

GSビッグデータ・ストラテジー
(エマージング株)

第14期末(2024年9月17日)		第14期	
基準価額	13,572円	騰落率	-4.2%
純資産総額	2,275百万円	分配金合計	0円

(注)騰落率は収益分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／海外／株式
信託期間	原則として無期限
運用方針	主としてエマージング諸国の株式を主要投資対象とし、計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時にポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行う投資信託証券への投資を通じ、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	
本ファンド	以下の指定投資信託証券を主要投資対象とします。 ・ルクセンブルク籍外国投資証券 ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. ①ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケットCOREエクイティ・ポートフォリオ ・アイルランド籍外国投資証券 ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー ②ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド
指定投資信託証券①	エマージング諸国の株式
指定投資信託証券②	米ドル建ての短期の市場性を有する金融市場証券
運用方法・組入制限	①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。 ②投資信託証券への投資は、高位に維持することを基本とします。 ③株式への直接投資は行いません。
分配方針	原則として毎計算期末(毎年3月15日および9月15日。休業日の場合は翌営業日。)に収益の分配を行います。投信会社が経費控除後の利子・配当等収益および売買損益(評価損益を含みます。)等の中から基準価額水準、市場動向等を勘案して分配金を決定します。

追加型投信／海外／株式

第14期(決算日2024年9月17日)

作成対象期間:2024年3月16日～2024年9月17日

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「GSビッグデータ・ストラテジー(エマージング株)」は、このたび、第14期の決算を行いました。本ファンドは、エマージング諸国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI(人工知能)を活用した独自開発の計量モデルを用いて多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。今期の運用経過等について、以下のとおりご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒105-5543 東京都港区虎ノ門2-6-1 虎ノ門ヒルズステーションタワー

お問合せ先: 03-4587-6000(代表)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時 | www.gsam.co.jp

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	税引 前金	期騰 落率	参考指標	期騰 落率	投資信託 証券比率	純資 産額
10期 (2022年9月15日)	11,959	0	7.6	12,236	15.8	98.6	2,390
11期 (2023年3月15日)	10,843	0	△ 9.3	11,291	△ 7.7	98.6	2,102
12期 (2023年9月15日)	12,676	0	16.9	13,305	17.8	99.4	2,387
13期 (2024年3月15日)	14,164	0	11.7	14,195	6.7	98.5	2,418
14期 (2024年9月17日)	13,572	0	△ 4.2	14,484	2.0	99.3	2,275

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 参考指標 (MSC I エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)) は、2017年12月12日を10,000として指数化しております。

■当期中の基準価額と市況推移

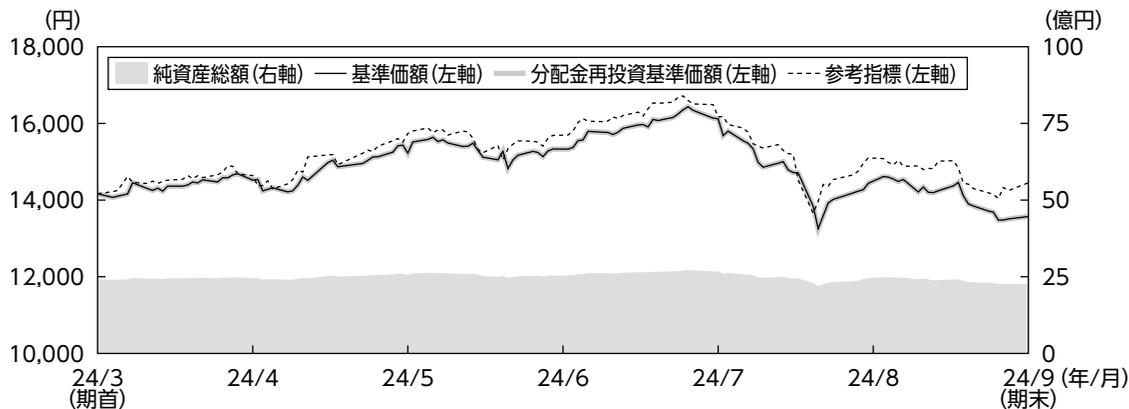
年月日	基準価額	騰落率	参考指標	騰落率	投資信託 証券比率
(期首) 2024年3月15日	14,164	—	14,195	—	98.5
3月末	14,363	1.4	14,553	2.5	98.6
4月末	14,976	5.7	15,211	7.2	98.7
5月末	15,119	6.7	15,269	7.6	98.9
6月末	15,872	12.1	16,242	14.4	99.5
7月末	14,786	4.4	15,248	7.4	99.2
8月末	14,243	0.6	15,049	6.0	99.2
(期末) 2024年9月17日	13,572	△ 4.2	14,484	2.0	99.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 参考指標 (MSC I エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)) は、2017年12月12日を10,000として指数化しております。

■運用経過

◆基準価額等の推移について（2024年3月16日～2024年9月17日）



第14期首：14,164円

第14期末：13,572円

（当期中にお支払いした分配金：0円）

騰落率：－4.2%（分配金再投資ベース）

(注1) 参考指標は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）であり、投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しています。

MSCIおよびMSCIの情報の編集、計算、および作成に関与するその他すべての者（以下総称して「MSCI当事者」といいます）は、MSCIの情報について一切の保証（独創性、正確性、完全性、商品性および特定目的への適合性を含みますが、これらに限定されません）を明示的に排除します。MSCI、その関連会社およびMSCI当事者は、いかなる場合においても、直接損害、間接損害、特別損害、付随的損害、懲罰損害、派生的損害（逸失利益を含みます）およびその他一切の損害についても責任を負いません。MSCIの書面による明示的な同意がない限り、MSCIの情報を配布または流布してはならないものとします。

(注2) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注3) 実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

(注4) 分配金再投資基準価額、参考指標は、期首の基準価額を起点として指数化しています。

(注5) 騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

◆基準価額の主な変動要因

本ファンドの基準価額は、期首の14,164円から592円下落し、期末には13,572円となりました。

上昇要因

銘柄選択における3つの投資テーマのうち「モメンタム」がプラス寄与となったことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

MSCIエマージング・マーケット・インデックス構成国における国別配分がマイナス寄与となったことが、基準価額の下落要因となりました。また、銘柄選択における3つの投資テーマのうち「バリュウ」および「収益率」がマイナス寄与となったことが、基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境について

<エマージング株式市場>

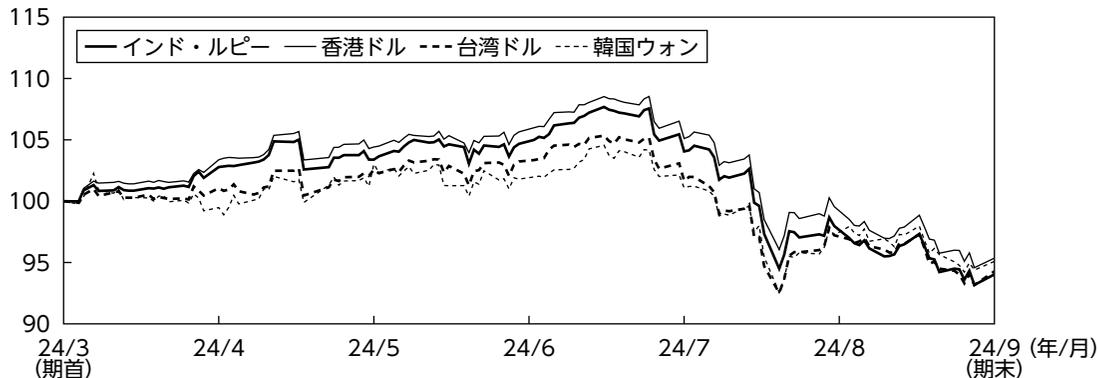
当期のエマージング株式市場は上昇しました。

3月後半は、米当局による2024年内の利下げ開始への期待から堅調に推移しました。4月は、前半は米景気の過熱感を嫌気し株式市場は世界的に調整したものの、エマージング株式市場は月末にかけて中国当局による景気刺激策への期待から上昇しました。5月は、主要半導体銘柄の好決算に牽引され上昇しましたが、下旬にかけて中国市場がそれまでの急速な上昇への反動から下落に転じ失速しました。6月は、中国市場が経済減速の懸念から調整を続けるなか、台湾および韓国の半導体関連銘柄が牽引して上昇しました。7月は、米国の大型ハイテク株が調整色を強めるなか軟調に推移しました。8月は、市場予想に反して7月末に実施された日銀の追加利上げによる為替相場の動揺や米景気後退懸念などが重なりエマージング株式市場は月初に急落したものの、その後は急速に値を戻す展開となりました。9月前半は、月初に発表された米国の経済指標が弱かったことが投資家心理の悪化を招き、エマージング株式市場は下落する一面もありました。

<外国為替市場>

外国為替市場では、台湾ドルやインド・ルピーなどを中心に、エマージング通貨は円に対して概ね下落しました。

○為替レート（対円）の推移



(注1) 為替レートはWM/ロイターレートを使用しています。

(注2) 各通貨は期首を100として指数化しています。

<短期金融市場>

当期において、米国T-Bill 1ヵ月は前期末の5.3%程度から4.9%程度まで低下して期末を迎えました。

◆ポートフォリオについて

＜本ファンド＞

本ファンドは、ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオおよびゴールドマン・サックスUS \$ リキッド・リザーブズ・ファンドを主要投資対象とし、期を通じてゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオを概ね高位に組入れることで、エマージング諸国の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行いました。

＜ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオ＞

エマージング諸国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・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、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざしました。

当運用では、最新のビッグデータや伝統的な市場・業績データ等をもとに、モメンタム（Momentum）・バリュー（Value）・収益性（Profitability）の投資テーマを通じた評価基準（MVPモデル）に基づき、投資魅力度を総合的に評価していますが、当期は「モメンタム」がプラス寄与となりましたが、「バリュー」と「収益性」はマイナス寄与となりました。

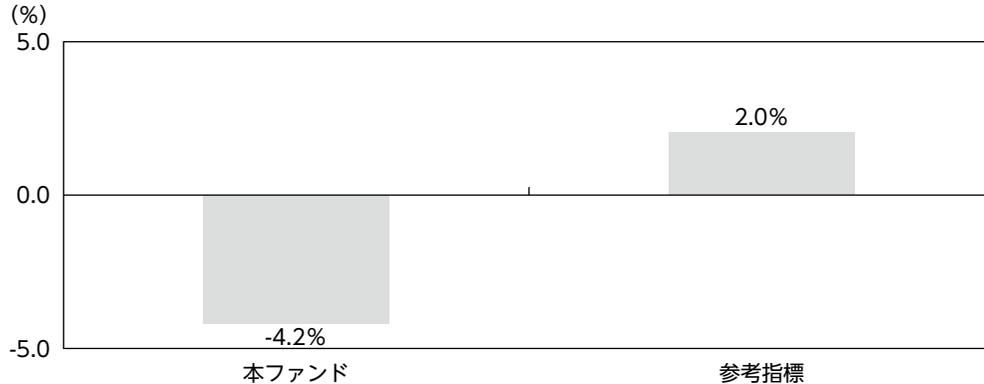
＜ゴールドマン・サックスUS \$ リキッド・リザーブズ・ファンド＞

主として米ドル建ての短期金融市場証券に分散投資することにより、元本と流動性を確保しつつ、米ドルベースでの最大限の収益を得ることを目標として運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

本ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、本ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。

<当期の基準価額と参考指標の対比（騰落率）>



(注1) 基準価額の騰落率は収益分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したものです。

(注2) 参考指標は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）であり、投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しています。

当期の本ファンドのパフォーマンス（分配金再投資ベース）は、-4.2%となった一方、参考指標のパフォーマンスは+2.0%となりました。

◆分配金について

収益分配金（1万口当たり、税引前）については、配分方針および基準価額の水準などを勘案し、当期の分配は行わないこととしました。収益分配金に充てなかった収益については、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

今後の運用方針について**<本ファンド>**

今後も引き続き、ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオおよびゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンドを主要投資対象とし、期を通じてゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオを高位に組入れ、エマージング諸国の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

<ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケッツCOREエクイティ・ポートフォリオ>

エマージング諸国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・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、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざします。

<ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド>

今後も主として米ドル建ての短期金融市場証券に分散投資することにより、元本と流動性を確保しつつ、米ドルベースでの最大限の収益を得ることを目標として運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2024年3月16日～2024年9月17日		
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	119円 (58)	0.799% (0.392)	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ファンドの運用、受託会社への指図、基準価額の算出、目論見書・運用報告書等の作成等の対価 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、分配金・換金代金・償還金の支払い業務等の対価 ファンドの財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(販売会社)	(58)	(0.392)	
(受託会社)	(2)	(0.014)	
その他費用 (保管費用)	8 (0)	0.051 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用
(監査費用)	(1)	(0.004)	
(その他)	(7)	(0.047)	
合計	127	0.850	

期中の平均基準価額は14,893円です。

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む。）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。但し、各項目の費用は、本ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

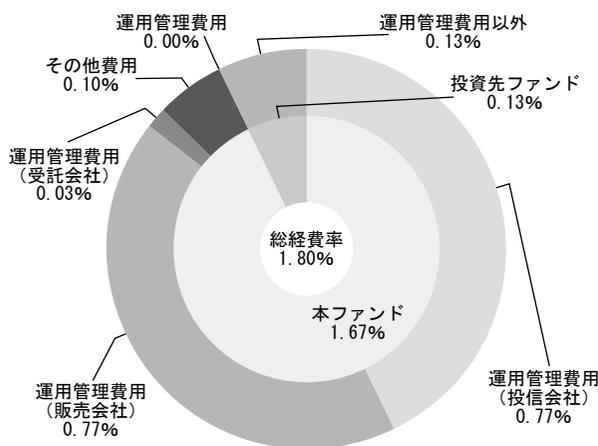
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.80%です。



総経費率 (①+②+③)	1.80%
①本ファンドの費用の比率	1.67%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.13%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、本ファンドが実質的に組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注5) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買及び取引の状況（2024年3月16日から2024年9月17日まで）

投資信託証券

銘柄名	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国	口	千米ドル	口	千米ドル
ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. -ゴールドマン・サックス・ エマージング・マーケットCOREエクイティ・ ポートフォリオ IOアキュムレーション・ スナップ・シェアクラス	32,599	400	57,307	700

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2024年3月16日から2024年9月17日まで）

利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

■組入資産の明細（2024年9月17日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末			比率
	口数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
オフショアファンド	口	千米ドル	千円	%
ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. -ゴールドマン・サックス・ エマージング・マーケットCOREエクイティ・ ポートフォリオ IOアキュムレーション・ スナップ・シェアクラス	1,275,752	15,615	2,198,152	96.6
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシー-ゴールドマン・ サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ ファンド X アキュムレーション・クラス	35	430	60,579	2.7
合計	1,275,788	16,045	2,258,732	<99.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率。

■投資信託財産の構成

2024年9月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 2,258,732	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	39,060	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,297,792	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（2,258,732千円）の投資信託財産総額（2,297,792千円）に対する比率は98.3%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。なお決算日における邦貨換算レートは1米ドル=140.77円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2024年9月17日
(A) 資 産	2,297,792,329円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	39,060,116
投 資 証 券 (評価額)	2,258,732,036
未 収 利 息	177
(B) 負 債	22,787,599
未 払 解 約 金	1,587,148
未 払 信 託 報 酬	19,929,232
そ の 他 未 払 費 用	1,271,219
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,275,004,730
元 本	1,676,258,562
次 期 繰 越 損 益 金	598,746,168
(D) 受 益 権 総 口 数	1,676,258,562口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,572円

■損益の状況

項 目	当 期
	自 2024年3月16日 至 2024年9月17日
(A) 配 当 等 収 益	14,313円
受 取 利 息	14,628
支 払 利 息	△ 315
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 84,723,711
売 買 損 益	43,009,275
売 買 損 益	△ 127,732,986
(C) 信 託 報 酬 等	△ 21,209,773
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A + B + C)	△ 105,919,171
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	538,983,312
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	165,682,027
(配 当 等 相 当 額)	(198,684,068)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 33,002,041)
(G) 計 (D + E + F)	598,746,168
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	598,746,168
追 加 信 託 差 損 益 金	165,682,027
(配 当 等 相 当 額)	(198,684,068)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 33,002,041)
分 配 準 備 積 立 金	538,995,630
繰 越 損 益 金	△ 105,931,489

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差引いた差額分をいいます。

(注4) 期首元本額は1,707,454,290円、当作成期間中において、追加設定元本額は131,994,843円、同解約元本額は163,190,571円です。

■分配原資の内訳

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

項 目	第 14 期
	2024年3月16日～2024年9月17日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,400

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税引前）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

〈ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. -ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケットCOREエクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラスの状況〉

ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. -ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケットCOREエクイティ・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）が投資対象とする外国投資信託証券です。2024年9月17日時点で入手可能な直近の状況をご報告申し上げます。なお、これらの内容は、当外国投資信託証券の全てのクラスを含んだ内容です。

■信託報酬等の費用内訳（2023年11月30日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
当座借越支払利息	8,494
有価証券貸付にかかる手数料	27,725
投資顧問報酬	15,867,890
保管費用	1,561,303
管理事務代行報酬	373,633
販売報酬およびサービシング報酬	10,968
名義書換事務代行報酬	246,091
年次税	431,663
専門家報酬	74,781
その他運用費用	945,026
	<u>19,547,574</u>
費用合計	<u>19,547,574</u>

■保有有価証券明細（2023年11月30日現在）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
公認の金融商品取引所に上場されている譲渡性有価証券			
普通株式-98.71%			
ブラジル			
102,000	Banco ABC Brasil SA-Preferred	454,091	0.02
2,542,800	Banco Bradesco SA ADR	8,391,240	0.36
1,174,501	Banco BTG Pactual SA	8,185,646	0.35
33,300	Banco do Estado do Rio Grande do Sul SA-Preferred	81,610	0.00
964,500	BB Seguridade Participacoes SA	6,149,670	0.26
245,800	Centrais Eletricas Brasileiras SA	2,010,808	0.09
390,300	Cia de Saneamento de Minas Gerais Copasa MG	1,445,072	0.06
132,900	Cia De Sanena Do Parana	689,634	0.03
8,300	Companhia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo SABESP ADR	112,797	0.00
489,800	Cyrela Brazil Realty SA Empreendimentos e Participacoes	2,098,186	0.09
28,375	Embraer SA ADR	478,686	0.02
834,700	Enauta Participacoes SA	2,642,435	0.11
789,800	Gerdau SA-Preferred	3,525,686	0.15
46,200	Iochpe Maxion SA	110,324	0.00
345,870	Itausa SA-Preferred	675,313	0.03
19,300	Mahle Metal Leve SA	123,057	0.01
4,159,400	Marcopolo SA-Preferred	5,079,990	0.22
114,600	Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	630,419	0.03
1,978,750	Petroleo Brasileiro SA ADR	30,393,600	1.30
2,378,500	Petroleo Brasileiro SA-Preferred	17,232,051	0.74

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
ブラジル			
412,700	Porto Seguro SA	2,314,581	0.10
930,000	Randon SA Implementos e Participacoes-Preferred	2,104,026	0.09
860,900	Telefonica Brasil SA	9,170,030	0.39
132,900	Telefonica Brasil SA ADR	1,410,069	0.06
537,600	TIM SA	1,865,226	0.08
983,400	Ultrapar Participacoes SA	4,929,698	0.21
484,500	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas-Preferred	767,389	0.03
69,600	WEG SA	476,335	0.02
1,263,800	YDUQS Participacoes SA	5,196,241	0.22
		118,743,910	5.07
ケイマン諸島			
2,750,300	Tencent Holdings Ltd.	114,391,943	4.88
チリ			
103,221,390	Banco de Chile	11,472,860	0.49
43,834	Banco de Credito e Inversiones SA	1,182,354	0.05
9,294,882	Colbun SA	1,488,013	0.06
58,850,194	Companhia Sud Americana de Vapores SA	3,376,567	0.15
1,716,134	Empresas CMPC SA	3,341,090	0.14
17,654	Quinenco SA	49,126	0.00
		20,910,010	0.89
中国			
4,463,567	Aier Eye Hospital Group Co. Ltd. Class A	10,631,757	0.45
7,128,500	Alibaba Group Holding Ltd.	65,827,699	2.81
722,000	AviChina Industry & Technology Co. Ltd. Class H	326,884	0.01
906,450	Baidu, Inc. Class A	13,363,224	0.57
40,727,366	Baoshan Iron & Steel Co. Ltd. Class A	35,406,602	1.51
861,600	Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co. Ltd. Class A	2,591,679	0.11
365,174	BYD Co. Ltd. Class A	10,147,866	0.43
207,500	BYD Co. Ltd. Class H	5,560,456	0.24
2,868,000	CGN Power Co. Ltd. Class H	689,840	0.03
7,432,000	China BlueChemical Ltd. Class H	1,720,173	0.07
13,389,000	China CITIC Bank Corp. Ltd. Class H	6,043,495	0.26
7,900,000	China Communications Services Corp. Ltd. Class H	3,368,158	0.14
30,994,000	China Construction Bank Corp. Class H	17,886,131	0.76
1,286,000	China International Marine Containers Group Co. Ltd. Class H	773,212	0.03
1,330,000	China Lesso Group Holdings Ltd.	734,419	0.03
6,863,600	China Pacific Insurance Group Co. Ltd. Class H	14,456,832	0.62
12,410,000	China Railway Group Ltd. Class H	5,442,104	0.23
9,058,000	CITIC Ltd.	8,512,772	0.36
2,797,554	COSCO SHIPPING Holdings Co. Ltd. Class A	3,914,844	0.17
6,412,000	CRRG Corp. Ltd. Class H	2,582,781	0.11
4,534,000	CSPC Pharmaceutical Group Ltd.	4,084,315	0.17
681,902	Dong-E-E-Jiao Co. Ltd. Class A	4,805,107	0.21
623,500	East Buy Holding Ltd.	2,314,116	0.10
95,900	Eastroc Beverage Group Co. Ltd. Class A	2,642,674	0.11
1,280,700	Foxconn Industrial Internet Co. Ltd. Class A	2,699,793	0.12
1,806,292	Gree Electric Appliances, Inc. Class A	8,316,265	0.36
173,500	Greentown China Holdings Ltd.	184,193	0.01
499,700	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd. Class A	2,106,180	0.09
548,000	Guangzhou Baiyunshan Pharmaceutical Holdings Co. Ltd. Class H	1,511,990	0.06

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
中国			
790,390	JD.com, Inc. Class A	10,741,274	0.46
1,932,000	Jiangsu Expressway Co. Ltd. Class H	1,737,343	0.07
8,488,406	Jointown Pharmaceutical Group Co. Ltd. Class A	8,917,166	0.38
1,612,000	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	2,232,469	0.10
1,494,800	Kingsoft Corp. Ltd.	4,770,284	0.20
2,784,400	Kuaishou Technology	20,460,629	0.87
130,000	Lenovo Group Ltd.	160,187	0.01
1,111,200	Li Auto, Inc. Class A	20,602,954	0.88
2,733,430	Meituan Class B	31,407,081	1.34
980,000	NetEase, Inc.	22,028,182	0.94
848,600	New China Life Insurance Co. Ltd. Class H	1,680,148	0.07
1,342,000	New Oriental Education & Technology Group, Inc.	10,831,961	0.46
286,800	Nongfu Spring Co. Ltd. Class H	1,635,479	0.07
24,304,000	People's Insurance Co. Group of China Ltd. Class H	7,863,260	0.34
8,906,000	PICC Property & Casualty Co. Ltd. Class H	10,327,471	0.44
4,209,000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Class H	19,206,135	0.82
161,000	Sany Heavy Equipment International Holdings Co. Ltd.	167,380	0.01
1,673,261	Shanghai International Port Group Co. Ltd. Class A	1,176,935	0.05
975,207	Shenzhen Transsion Holdings Co. Ltd. Class A	15,083,454	0.64
295,600	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2,954,863	0.13
263,200	Sinopharm Group Co. Ltd. Class H	652,149	0.03
5,863,000	Sinotruk Hong Kong Ltd.	12,147,448	0.52
1,280,200	Tencent Music Entertainment Group ADR	10,632,061	0.45
996,800	Tongcheng Travel Holdings Ltd.	1,831,762	0.08
2,480,000	Topsports International Holdings Ltd.	2,011,861	0.09
287,800	Trip.com Group Ltd.	10,151,634	0.43
74,400	Trip.com Group Ltd. ADR	2,629,668	0.11
54,000	Tsingtao Brewery Co. Ltd. Class H	356,118	0.02
1,531,300	Vipshop Holdings Ltd. ADR	25,189,885	1.08
648,297	Wanda Film Holding Co. Ltd. Class A	1,134,468	0.05
1,115,000	Weichai Power Co. Ltd. Class H	2,047,758	0.09
5,244,200	Xiaomi Corp. Class B	10,447,654	0.45
744,054	Yunnan Baiyao Group Co. Ltd. Class A	5,234,461	0.22
4,065,502	Yutong Bus Co. Ltd. Class A	7,649,090	0.33
395,300	Zhejiang Weixing New Building Materials Co. Ltd. Class A	826,520	0.04
		525,572,753	22.44
香港			
2,886,000	China Medical System Holdings Ltd.	5,545,661	0.24
495,500	China Overseas Land & Investment Ltd.	913,242	0.04
1,028,000	China Resources Land Ltd.	3,753,790	0.16
3,048,000	China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd.	2,756,939	0.12
1,534,000	Geely Automobile Holdings Ltd.	1,665,935	0.07
10,282,000	Shougang Fushan Resources Group Ltd.	3,708,795	0.16
13,208,000	Sino Biopharmaceutical Ltd.	6,478,085	0.27
1,050,000	United Laboratories International Holdings Ltd.	1,074,344	0.04
		25,896,791	1.10
インド			
184,732	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	1,831,864	0.08
71,816	Ajanta Pharma Ltd.	1,701,796	0.07
255,317	APL Apollo Tubes Ltd.	5,170,102	0.22

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
インド			
124,835	Arvind Ltd.	338,665	0.01
979,554	Axis Bank Ltd.	12,630,030	0.54
32,096	Balkrishna Industries Ltd.	991,936	0.04
55,139	Bank of Baroda	130,280	0.01
2,034,307	Bharat Petroleum Corp. Ltd.	10,628,465	0.45
133,562	Birlasoft Ltd.	1,010,843	0.04
2,581,918	Canara Bank	12,485,409	0.53
202,393	Ceat Ltd.	5,096,366	0.22
256,134	Cipla Ltd.	3,724,802	0.16
538,720	Cummins India Ltd.	12,341,213	0.53
315,731	Dr Reddy's Laboratories Ltd. ADR	21,895,945	0.94
471,196	Electrosteel Castings Ltd.	665,801	0.03
263,028	Equitas Small Finance Bank Ltd.	296,165	0.01
113,768	Fortis Healthcare Ltd.	526,803	0.02
398,052	Godawari Power and Ispat Ltd.	3,280,765	0.14
252,438	Great Eastern Shipping Co. Ltd.	2,652,281	0.11
146,914	Hindustan Zinc Ltd.	526,900	0.02
1,111,741	ICICI Bank Ltd. ADR	24,825,177	1.06
1,897,806	IDFC Ltd.	2,697,706	0.12
184,372	IndiaMart InterMesh Ltd.	5,762,449	0.25
716,325	Indian Bank	3,410,888	0.15
7,171,535	Indian Oil Corp. Ltd.	9,610,061	0.41
107,360	ITD Cementation India Ltd.	347,659	0.02
1,510,551	Jamna Auto Industries Ltd.	2,030,710	0.09
562,137	Jindal Saw Ltd.	3,132,844	0.13
195,387	Jindal Stainless Ltd.	1,174,819	0.05
78,931	Jindal Steel & Power Ltd.	635,720	0.03
8,456	JK Cement Ltd.	369,368	0.02
411,183	JK Paper Ltd.	1,808,059	0.08
670,343	JM Financial Ltd.	675,320	0.03
2,025,079	JSW Steel Ltd.	19,471,341	0.83
87,579	Karnataka Bank Ltd.	230,070	0.01
88,973	Karur Vysya Bank Ltd.	164,996	0.01
433,176	KNR Constructions Ltd.	1,515,867	0.07
77,138	LIC Housing Finance Ltd.	454,629	0.02
403,926	Lupin Ltd.	6,204,577	0.27
74,722	Marico Ltd.	482,917	0.02
4,919	MRF Ltd.	6,588,577	0.28
180,348	Narayana Hrudayalaya Ltd.	2,650,140	0.11
2,273,396	NCC Ltd.	4,540,699	0.19
12,224	Nestle India Ltd.	3,552,634	0.15
4,328,413	NMDC Ltd.	9,426,219	0.40
2,403,370	Oil & Natural Gas Corp. Ltd.	5,622,590	0.24
1,086,532	Petronet LNG Ltd.	2,645,048	0.11
4,024,120	Power Finance Corp. Ltd.	16,171,519	0.69
133,874	Power Grid Corp. of India Ltd.	335,622	0.01
126,593	PTC India Ltd.	249,039	0.01
119,463	Ramkrishna Forgings Ltd.	1,146,898	0.05
4,555,844	REC Ltd.	19,054,768	0.81
561,367	Reliance Industries Ltd.	16,007,814	0.68

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
インド			
73,389	SBI Life Insurance Co. Ltd.	1,264,327	0.05
10,302	Shree Cement Ltd.	3,304,809	0.14
6,105	Siemens Ltd.	267,918	0.01
5,343,808	State Bank of India	36,221,211	1.55
239,058	Steel Authority of India Ltd.	264,791	0.01
400,898	Tata Consultancy Services Ltd.	16,785,574	0.72
45,521	Tata Elxsi Ltd.	4,506,397	0.19
686,264	Tata Motors Ltd. Class A	3,933,941	0.17
226,146	Torrent Pharmaceuticals Ltd.	5,768,600	0.25
332,903	UltraTech Cement Ltd.	35,942,047	1.53
1,432,468	Varun Beverages Ltd.	19,004,908	0.81
364,502	Welspun Corp. Ltd.	2,320,241	0.10
721,088	Zydu Lifesciences Ltd.	5,516,127	0.24
		406,024,066	17.34
インドネシア			
26,774,100	Aneka Tambang Tbk	3,003,007	0.13
48,726,600	Bank Central Asia Tbk PT	28,189,512	1.20
66,649,200	Bank Mandiri Persero Tbk PT	25,130,461	1.07
12,067,400	Bank Pembangunan Daerah Jawa Barat Dan Banten Tbk PT	871,405	0.04
38,700,300	Bank Pembangunan Daerah Jawa Timur Tbk PT	1,547,014	0.07
44,058,200	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	14,981,381	0.64
1,233,600	Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT	811,265	0.03
		74,534,045	3.18
クウェート			
2,329,665	Kuwait Finance House KSCP	5,269,763	0.22
780,460	National Bank of Kuwait SAKP	2,235,660	0.10
		7,505,423	0.32
ルクセンブルク			
28,368	Reinet Investments SCA	663,293	0.03
84,738	Ternium SA ADR	3,389,520	0.14
		4,052,813	0.17
メキシコ			
2,038,928	Arca Continental SAB de CV	20,107,061	0.86
327,757	Coca-Cola Femsa SAB de CV ADR	27,210,386	1.16
968,217	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	8,827,298	0.38
461,271	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV Class A	900,202	0.04
30,600	Promotora y Operadora de Infraestructura SAB de CV	296,556	0.01
		57,341,503	2.45
オランダ			
379,418	NEPI Rockcastle NV	2,329,782	0.10
ペルー			
29,400	Credicorp Ltd.	3,670,590	0.16
フィリピン			
52,860	Ayala Corp.	632,370	0.03
696,281	Bank of the Philippine Islands	1,296,194	0.05
1,196,980	BDO Unibank, Inc.	2,879,741	0.12
25,370	GT Capital Holdings, Inc.	248,031	0.01
2,331,350	International Container Terminal Services, Inc.	9,062,116	0.39
435,690	Jollibee Foods Corp.	1,778,567	0.08
95,270	Manila Electric Co.	618,079	0.03

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
フィリピン			
4,248,880	Metropolitan Bank & Trust Co.	3,824,681	0.16
		20,339,779	0.87
ポーランド			
109,518	Bank Polska Kasa Opieki SA	3,861,743	0.16
7,383	Budimex SA	1,013,232	0.04
2,936,382	Powszechny Zaklad Ubezpiezen SA	33,849,229	1.45
		38,724,204	1.65
カタール			
2,202,995	Gulf International Services QSC	1,658,525	0.07
187,814	Qatar Electricity & Water Co. QSC	871,096	0.04
2,363,235	Qatar Gas Transport Co. Ltd.	2,103,871	0.09
1,256,192	Qatar National Bank QPSC	5,416,703	0.23
		10,050,195	0.43
ロシア			
151,935	PhosAgro PJSC GDR	0	0.00
16,268	Polyus PJSC GDR	0	0.00
4,556,680	Sberbank of Russia PJSC	0	0.00
1,136,300,000	VTB Bank PJSC	0	0.00
		0	0.00
サウジアラビア			
286,089	Abdullah Al Othaim Markets Co.	961,366	0.04
294,723	Al Hammadi Holding	4,477,998	0.19
224,606	Aldrees Petroleum and Transport Services Co.	7,735,231	0.33
298,561	Alinma Bank	2,846,892	0.12
765,149	Arab National Bank	4,894,119	0.21
69,676	Arabian Centres Co. Ltd.	368,633	0.02
95,785	Banque Saudi Fransi	954,914	0.04
283,490	Bawan Co.	3,017,845	0.13
57,076	Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	3,032,967	0.13
73,683	Dr Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co.	5,538,746	0.24
33,706	Mouwasat Medical Services Co.	1,011,674	0.04
28,867	National Gas & Industrialization Co.	447,669	0.02
1,590	National Medical Care Co.	60,099	0.00
1,485,743	Riyad Bank	10,571,067	0.45
2,665,670	Saudi Arabian Oil Co.	23,585,226	1.01
907,532	Saudi Awwal Bank	8,411,142	0.36
95,024	Saudi Cement Co.	1,337,403	0.06
382,208	Saudi Chemical Co. Holding	419,612	0.02
237,816	Saudi Industrial Services Co.	1,755,965	0.07
31,851	Saudi Investment Bank	127,350	0.01
156,785	Saudi National Bank	1,460,065	0.06
5,683	Saudi Tadawul Group Holding Co.	277,111	0.01
		83,293,094	3.56
南アフリカ			
149,078	Bidvest Group Ltd.	1,872,466	0.08
6,341,416	FirstRand Ltd.	22,738,968	0.97
14,518	Gold Fields Ltd. ADR	217,335	0.01
555,985	Investec Ltd.	3,544,942	0.15
38,926	Kumba Iron Ore Ltd.	1,220,391	0.05
43,625	Nedbank Group Ltd.	496,816	0.02

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
南アフリカ			
1,752,413	Old Mutual Ltd.	1,070,487	0.05
3,030,977	Sanlam Ltd.	10,934,220	0.47
		42,095,625	1.80
韓国			
5,682	Cheil Worldwide, Inc.	85,994	0.00
249,021	DB Insurance Co. Ltd.	16,100,052	0.69
45,435	DGB Financial Group, Inc.	298,784	0.01
27,469	Douzone Bizon Co. Ltd.	624,463	0.03
5,138	Ecopro Co. Ltd.	2,947,535	0.13
266,986	GS Holdings Corp.	8,516,331	0.36
20,540	HAESUNG DS Co. Ltd.	910,624	0.04
455,753	Hana Financial Group, Inc.	14,669,363	0.63
92,674	Hankook Tire & Technology Co. Ltd.	3,245,051	0.14
243,340	Hanmi Semiconductor Co. Ltd.	11,910,267	0.51
90,141	HD Hyundai Construction Equipment Co. Ltd.	3,380,393	0.15
10,341	Hyosung TNC Corp.	3,047,519	0.13
94,327	Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd.	2,271,866	0.10
208,571	Hyundai Steel Co.	5,665,585	0.24
565,392	JB Financial Group Co. Ltd.	4,538,211	0.19
800,428	KB Financial Group, Inc.	32,354,690	1.38
640,248	Kia Corp.	42,479,411	1.81
43,237	Korea Investment Holdings Co. Ltd.	2,000,605	0.09
98,251	Korean Reinsurance Co.	588,676	0.03
73,595	KT Corp.	1,910,333	0.08
7,447	Kyung Dong Navien Co. Ltd.	263,078	0.01
280,437	Meritz Financial Group, Inc.	12,026,850	0.51
5,361	NAVER Corp.	859,968	0.04
34,653	POSCO Holdings, Inc.	12,876,465	0.55
170,629	Samsung C&T Corp.	15,730,470	0.67
1,472,895	Samsung Electronics Co. Ltd.	82,987,517	3.54
261,352	Samsung Electronics Co. Ltd.-Preferred	11,714,765	0.50
41,940	Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd.	8,426,464	0.36
8,966	Samsung Securities Co. Ltd.	271,697	0.01
130,018	Seoul Semiconductor Co. Ltd.	996,931	0.04
601,155	Shinhan Financial Group Co. Ltd.	17,136,695	0.73
25,737	Systems Technology, Inc.	670,823	0.03
		321,507,476	13.73
台湾			
21,000	Accton Technology Corp.	357,232	0.02
805,643	Advantech Co. Ltd.	9,115,175	0.39
58,000	AP Memory Technology Corp.	867,483	0.04
580,000	Ardentec Corp.	1,305,176	0.06
6,011,000	ASE Technology Holding Co. Ltd.	24,614,899	1.05
1,563,000	Brighton-Best International Taiwan, Inc.	1,737,381	0.07
1,772,000	Catcher Technology Co. Ltd.	11,031,123	0.47
1,790,000	Chicony Electronics Co. Ltd.	9,140,263	0.39
276,000	China Motor Corp.	896,469	0.04
1,009,000	Chipbond Technology Corp.	2,326,099	0.10
11,851,000	Compal Electronics, Inc.	11,734,433	0.50
26,000	Eclat Textile Co. Ltd.	494,067	0.02

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
台湾			
351,000	Elitegroup Computer Systems Co. Ltd.	325,243	0.01
337,000	Everlight Electronics Co. Ltd.	504,100	0.02
29,000	Faraday Technology Corp.	357,329	0.02
3,489,000	Getac Holdings Corp.	11,368,830	0.49
813,000	Gigabyte Technology Co. Ltd.	6,501,547	0.28
47,000	Global Mixed Mode Technology, Inc.	402,453	0.02
52,873	Innodisk Corp.	527,555	0.02
1,164,000	ITE Technology, Inc.	5,832,735	0.25
10,000	Jentech Precision Industrial Co. Ltd.	207,174	0.01
4,445,000	King Yuan Electronics Co. Ltd.	11,794,131	0.50
6,934,000	Lite-On Technology Corp.	24,415,737	1.04
134,000	Materials Analysis Technology, Inc.	1,023,013	0.04
1,104,000	MediaTek, Inc.	33,345,720	1.42
228,000	Micro-Star International Co. Ltd.	1,339,454	0.06
1,091,000	Novatek Microelectronics Corp.	17,831,484	0.76
1,894,000	Pegatron Corp.	4,922,157	0.21
1,396,000	Primax Electronics Ltd.	2,881,119	0.12
3,309,000	Quanta Computer, Inc.	21,491,372	0.92
263,000	Radiant Opto-Electronics Corp.	1,111,886	0.05
33,300	Silicon Motion Technology Corp. ADR	1,966,032	0.08
89,000	Sino-American Silicon Products, Inc.	520,279	0.02
2,752,000	Supreme Electronics Co. Ltd.	4,922,344	0.21
174,000	Synnex Technology International Corp.	383,053	0.02
6,268,000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	115,343,598	4.93
1,007,000	Taiwan Surface Mounting Technology Corp.	3,134,225	0.13
1,574,000	Ton Yi Industrial Corp.	808,983	0.03
1,179,000	Tung Ho Steel Enterprise Corp.	2,617,943	0.11
3,702,000	Wistron Corp.	10,809,746	0.46
1,397,000	WPG Holdings Ltd.	3,472,046	0.15
		363,781,088	15.53
タイ			
97,000	Advanced Info Service PCL	601,032	0.03
3,691,400	Bumrungrad Hospital PCL	23,395,707	1.00
190,800	Intouch Holdings PCL Class F	378,231	0.02
5,334,800	Krung Thai Bank PCL	2,759,599	0.12
125,800	PTT Exploration & Production PCL	541,645	0.02
9,093,700	PTT PCL	8,980,659	0.38
168,700	Thanachart Capital PCL	230,168	0.01
11,554,500	TMBThanachart Bank PCL	505,732	0.02
		37,392,773	1.60
トルコ			
477,310	Enerjisa Enerji AS	790,541	0.03
80,378	KOC Holding AS	389,629	0.02
82,236	Migros Ticaret AS	1,027,932	0.05
1,303,160	Turk Hava Yollari AO	11,311,016	0.48
		13,519,118	0.58
アラブ首長国連邦			
137,718	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	314,608	0.01
399,416	Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	1,108,306	0.05
5,647,536	Air Arabia PJSC	4,136,938	0.17

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
アラブ首長国連邦			
576,948	Dubai Islamic Bank PJSC	867,249	0.04
2,583,473	Emirates NBD Bank PJSC	12,381,816	0.53
		18,808,917	0.80
英国			
78,096	Anglogold Ashanti PLC	1,514,400	0.06
普通株式合計（取得原価 米ドル 2,311,054,411）		2,312,000,298	98.71
不動産投資信託－0.02%			
メキシコ			
245,800	Fibra Uno Administracion SA de CV	384,038	0.02
不動産投資信託合計（取得原価 米ドル 387,453）		384,038	0.02
公認の金融商品取引所に上場されている譲渡性有価証券合計（取得原価 米ドル 2,311,441,864）		2,312,384,336	98.73
その他譲渡性有価証券			
普通株式－0.00%			
ロシア			
979	PhosAgro PJSC	0	0.00
普通株式合計（取得原価 米ドル 22,150）		0	0.00
その他譲渡性有価証券合計（取得原価 米ドル 22,150）		0	0.00
デリバティブ取引を除く評価額（取得原価 米ドル 2,311,464,014）		2,312,384,336	98.73

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

外国為替予約取引－0.00%

通貨	元本(買)	通貨	元本(売)	償還年月日／満期日	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合(%)
EUR	244,000	USD	267,991	04/12/2023	(1,812)	(0.00)
外国為替予約取引未実現損失					(1,812)	(0.00)

特定クラス投資信託証券の外国為替予約取引－0.00%

通貨	元本(買)	通貨	元本(売)	償還年月日／満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
CHF	32,810	USD	37,175	20/12/2023	370	0.00
EUR	1,168,673	USD	1,258,573	20/12/2023	17,240	0.00
PLN	408,478	USD	95,791	20/12/2023	6,459	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益					24,069	0.00

通貨	元本(買)	通貨	元本(売)	償還年月日／満期日	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合(%)
USD	225,238	EUR	211,481	20/12/2023	(5,631)	(0.00)
USD	6,702	PLN	29,189	20/12/2023	(604)	(0.00)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失					(6,235)	(0.00)

投資評価額（取得原価 米ドル 2,311,464,014）	2,312,400,358	98.73
その他資産・負債	29,722,524	1.27
投資主資本	2,342,122,882	100.00

投資合計	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
デリバティブ取引を除く投資合計（取得原価 米ドル 2,311,464,014）	2,312,384,336	98.73
外国為替予約取引未実現損失	(1,812)	(0.00)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益	24,069	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失	(6,235)	(0.00)
その他資産・負債	29,722,524	1.27
投資主資本	2,342,122,882	100.00

〈ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー—ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド X アキュムレーション・クラスの状況〉

ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー—ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド（アイルランド籍）は、GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）が投資対象とする外国投資信託証券です。2024年9月17日時点で入手可能な直近の状況をご報告申し上げます。なお、これらの内容は、当外国投資信託証券の全てのクラスを含んだ内容です。

■信託報酬等の費用内訳（2023年12月31日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
投資顧問報酬	79,458,622
管理事務代行報酬	1,331,844
保管費用	1,795,618
販売報酬	2,811,628
名義書換事務代行報酬	894,982
専門家報酬	57,139
その他費用	4,936,236
費用合計	91,286,069
投資顧問報酬調整額	(8,856,966)
運用費用合計	82,429,103

■保有有価証券明細（2023年12月31日現在）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券				
	社債				
28,000,000	Banco Santander SA	5.807%	30/06/2024	28,000,765	0.07
43,052,000	Santander UK Plc	5.963%	13/03/2024	42,900,728	0.11
28,713,000	UBS AG/London	5.779%	09/02/2024	28,716,201	0.08
社債合計				99,617,694	0.26
	国債				
18,020,000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	4.940%	25/10/2024	17,307,344	0.05
18,020,000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	4.935%	31/10/2024	17,293,138	0.05
368,745,000	Federal Home Loan Banks	5.340%	23/04/2024	368,663,116	0.96
212,400,000	Federal Home Loan Banks	5.540%	24/04/2024	212,223,264	0.56
211,240,000	Federal Home Loan Banks	5.330%	26/04/2024	211,124,819	0.55
451,420,000	Federal Home Loan Banks	5.300%	17/05/2024	451,322,259	1.18
660,820,000	Federal Home Loan Banks	5.350%	20/05/2024	660,269,378	1.73
216,280,000	Federal Home Loan Banks	5.370%	21/05/2024	216,274,005	0.57
216,935,000	Federal Home Loan Banks	5.300%	22/05/2024	216,798,858	0.57
84,010,000	Federal Home Loan Banks	5.360%	11/06/2024	83,907,176	0.22
52,510,000	Federal Home Loan Banks	5.375%	11/06/2024	52,463,713	0.14
119,400,000	Federal Home Loan Banks	5.490%	15/07/2024	119,358,855	0.31
119,830,000	Federal Home Loan Banks	5.520%	15/07/2024	119,790,174	0.31
53,893,000	Federal Home Loan Mortgage Corp	5.400%	11/06/2024	53,825,932	0.14
53,893,000	Federal Home Loan Mortgage Corp	5.380%	12/06/2024	53,827,587	0.14
94,678,500	United States Treasury Bill	5.280%	02/01/2024	94,651,786	0.25
699,120,500	United States Treasury Bill	5.285%	09/01/2024	698,336,604	1.83
795,492,300	United States Treasury Bill	5.278%	25/01/2024	792,644,334	2.08

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	国債				
1,044,806,600	United States Treasury Bill	5.270%	01/02/2024	1,040,130,432	2.72
144,744,300	United States Treasury Bill	5.316%	13/02/2024	143,852,928	0.38
59,011,500	United States Treasury Bill	5.270%	20/02/2024	58,607,042	0.15
56,275,100	United States Treasury Bill	5.326%	27/02/2024	55,807,192	0.15
3,391,000	United States Treasury Bill	5.290%	21/03/2024	3,352,366	0.01
13,295,900	United States Treasury Bill	5.225%	02/04/2024	13,120,839	0.03
122,404,100	United States Treasury Bill	5.340%	04/04/2024	120,759,805	0.32
12,051,000	United States Treasury Bill	5.237%	09/04/2024	11,880,543	0.03
1,564,300	United States Treasury Bill	5.215%	16/04/2024	1,540,537	0.00
18,901,200	United States Treasury Bill	5.212%	23/04/2024	18,595,519	0.05
13,508,800	United States Treasury Bill	5.157%	30/04/2024	13,276,048	0.03
33,845,500	United States Treasury Bill	5.337%	02/05/2024	33,258,819	0.09
38,720,600	United States Treasury Bill	5.254%	09/05/2024	38,013,212	0.10
43,554,100	United States Treasury Bill	5.270%	16/05/2024	42,719,005	0.11
441,195,700	United States Treasury Bill	5.231%	23/05/2024	432,320,603	1.13
181,265,800	United States Treasury Bill	5.080%	27/06/2024	176,771,063	0.46
540,180,000	United States Treasury Bill	4.595%	26/12/2024	515,744,601	1.35
10,899,200	United States Treasury Floating Rate Note	5.355%	31/07/2024	10,892,400	0.03
31,878,200	United States Treasury Note/Bond	5.115%	31/08/2024	31,225,693	0.08
35,719,200	United States Treasury Note/Bond	5.314%	31/08/2024	35,296,430	0.09
18,060,100	United States Treasury Note/Bond	4.983%	15/11/2024	17,428,702	0.05
68,946,700	United States Treasury Note/Bond	5.023%	15/11/2024	67,403,479	0.18
24,514,400	United States Treasury Note/Bond	4.847%	30/11/2024	23,917,819	0.06
21,095,300	United States Treasury Note/Bond	4.913%	15/12/2024	20,342,956	0.05
84,118,400	United States Treasury Note/Bond	4.913%	31/12/2024	81,638,834	0.21
7,031,700	United States Treasury Note/Bond	4.929%	31/12/2024	6,858,483	0.02
258,009,100	United States Treasury Note/Bond	5.045%	31/12/2024	256,641,814	0.67
国債合計				7,711,479,506	20.19
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券合計				7,811,097,200	20.45
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている以外の譲渡性有価証券					
譲渡性預金証書					
149,536,000	Banco Santander SA	5.590%	19/01/2024	149,559,651	0.39
202,208,000	Banco Santander SA	5.880%	05/03/2024	202,336,997	0.53
99,592,000	Banco Santander SA	5.750%	27/11/2024	100,056,461	0.26
219,545,000	Bank of America NA	5.740%	09/02/2024	219,585,879	0.57
80,822,000	Bank of America NA	5.850%	28/02/2024	80,862,127	0.21
148,166,000	Bank of America NA	5.820%	25/03/2024	148,282,264	0.39
12,375,000	Bank of America NA	5.906%	12/04/2024	12,390,065	0.03
103,056,000	Bank of America NA	5.860%	29/07/2024	103,152,550	0.27
164,751,000	BNP Paribas	5.750%	27/11/2024	165,485,934	0.43
92,200,000	Citibank NA	5.630%	01/03/2024	92,197,947	0.24
262,900,000	Citibank NA	5.780%	07/03/2024	262,969,261	0.69
4,700,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.739%	01/07/2024	4,704,896	0.01
322,963,000	Credit Agricole CIB	5.800%	28/03/2024	323,172,551	0.85
166,482,000	Credit Agricole CIB	5.800%	09/04/2024	166,621,893	0.44
94,000,000	FUJIFILM Holdings Corp	5.589%	04/01/2024	93,941,346	0.25
105,100,000	HSBC Bank Plc	5.530%	05/03/2024	105,112,273	0.28
34,333,000	Korea Development Bank	5.800%	30/01/2024	34,337,702	0.09
8,586,000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc	5.880%	20/02/2024	8,589,391	0.02
113,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.642%	12/01/2024	112,783,237	0.30
96,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.642%	05/01/2024	95,924,038	0.25

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	譲渡性預金証書				
30,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.676%	24/01/2024	29,887,213	0.08
312,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.591%	27/02/2024	309,224,523	0.81
290,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.497%	04/03/2024	287,335,147	0.75
157,790,000	Mizuho Bank Ltd	5.730%	15/05/2024	157,905,816	0.41
85,362,000	MUFG Bank Ltd	5.500%	28/03/2024	85,362,000	0.22
163,000,000	MUFG Bank Ltd	5.750%	14/05/2024	163,113,997	0.43
75,201,000	MUFG Bank Ltd	5.430%	15/07/2024	75,207,936	0.20
89,777,000	MUFG Bank Ltd	5.410%	17/07/2024	89,777,000	0.24
6,592,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	5.870%	09/01/2024	6,592,391	0.02
119,465,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.910%	28/02/2024	119,537,718	0.31
161,195,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.510%	15/03/2024	161,200,906	0.42
44,166,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.870%	09/05/2024	44,208,416	0.12
194,138,000	Wells Fargo Bank NA	5.890%	05/08/2024	194,338,791	0.51
12,204,000	Wells Fargo Bank NA	6.000%	06/11/2024	12,221,141	0.03
譲渡性預金証書合計				4,217,979,458	11.05
	コマーシャル・ペーパー				
32,126,000	Albion Capital LLC	5.350%	02/01/2024	32,116,451	0.08
56,908,000	Albion Capital LLC	5.600%	22/01/2024	56,713,524	0.15
62,221,000	Albion Capital LLC	5.647%	05/02/2024	61,880,068	0.16
20,780,000	Albion Capital LLC	5.600%	21/02/2024	20,615,695	0.05
107,769,000	Antalis	5.680%	01/02/2024	107,239,518	0.28
49,012,000	Antalis	5.680%	02/02/2024	48,760,293	0.13
32,233,000	Atlantic Asset Securitisation LLC	5.603%	30/01/2024	32,084,408	0.08
61,900,000	Banco Santander SA	5.740%	01/04/2024	61,020,551	0.16
197,179,000	Bank of Montreal	5.920%	14/02/2024	197,258,242	0.52
2,721,000	Bank of Nova Scotia	5.781%	13/02/2024	2,721,660	0.01
17,590,000	Bank of Nova Scotia	5.621%	21/02/2024	17,593,790	0.05
45,151,000	Bank of Nova Scotia	5.870%	25/07/2024	45,190,084	0.12
32,000,000	Barclays Bank Plc	5.630%	11/03/2024	31,656,986	0.08
89,359,000	Bedford Row Funding Corp	5.820%	22/01/2024	89,370,426	0.23
79,385,000	BNP Paribas	5.840%	08/07/2024	79,466,979	0.21
32,022,000	Brighthouse Financial Short Term Funding LLC	5.430%	05/09/2024	30,876,705	0.08
150,451,000	Caisse D'Amortissement De La Dette Sociale	5.545%	13/02/2024	149,449,186	0.39
33,599,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.750%	03/06/2024	33,629,665	0.09
82,518,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.970%	03/06/2024	82,651,648	0.22
4,983,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.754%	05/06/2024	4,990,119	0.01
93,782,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	6.030%	01/07/2024	93,981,361	0.25
67,891,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.680%	09/07/2024	67,942,161	0.18
268,548,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	5.800%	23/07/2024	268,553,932	0.70
193,152,000	Credit Agricole CIB	5.740%	08/02/2024	193,213,884	0.51
79,449,000	Deutsche Bank AG/New York	5.700%	23/03/2024	79,473,007	0.21
60,667,000	Dexia Credit Local	5.395%	02/05/2024	59,543,818	0.16
25,000,000	Equitable Short Term Funding LLC	5.610%	08/03/2024	24,742,331	0.07
61,950,000	Fms Wertmanagement	5.340%	17/01/2024	61,799,171	0.16
128,485,000	Fms Wertmanagement	5.340%	22/01/2024	128,090,378	0.34
55,381,000	Gotham Funding Corporation	5.607%	05/02/2024	55,075,513	0.14
97,282,000	Gotham Funding Corporation	5.650%	15/02/2024	96,596,328	0.25
153,562,000	Gotham Funding Corporation	5.600%	21/02/2024	152,343,220	0.40
73,240,000	Gotham Funding Corporation	5.550%	20/03/2024	72,328,694	0.19
170,000,000	Great Bear Funding LLC	5.330%	02/01/2024	169,949,661	0.45
167,000,000	Great Bear Funding LLC	5.340%	03/01/2024	166,925,685	0.44

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	コマーシャル・ペーパー				
42,581,000	GTA Funding LLC	5.510%	19/01/2024	42,455,846	0.11
40,000,000	GTA Funding LLC	5.570%	31/01/2024	39,810,621	0.10
50,000,000	GTA Funding LLC	5.550%	12/03/2024	49,455,867	0.13
57,772,000	ING (U.S.) Funding LLC	5.750%	16/02/2024	57,783,201	0.15
57,005,000	ING (U.S.) Funding LLC	5.660%	01/04/2024	56,199,165	0.15
256,027,000	Ionic Capital III Trust	5.480%	18/01/2024	255,408,011	0.67
236,783,000	Ionic Capital III Trust	4.443%	01/02/2024	235,959,144	0.62
115,921,000	J.P. Morgan Securities LLC	5.970%	15/04/2024	116,050,021	0.30
9,318,000	J.P. Morgan Securities LLC	5.779%	06/06/2024	9,334,165	0.02
75,535,000	J.P. Morgan Securities LLC	6.040%	07/06/2024	75,652,805	0.20
70,516,000	J.P. Morgan Securities LLC	6.000%	21/10/2024	70,593,735	0.19
28,280,000	J.P. Morgan Securities Plc	5.610%	09/02/2024	28,103,278	0.07
105,246,000	J.P. Morgan Securities Plc	5.600%	22/02/2024	104,389,671	0.27
400,000,000	KfW Development Bank	5.383%	04/01/2024	399,771,624	1.05
220,000,000	Kingdom of Sweden	5.461%	09/02/2024	218,450,650	0.57
81,500,000	Korea Development Bank	5.590%	05/01/2024	81,437,533	0.21
97,650,000	LA Fayette Asset Securitisation LLC	5.600%	01/02/2024	97,173,702	0.25
50,000,000	LA Fayette Asset Securitisation LLC	5.570%	05/02/2024	49,725,635	0.13
69,222,000	LA Fayette Asset Securitisation LLC	5.430%	26/04/2024	67,988,889	0.18
72,053,000	Liberty Street Funding LLC	5.440%	15/03/2024	71,222,815	0.19
70,288,000	Liberty Street Funding LLC	5.440%	19/03/2024	69,425,145	0.18
129,264,000	Liberty Street Funding LLC	5.440%	20/03/2024	127,657,760	0.33
72,150,000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc	5.950%	24/07/2024	72,345,467	0.19
38,478,000	LMA SA	5.620%	12/01/2024	38,405,958	0.10
98,010,000	LMA SA	5.580%	17/01/2024	97,753,502	0.26
31,352,000	LMA SA	5.580%	31/01/2024	31,202,253	0.08
29,308,000	LMA SA	5.580%	01/02/2024	29,163,641	0.08
15,210,000	LMA SA	5.650%	21/02/2024	15,088,724	0.04
28,886,000	LMA SA	5.620%	22/02/2024	28,651,251	0.08
15,612,000	Manhattan Asset Funding Company LLC	5.580%	16/01/2024	15,573,750	0.04
28,367,000	Manhattan Asset Funding Company LLC	5.600%	21/02/2024	28,142,023	0.07
100,000,000	Matchpoint Finance Plc	5.770%	05/04/2024	100,032,941	0.26
76,430,000	Matchpoint Finance Plc	5.790%	08/05/2024	76,453,421	0.20
18,175,000	Matchpoint Finance Plc	5.560%	28/05/2024	17,769,366	0.05
65,317,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.610%	05/02/2024	64,954,774	0.17
79,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.618%	27/02/2024	78,288,201	0.21
7,506,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.870%	01/05/2024	7,511,806	0.02
29,875,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.950%	13/08/2024	29,912,604	0.08
32,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	5.820%	11/10/2024	31,995,109	0.08
55,270,000	Mizuho Bank Ltd	5.620%	09/01/2024	55,193,249	0.14
400,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.474%	22/01/2024	398,661,900	1.04
72,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.596%	12/02/2024	71,518,780	0.19
200,000,000	Mizuho Bank Ltd	5.596%	12/02/2024	198,329,806	0.52
80,255,000	Mizuho Bank Ltd	5.655%	15/02/2024	79,697,863	0.21
126,694,000	Mizuho Bank Ltd	5.800%	03/05/2024	126,797,656	0.33
168,348,000	MUFG Bank Ltd	5.740%	12/02/2024	168,373,082	0.44
160,602,000	MUFG Bank Ltd	5.820%	06/05/2024	160,749,164	0.42
90,539,000	Regency Markets No. 1 LLC	5.400%	19/01/2024	90,280,964	0.24
31,197,000	Ridgefield Funding Co LLC	5.570%	20/05/2024	30,533,037	0.08
209,575,000	Royal Bank of Canada	5.470%	28/02/2024	207,725,289	0.54
14,650,000	Royal Bank of Canada	6.042%	08/07/2024	14,671,310	0.04

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
コマーシャル・ペーパー					
56,000,000	Royal Bank of Canada	5.960%	04/11/2024	56,078,583	0.15
39,000,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.880%	03/01/2024	39,000,493	0.10
72,188,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.500%	25/01/2024	71,912,287	0.19
196,465,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.580%	12/02/2024	195,190,593	0.51
38,332,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.610%	14/02/2024	38,071,787	0.10
50,000,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.470%	07/03/2024	49,497,934	0.13
25,000,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.450%	12/03/2024	24,730,233	0.06
40,000,000	Salisbury Receivables Company LLC	5.440%	18/03/2024	39,520,296	0.10
73,567,000	Santander UK Plc	5.620%	01/02/2024	73,207,558	0.19
27,431,000	Sheffield Receivables Co LLC	5.580%	06/02/2024	27,274,812	0.07
85,176,000	Sheffield Receivables Co LLC	5.560%	14/02/2024	84,586,159	0.22
69,812,000	Starbird Funding Corp	5.610%	13/02/2024	69,343,792	0.18
66,214,000	Starbird Funding Corp	5.590%	16/02/2024	65,733,201	0.17
57,194,000	Starbird Funding Corp	5.570%	10/05/2024	56,063,418	0.15
194,028,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	5.740%	07/02/2024	194,064,386	0.51
157,633,000	The State of the Netherlands	5.380%	19/01/2024	157,236,563	0.41
300,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.480%	01/04/2024	295,748,223	0.77
83,868,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.280%	10/12/2024	79,881,600	0.21
60,683,000	Toronto-Dominion Bank/The	5.050%	12/12/2024	57,783,782	0.15
171,182,000	UBS AG	5.720%	04/03/2024	169,526,078	0.44
116,498,000	UBS AG	5.650%	13/05/2024	114,122,115	0.30
54,713,000	UBS AG	5.685%	01/07/2024	53,219,878	0.14
156,586,000	UBS AG	5.350%	04/12/2024	149,258,228	0.39
151,352,000	Victory Receivables Corp	5.620%	09/02/2024	150,412,013	0.39
226,656,000	Victory Receivables Corp	5.640%	14/02/2024	225,093,191	0.59
25,148,000	Victory Receivables Corp	5.650%	15/02/2024	24,970,750	0.07
35,406,000	Wells Fargo Bank NA	6.000%	13/11/2024	35,454,627	0.09
158,200,000	Wells Fargo Bank NA	5.720%	19/11/2024	158,923,428	0.42
86,624,000	Wells Fargo Bank NA	5.230%	13/12/2024	86,686,884	0.23
コマーシャル・ペーパー合計				10,408,264,208	27.25
現先取引					
500,000,000	Banco Santander SA Repo	5.330%	02/01/2024	500,000,000	1.31
1,000,000,000	BofA Securities Repo	5.350%	02/01/2024	1,000,000,000	2.62
100,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.330%	02/01/2024	100,000,000	0.26
650,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.340%	02/01/2024	650,000,000	1.70
2,200,000,000	MUFG Securities (Canada) Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	2,200,000,000	5.76
750,000,000	Nomura Securities Repo	5.350%	02/01/2024	750,000,000	1.96
3,500,000,000	State Street Bank And Trust Co Repo	5.320%	02/01/2024	3,500,000,000	9.16
1,225,000,000	Wells Fargo Securities LLC Repo	5.350%	02/01/2024	1,225,000,000	3.21
現先取引合計				9,925,000,000	25.98
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている以外の譲渡性有価証券合計				24,551,243,666	64.28
預金					
定期預金					
1,008,000,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	5.320%	02/01/2024	1,008,000,000	2.64
1,300,000,000	Societe Generale	5.420%	02/01/2024	1,300,000,000	3.40
1,300,000,000	Societe Generale	5.420%	03/01/2024	1,300,000,000	3.40
217,000,000	TP ICAP Global Markets Americas LLC	5.300%	02/01/2024	217,000,000	0.57
2,774,000,000	TP ICAP Global Markets Americas LLC	5.310%	02/01/2024	2,774,000,000	7.27
650,000,000	TP ICAP Global Markets Americas LLC	5.320%	02/01/2024	650,000,000	1.70
定期預金合計				7,249,000,000	18.98
預金合計				7,249,000,000	18.98
投資資産合計				39,611,340,866	103.71

GSビッグデータ・ストラテジー（エマージング株）

投資合計	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
社債合計	99,617,694	0.26
国債合計	7,711,479,506	20.19
譲渡性預金証書合計	4,217,979,458	11.05
コマーシャル・ペーパー合計	10,408,264,208	27.25
現先取引合計	9,925,000,000	25.98
定期預金合計	7,249,000,000	18.98
その他資産・負債	(1,415,228,083)	(3.71)
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産	38,196,112,783	100.00