,760.00	
小計				10,570.00 (678,065)	
合計				486,029,154 (486,029,154)	

(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 4 銘柄	100.0%	82.9%
カナダドル	投資証券 1 銘柄	100.0%	1.1%
英ポンド	投資証券 2 銘柄	100.0%	5.3%
オーストラリアドル	投資証券 2 銘柄	100.0%	5.5%
香港ドル	投資証券 3 銘柄	100.0%	5.0%
シンガポールドル	投資証券 3 銘柄	100.0%	0.1%

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

「（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

(2012年9月28日現在)

資産総額	71,308,130円
負債総額	29,284円
純資産総額（ - ）	71,278,846円
発行済口数	100,529,494口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7090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

(2012年9月28日現在)

資産総額	21,227,944,617円
負債総額	824,616,205円
純資産総額（ - ）	20,403,328,412円
発行済口数	21,408,845,671口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9530円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

原届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況」については、下記の内容に更新されます。

<訂正・更新後>

1 委託会社等の概況

(1) 資本金の額（本書提出日現在）

資本金の額：金 4 億9,000万円

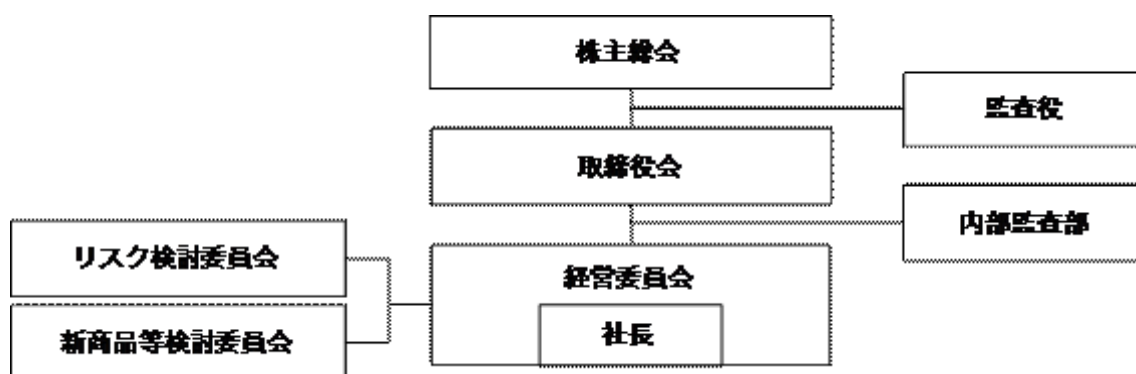
発行する株式の総数：8,000株

発行済株式の総数：6,400株

最近5年間における主な資本の額の増減：該当事項はありません。

(2) 委託会社等の機構

委託会社の業務運営の組織体系は以下の通りです。



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

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

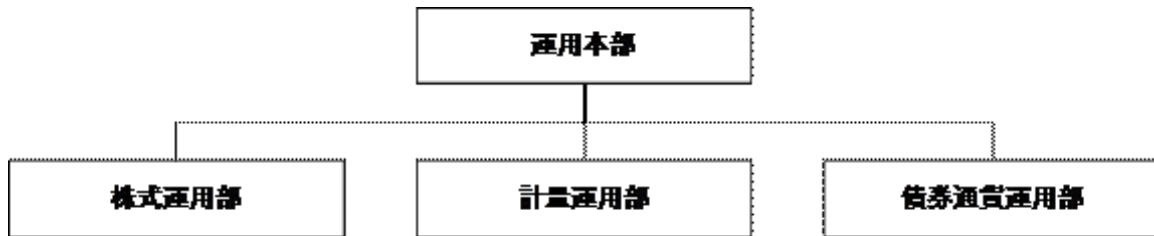
リスク検討委員会は、経営委員会の監督の下に、当社の一切の活動における法令遵守、内部統制、オペレーショナル・リスク、システム・リスク等のリスク、及び関連するレピュテーション上の問題を監視・監督し、当社の経営理念に沿った各種規定及び業務手順が整備されていることを確保するため、権限を行使することができます。また、リスク検討委員会は、適用法令、協会規則、投資信託約款、顧客との運用ガイドラインを遵守するとともに、善良なる管理者としての注意義務および忠実義務の観点から受託者としての責任を遵守するため（議決権行使に関する方針を含みます。）、必要な報告徴収、調査、検討、決定等を行うことができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

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



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

2012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	100	1,113,569,494,788
合計	100	1,113,569,494,788

[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17期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

(1) 貸借対照表

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24年3月31日現在)		
資産の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動資産							
現金・預金			5,260,116			3,285,446	
有価証券			11,996,812			11,797,976	
支払委託金			26			25	
収益分配金		26			25		
前払費用			12,310			468	
未収入金	* 1		-			406,284	
未収委託者報酬			1,179,339			1,064,467	
未収運用受託報酬			974,480			1,026,201	
未収収益	* 1		503,943			159,925	
立替金			84,372			34,566	
繰延税金資産			441,173			489,782	
流動資産計			20,452,575	87.7		18,265,146	90.9
固定資産							
無形固定資産			133,057			694	
ソフトウェア		132,362			-		
その他の無形固定資産		694			694		
投資その他の資産			2,748,369			1,830,583	
投資有価証券		1,087,459			684,540		
長期差入保証金		-			10,000		
繰延税金資産		1,636,928			1,135,876		
その他の投資等		23,981			166		
固定資産計			2,881,426	12.3		1,831,278	9.1
資産合計			23,334,002	100.0		20,096,424	100.0

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24年3月31日現在)		
負債の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
流動負債							
預り金			305			82	
未払金			500,286			853,668	
未払収益分配金		125			151		
未払償還金		72			72		
未払手数料		500,088			447,157		
その他未払金		-			406,287		
未払費用	* 1		2,176,374			1,998,271	
未払法人税等			629,052			190,726	
未払消費税等			32,752			30,533	
流動負債計			3,338,771	14.3		3,073,282	15.3
固定負債							
長期未払費用	* 1		3,631,711			2,945,495	
役員退職慰労引当金			875,845			222,911	
その他固定負債			650			650	
固定負債計			4,508,207	19.3		3,169,057	15.8
特別法上の準備金							
金融商品取引責任準備金			0			-	
特別法上の準備金計			0	0.0		-	0.0
負債合計			7,846,979	33.6		6,242,339	31.1

期別		第16期 (平成23年3月31日現在)			第17期 (平成24年3月31日現在)		
純資産の部							
科目	注記 番号	内訳	金額	構成比	内訳	金額	構成比
		千円	千円	%	千円	千円	%
株主資本							
資本金			490,000			490,000	
資本剰余金			390,000			390,000	
資本準備金		390,000			390,000		
利益剰余金			14,559,911			12,921,678	
その他利益剰余金		14,559,911			12,921,678		
繰越利益剰余金		14,559,911			12,921,678		
株主資本合計			15,439,911	66.2		13,801,678	68.7
評価・換算差額等							
その他有価証券評価差額金		47,111			52,406		
評価・換算差額等合計			47,111	0.2		52,406	0.3
純資産合計			15,487,022	66.4		13,854,085	68.9
負債・純資産合計			23,334,002	100.0		20,096,424	100.0

(2) 損益計算書

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

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

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

(3) 株主資本等変動計算書

第16期
（自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成22年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	15,600,864	15,600,864	16,480,864	42,747	42,747	16,523,611
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				2,500,000	2,500,000	2,500,000			2,500,000
当期純利益				1,459,046	1,459,046	1,459,046			1,459,046
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							4,364	4,364	4,364
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,040,953	1,040,953	1,040,953	4,364	4,364	1,036,588
平成23年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	14,559,911	14,559,911	15,439,911	47,111	47,111	15,487,022

第17期
（自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本						評価・換算差額等		純資産合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計				
平成23年4月1日残高	490,000	390,000	390,000	14,559,911	14,559,911	15,439,911	47,111	47,111	15,487,022
事業年度中の変動額									
剰余金の配当				3,000,000	3,000,000	3,000,000			3,000,000
当期純利益				1,361,767	1,361,767	1,361,767			1,361,767
株主資本以外の項目の事業年度中の変動額（純額）							5,294	5,294	5,294
事業年度中の変動額合計	-	-	-	1,638,232	1,638,232	1,638,232	5,294	5,294	1,632,937
平成24年3月31日残高	490,000	390,000	390,000	12,921,678	12,921,678	13,801,678	52,406	52,406	13,854,085

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	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。 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。
2. 固定資産の減価償却の方法	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。
3. 引当金の計上基準	(1) 役員退職慰労引当金 役員退職慰労金の支出に備えて、当社内規に基づく期末要支給見積額を計上しております。 (2) 貸倒引当金 貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。 (3) 金融商品取引責任準備金 金融商品取引事故による損失に備えるため、金融商品取引法第46条の5第1項に基づく責任準備金を計上しております。

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

表示方法の変更

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

注記事項

（貸借対照表関係）

第16期 （平成23年3月31日現在）	第17期 （平成24年3月31日現在）
<p>* 1 関係会社項目 関係会社に対する資産及び負債には次のものがあります。</p> <p>流動資産</p> <p>未収収益 138,806千円</p> <p>流動負債</p> <p>未払費用 40,141千円</p> <p>固定負債</p> <p>長期未払費用 116,408千円</p>	<p>* 1 関係会社項目 同左</p> <p>流動資産</p> <p>未収入金 404,033千円</p>

（損益計算書関係）

第16期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第17期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
<p>* 1 株式従業員報酬 役員及び従業員に付与されておりますが、ゴールドマン・サックス・グループ・インク株式に係る報酬に関するものであり、当該株式の株価及び付与された株数に基づき算出し配賦されております。</p> <p>* 2 関係会社項目 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。</p> <p>営業収益</p> <p>運用受託報酬 1,154,351千円</p> <p>その他営業収益 5,677,633千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 4,138,814千円</p> <p>株式従業員報酬 119,593千円</p> <p>営業外費用</p> <p>株式従業員報酬 124,855千円</p>	<p>* 1 株式従業員報酬 同左</p> <p>* 2 関係会社項目 同左</p> <p>営業収益</p> <p>その他営業収益 5,452,985千円</p> <p>営業費用</p> <p>委託調査費 4,318,795千円</p> <p>営業外収益</p> <p>株式従業員報酬 56,181千円</p>

（株主資本等変動計算書関係）

第16期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当 額（円）	基準日	効力発生日
平成22年9月27日 臨時株主総会	普通株式	2,500,000	390,625	平成22年9月30日	平成22年9月30日

第17期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1 発行済株式に関する事項

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

2 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり配当 額（円）	基準日	効力発生日
平成24年3月12日 臨時株主総会	普通株式	3,000,000	468,750	平成24年3月22日	平成24年3月22日

（リース取引関係）

第16期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第17期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
注記すべきリース取引を行っていないため、該当事項はありません。	同左

（金融商品に関する注記）

第16期
（自 平成22年4月1日
至 平成23年3月31日）

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

信用リスク

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

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

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

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

市場リスク

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

流動性および資金調達リスク

当社は総資産の70%以上が現金・預金及びコマーシャル・ペーパーであり、また現金・預金及びコマーシャル・ペーパーの残高は負債総額を超えており、当社において流動性リスク及び資金調達リスクは非常に低いものと考えております。また、当社は、資金運用を預金やコマーシャル・ペーパー等の短期金融商品に限定することで流動性リスクを管理しており、親会社との間で劣後条件付リボルビング・クレジット・ローン契約を締結することで、必要な場合の資金調達手段を確保し、資金調達リスクに備えております。

第16期
(自 平成22年4月1日
至 平成23年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成23年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	5,260,116	5,260,116	-
有価証券			
其他有価証券	11,996,812	11,996,812	-
未収委託者報酬	1,179,339	1,179,339	-
未収運用受託報酬	974,480	974,480	-

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	5,260,116	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券の うち満期があるもの	12,000,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,179,339	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	974,480	-	-	-	-	-

第17期
(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

(1) 金融商品の状況に関する事項

金融商品の内容及び金融商品に対する取組方針

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

金融商品に係るリスク及びその管理体制

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

信用リスク

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

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

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

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

市場リスク

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

第17期
(自 平成23年4月1日
至 平成24年3月31日)

(2) 金融商品の時価等に関する事項

平成24年3月31日現在における貸借対照表計上額、貸借対照表日における時価及びその差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
現金・預金	3,285,446	3,285,446	-
有価証券			
其他有価証券	11,797,976	11,797,976	-
未収委託者報酬	1,064,467	1,064,467	-
未収運用受託報酬	1,026,201	1,026,201	-

金融商品の時価の算定方法

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

金銭債権及び満期のある有価証券の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超
現金・預金	3,285,446	-	-	-	-	-
有価証券						
其他有価証券の うち満期があるもの	11,800,000	-	-	-	-	-
未収委託者報酬	1,064,467	-	-	-	-	-
未収運用受託報酬	1,026,201	-	-	-	-	-

（有価証券関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）					第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）				
1. その他有価証券で時価のあるもの					1. その他有価証券で時価のあるもの				
区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）	区分	種類	取得原価 （千円）	貸借対照 表計上額 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	1,008,026	1,087,459	79,432	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託受益証券	600,000	684,540	84,540
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	11,996,812	11,996,812	-	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	コマーシャル・ペーパー	11,797,976	11,797,976	-
2. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。					2. 当事業年度中に売却したその他有価証券				
					売却額（千円）			売却益の合計額 （千円）	
					1,095,821			77,795	
								-	

（デリバティブ取引関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。	同左

（退職給付関係）

第16期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第17期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）
1 採用している退職給付制度の概要 当社は、退職給付制度を採用しておりません。	1 採用している退職給付制度の概要 同左
2 退職給付費用に関する事項 損益計算書上、出向者負担金等に含まれる退職給付費用負担金相当額を、退職給付費用として計上しております。	2 退職給付費用に関する事項 同左

（税効果会計関係）

第16期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	第17期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）																																																				
<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">371,686千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">48,985</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">20,502</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">441,173</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">小計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">441,173</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,275,508</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">356,412</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">37,328</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,669,249</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">32,321</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">32,321</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,636,928千円</td> </tr> </table>	未払費用	371,686千円	未払事業税	48,985	その他	20,502	小計	441,173	小計	-	繰延税金資産の純額	441,173	長期未払費用	1,275,508	役員退職慰労引当金	356,412	その他	37,328	小計	1,669,249	その他有価証券評価差額金	32,321	小計	32,321	繰延税金資産の純額	1,636,928千円	<p>1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳</p> <p>繰延税金資産（流動資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">456,569千円</td> </tr> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">15,881</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">17,331</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">489,782</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（流動負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">小計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">489,782</td> </tr> </table> <p>繰延税金資産（固定資産）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">長期未払費用</td> <td style="text-align: right;">1,033,933</td> </tr> <tr> <td>役員退職慰労引当金</td> <td style="text-align: right;">81,558</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">52,518</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">1,168,010</td> </tr> </table> <p>繰延税金負債（固定負債）</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">その他有価証券評価差額金</td> <td style="text-align: right;">32,133</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">小計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">32,133</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">繰延税金資産の純額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,135,876千円</td> </tr> </table>	未払費用	456,569千円	未払事業税	15,881	その他	17,331	小計	489,782	小計	-	繰延税金資産の純額	489,782	長期未払費用	1,033,933	役員退職慰労引当金	81,558	その他	52,518	小計	1,168,010	その他有価証券評価差額金	32,133	小計	32,133	繰延税金資産の純額	1,135,876千円
未払費用	371,686千円																																																				
未払事業税	48,985																																																				
その他	20,502																																																				
小計	441,173																																																				
小計	-																																																				
繰延税金資産の純額	441,173																																																				
長期未払費用	1,275,508																																																				
役員退職慰労引当金	356,412																																																				
その他	37,328																																																				
小計	1,669,249																																																				
その他有価証券評価差額金	32,321																																																				
小計	32,321																																																				
繰延税金資産の純額	1,636,928千円																																																				
未払費用	456,569千円																																																				
未払事業税	15,881																																																				
その他	17,331																																																				
小計	489,782																																																				
小計	-																																																				
繰延税金資産の純額	489,782																																																				
長期未払費用	1,033,933																																																				
役員退職慰労引当金	81,558																																																				
その他	52,518																																																				
小計	1,168,010																																																				
その他有価証券評価差額金	32,133																																																				
小計	32,133																																																				
繰延税金資産の純額	1,135,876千円																																																				
<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。</p>	<p>2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">法定実効税率</td> <td style="text-align: right;">40.69 %</td> </tr> <tr> <td>（調整）</td> <td></td> </tr> <tr> <td>法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正</td> <td style="text-align: right;">6.24 %</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">- 0.42 %</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">税効果会計適用後の法人税等の負担率</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">46.51 %</td> </tr> </table>	法定実効税率	40.69 %	（調整）		法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	6.24 %	その他	- 0.42 %	税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.51 %																																										
法定実効税率	40.69 %																																																				
（調整）																																																					
法人税等の税率変更による繰延税金資産の修正	6.24 %																																																				
その他	- 0.42 %																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	46.51 %																																																				

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第16期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

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

[関連情報]

第16期（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

1. 製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	11,155,324	6,524,566	5,720,903	23,400,795

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

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

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

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

第17期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

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

[関連情報]

第17期（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスに関する情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	オフショア・ファンド 関連報酬等	合計
外部顧客からの収益	9,262,739	5,636,349	5,514,145	20,413,234

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

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

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

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者との取引）

第16期
（自 平成22年4月1日
至 平成23年3月31日）

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	ザ・ゴールド マン・サ ックス・ グループ・ インク	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク州	6,965 百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	株式従業 員報酬の 配賦	営業費用及び 一般管理費 （注1）	119,593	未払費用	40,141
							株式従業員報 酬（注1）	124,855	長期未払 費用	116,408
親会社	ゴールドマ ン・サック ス・アセッ ト・マネジ メント・エ ル・ピー	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク州	22 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	運用受託報酬 （注2）	1,154,351	未収収益	138,806
							その他営業収 益（注2）	5,677,633		
							委託調査費の 支払（注2）	4,138,814		

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第16期
(自平成22年4月1日
至平成23年3月31日)

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社 の子会社	ゴールドマン・サックス証券株式会社	東京都港区	83,616 百万円	金融商品取引業		業務委託 役員の兼任 有価証券 の購入	支払手数料 兼務従業員の 人件費等の支 払(注1) 受取利息	149,454 2,565,003 21,114	未払手数料 未払費用 有価証券 立替金	17,326 474,311 11,996,812 38
親会社 の子会社	ゴールドマン・サックス・ジャパ ン・ホール ディングス 有限会社	東京都港区	100 百万円	ゴールドマン・サックス・グループ人事・総務・施設管理業務受託		従業員出 向受入等 役員の兼任	出向者に関する人件費等の負担金(注2) 営業費用及び一般管理費 株式従業員報酬	7,056,607 11,019	未払費用 立替金 長期未払費用	862,578 43,759 3,791,077
親会社 の子会社	ゴールドマン・サックス・インベストメント・ストラテジー・LLC	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	41 百万ドル	投資顧問業		投資助言	運用受託報酬(注3)	1,617,993	未収収益	365,104
親会社 の子会社	ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・リミテッド	ケイマン 諸島	33 百万ドル	ゴールドマン・サックス・グループ人事業務受託		従業員出 向受入	出向者に関する人件費等の負担金(注2) 営業費用及び一般管理費 株式従業員報酬	434,078 63,231	未払費用 長期未払費用	495,731 43,158

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) ゴールドマン・サックス・ジャパン・ホールディングス有限会社(以下GSJH)または、ゴールドマン・サックス・グローバル・サービス・リミテッド(以下GS2L)より出向している役員及び従業員の給料、賞与、退職金等の支払はGSJH、GS2Lより行われております。
但し、これらの費用はGSJH、GS2Lより当社に請求されるものであり、賞与及び退職給付の引当額については、当社においてはGSJH、GS2Lに対する債務として処理しております。

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)

第17期
 （自 平成23年4月1日
 至 平成24年3月31日）

親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有（被所 有）割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 （千円）	科目	期末残高 （千円）
親会社	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	3,108 百万ドル	持株会社	被所有 直接 1% 間接 99%	株式従業員報酬の配賦	株式従業員報酬（注1）	56,181		
親会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー	アメリカ合衆国 ニューヨーク州	316 百万ドル	投資顧問業	被所有 直接 99%	投資助言	その他営業収益（注2） 委託調査費の支払（注2）	5,452,985 4,318,795	未収入金	393,727

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

第17期
(自平成23年4月1日
至平成24年3月31日)

兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金 又は出 資金	事業の内容 又は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事 者との関 係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社 の子会 社	ゴールド マン・サ ックス 証券株 式会社	東京都 港区	83,616 百万円	金融商品 取引業		業務委託 役員の兼 任 有価証券 の購入	兼務従業員の 人件費等の支 払(注1)	2,304,783	有価証券	11,797,976
親会社 の子会 社	ゴールド マン・サ ックス・ ジャパ ン・ホ ール ディン グス有 限会社	東京都 港区	100 百万円	ゴールド マン・サ ックス ・グル ープ人 事・総 務・施 設管 理業務 受託		従業員出 向受入等 役員の兼 任	出向者に関 する人件費 等の負担金 (注2) 営業費用 及び一般 管理費 株式従業 員報酬	5,339,280 171,617	未払費用 長期未払 費用	1,111,143 3,017,713
親会社 の子会 社	ゴールド マン・サ ックス ・バン ク・USA	アメリカ 合衆国 ユタ州	19,214 百万ドル	銀行業		現金の預 入			現金・預 金	360,145
親会社 の子会 社	ゴールド マン・サ ックス ・イン ベスト メント ・ストラ テジー ・LLC	アメリカ 合衆国 ニュー ヨーク 州	32 百万ドル	投資顧問 業		投資助言			未払費用	212,193

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー(未上場)

（1株当たり情報）

第16期 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）		第17期 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）	
1株当たり純資産額	2,419,847円31銭	1株当たり純資産額	2,164,700円82銭
1株当たり当期純利益金額	227,976円06銭	1株当たり当期純利益金額	212,776円18銭
損益計算書上の当期純利益	1,459,046千円	損益計算書上の当期純利益	1,361,767千円
1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	1,459,046千円	1株当たり当期純利益の算定に用いられた普通株式に係る当期純利益	1,361,767千円
差額	-	差額	-
期中平均株式数		期中平均株式数	
普通株式	6,400株	普通株式	6,400株
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権付社債等潜在株式がないため記載しておりません。		同左	

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

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「第三部 委託会社等の情報 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

(2011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（GSAM ニューヨーク）	316.8百万米ドル （24,629百万円、 1米ドル=77.74円）	GSAM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

(2012年4月1日現在)

名称	資本金の額	事業の内容
三井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

(2012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	
SMB C日興証券株式会社	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	7,495百万円	

(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

GSAM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24年10月23日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 涉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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24年3月17日から平成24年9月18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外国株式インデックス・プラスの平成24年9月18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24年5月29日

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第17期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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