

グローバル 新成長国オープン

愛称：グローバルネクスト

第196期末(2024年1月5日)	第191期～第196期		
基準価額	3,743円	騰落率	2.3%
純資産総額	1,632百万円	分配金合計	120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／資産複合
信託期間	原則として無期限
運用方針	新成長国の株式を主要投資対象とする投資信託証券、新成長国の債券を主要投資対象とする投資信託証券への投資を通じて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・エクイティ・ポートフォリオ ②ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ ③ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ
指定投資信託証券①	エマージング諸国の主に株式および株式関連証券
指定投資信託証券②	エマージング諸国の主に現地通貨建て債券
指定投資信託証券③	エマージング諸国の主に米ドル建て債券
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、株式への直接投資は行いません。 ③実質的に保有する各資産クラスの投資比率は、新成長国の株式：20%、新成長国の債券：80%(現地通貨建て債券：60%、米ドル建て債券：20%)を基本とします。
分配方針	原則として毎計算期末(毎月5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／資産複合

第191期(決算日2023年8月7日)

第192期(決算日2023年9月5日)

第193期(決算日2023年10月5日)

第194期(決算日2023年11月6日)

第195期(決算日2023年12月5日)

第196期(決算日2024年1月5日)

作成対象期間：2023年7月6日～2024年1月5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、「グローバル新成長国オープン」は、このたび、第191期～第196期の決算を行いました。本ファンドは、新成長国(先進国を除いた国および地域)の株式および債券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っております。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

〒106-6147 東京都港区六本木6-10-1 六本木ヒルズ森タワー

お問合せ先：03-6437-6000(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作成期の運用実績

決 算 期		基準価額 (分配落)	税引前	期	参考指標	期	投資信託証券 比	純 資 産 額
			分配金	騰 落		騰 落		
		円	円	%		%	%	百万円
①	167期 (2021年8月5日)	3,897	20	△1.7	17,422	△1.8	99.0	2,043
	168期 (2021年9月6日)	3,911	20	0.9	17,624	1.2	99.6	2,017
	169期 (2021年10月5日)	3,790	20	△2.6	17,167	△2.6	98.8	1,949
	170期 (2021年11月5日)	3,853	20	2.2	17,512	2.0	99.6	1,967
	171期 (2021年12月6日)	3,712	20	△3.1	17,041	△2.7	99.2	1,857
	172期 (2022年1月5日)	3,822	20	3.5	17,489	2.6	99.0	1,895
②	173期 (2022年2月7日)	3,753	20	△1.3	17,432	△0.3	99.1	1,858
	174期 (2022年3月7日)	3,370	20	△9.7	15,807	△9.3	98.9	1,660
	175期 (2022年4月5日)	3,627	20	8.2	17,362	9.8	99.2	1,782
	176期 (2022年5月6日)	3,608	20	0.0	16,976	△2.2	98.2	1,762
	177期 (2022年6月6日)	3,634	20	1.3	17,586	3.6	98.9	1,775
	178期 (2022年7月5日)	3,540	20	△2.0	17,141	△2.5	99.5	1,716
③	179期 (2022年8月5日)	3,528	20	0.2	17,465	1.9	99.8	1,703
	180期 (2022年9月5日)	3,610	20	2.9	17,802	1.9	99.2	1,738
	181期 (2022年10月5日)	3,514	20	△2.1	17,571	△1.3	98.7	1,681
	182期 (2022年11月7日)	3,544	20	1.4	17,731	0.9	99.2	1,684
	183期 (2022年12月5日)	3,457	20	△1.9	17,704	△0.2	99.4	1,637
	184期 (2023年1月5日)	3,393	20	△1.3	17,487	△1.2	98.2	1,596
④	185期 (2023年2月6日)	3,547	20	5.1	17,897	2.3	99.2	1,665
	186期 (2023年3月6日)	3,457	20	△2.0	18,052	0.9	99.2	1,619
	187期 (2023年4月5日)	3,397	20	△1.2	17,738	△1.7	97.3	1,591
	188期 (2023年5月8日)	3,475	20	2.9	18,465	4.1	98.9	1,628
	189期 (2023年6月5日)	3,564	20	3.1	19,024	3.0	98.9	1,651
	190期 (2023年7月5日)	3,778	20	6.6	20,046	5.4	99.2	1,728
⑤	191期 (2023年8月7日)	3,692	20	△1.7	19,903	△0.7	99.2	1,686
	192期 (2023年9月5日)	3,765	20	2.5	20,237	1.7	99.5	1,694
	193期 (2023年10月5日)	3,594	20	△4.0	19,471	△3.8	98.7	1,611
	194期 (2023年11月6日)	3,755	20	5.0	20,521	5.4	99.3	1,670
	195期 (2023年12月5日)	3,750	20	0.4	20,594	0.4	99.1	1,651
	196期 (2024年1月5日)	3,743	20	0.3	20,638	0.2	99.0	1,632

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 参考指標 (MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円ベース) 20%、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) 60%、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) 20%)を委託者が合成した指数)は2007年9月3日を10,000として指数化しております。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況推移

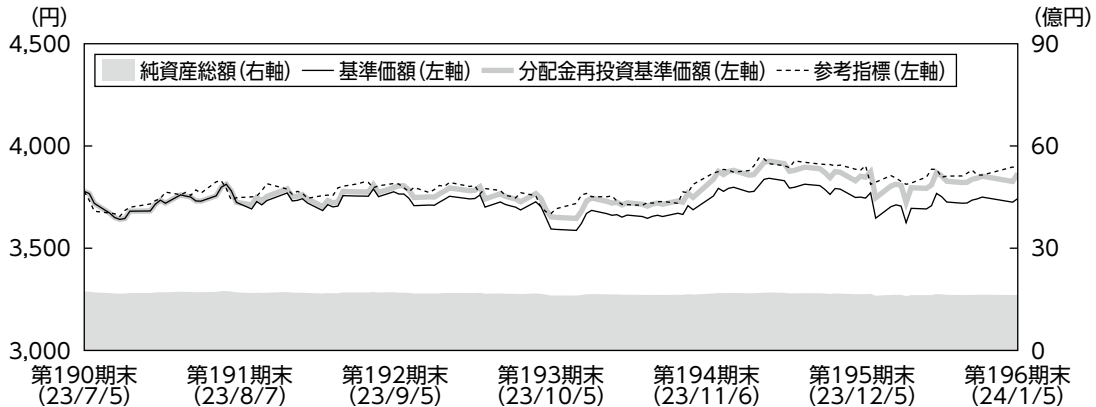
決算期	年 月 日	基準価額		参考指標	投資信託証券比	
		騰落率	騰落率		騰落率	騰落率
第191期	(期首) 2023年7月5日	円 3,778	% —	20,046	% —	% 99.2
	7月末	3,756	△0.6	20,294	1.2	99.2
	(期末) 2023年8月7日	3,712	△1.7	19,903	△0.7	99.2
第192期	(期首) 2023年8月7日	3,692	—	19,903	—	99.2
	8月末	3,790	2.7	20,141	1.2	98.4
	(期末) 2023年9月5日	3,785	2.5	20,237	1.7	99.5
第193期	(期首) 2023年9月5日	3,765	—	20,237	—	99.5
	9月末	3,687	△2.1	20,012	△1.1	98.1
	(期末) 2023年10月5日	3,614	△4.0	19,471	△3.8	98.7
第194期	(期首) 2023年10月5日	3,594	—	19,471	—	98.7
	10月末	3,665	2.0	20,033	2.9	98.7
	(期末) 2023年11月6日	3,775	5.0	20,521	5.4	99.3
第195期	(期首) 2023年11月6日	3,755	—	20,521	—	99.3
	11月末	3,792	1.0	20,708	0.9	98.6
	(期末) 2023年12月5日	3,770	0.4	20,594	0.4	99.1
第196期	(期首) 2023年12月5日	3,750	—	20,594	—	99.1
	12月末	3,750	0.0	20,469	△0.6	98.4
	(期末) 2024年1月5日	3,763	0.3	20,638	0.2	99.0

(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 (MSCIエマージング・マーケット・インデックス (円ベース) 20%、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) 60%、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド (円ベース) 20%を委託者が合成した指数) は2007年9月3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（2023年7月6日～2024年1月5日）



第191期首：3,778円

第196期末：3,743円

（当作成期中にお支払いした分配金：120円）

騰落率：+2.3%（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（円ベース）20%、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）60%、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）20%を委託者が合成した指数であり、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（獨創性、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、当作成期（以下、「当期」といいます。）の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3,778円から35円下落し、期末には3,743円となりました。

上昇要因

新成長国株式市場（現地通貨ベース）、現地通貨建て新成長国債券市場（現地通貨ベース）や米ドル建て新成長国債券市場（米ドルベース）が上昇したことに加え、米ドルが対円で上昇したことなどが基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

トルコ・リラなどの通貨が対円で下落したことや、分配金をお支払いしたことなどが基準価額の下落要因となりました。

◆投資環境について

<新成長国株式市場>

米国債や米地銀の格下げがグローバルに投資家センチメントの悪化を促すとともに、軟調な主要経済指標を受けて、新成長国株式市場は上値の重い展開となりました。中国においては、中国恒大集団の新たなデフォルトの発生や創業者の逮捕が中国の不動産信用問題の再燃を引き起こし、市場の不安を増大させました。その後、米国における追加利上げ観測が後退し急上昇を続けていた米長期金利に一服感がみられ、その後は金利低下が継続したことから、新成長国株式市場に追い風が吹きました。また、中国での重要な政治イベントである中央経済工作会議では不動産市場への大規模な刺激策が見送られたものの、米国での金利据え置きや米国の利下げに前向きな姿勢が好感され、新成長国株式市場の上げ幅が広がりました。

<現地通貨建て新成長国債券市場>

当期の現地通貨建て新成長国債券市場は上昇しました。期の前半は、米国のインフレが鈍化したことや中国当局の景気支援姿勢などが下支えとなったものの、中国の経済や不動産を巡る懸念に加え、米国における高金利の長期化観測などが重石となり、概ねレンジ圏内の推移となりました。期の後半にかけては米国の利上げ終了観測が強まり、投資家のリスク選好度が高まったことなどから上昇し、前期末を上回る水準で期を終えました。

<新成長国通貨市場>

当期の新成長国通貨市場は、対円では通貨毎に乖離が生じ、ポーランド・ズロチやコロンビア・ペソなどが相対的に堅調となった一方、トルコ・リラなどが相対的に軟調となりました。ポーランド・ズロチは、総選挙で親EU派である野党勢力が過半数議席を獲得したことなどが市場で好感されたほか、中央銀行が市場予想に反して政策金利を据え置いたことなどが下支えとなりました。一方、トルコ・リラは、インフレが高水準であることや、中央銀行が利上げサイクルの終了を示唆したことなどが重石となりました。

<米ドル建て新成長国債券市場>

当期の米ドル建て新成長国債券市場は、米国債の利回りが上昇（価格は下落）したものの、スプレッド（米国債に対する上乗せ金利）が縮小したことから、トータル・リターンはプラスとなりました。期の前半は米金利の上昇に加え、中国を巡る懸念などからスプレッドは拡大しました。期の後半は、米国の雇用統計やインフレが市場予想を下回ったことなどを背景に利上げサイクルの終了観測が強まり、投資家心理が改善したことなどからスプレッドは縮小しました。結局、スプレッドは前期末を下回る水準で期を終えました。

◆ポートフォリオについて

<本ファンド>

新成長国の株式および債券への投資を通じて、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・マーケット・エクイティ・ポートフォリオ、ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオおよびゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオを主要投資対象とし、資産配分は、新成長国株式20%、現地通貨建て新成長国債券60%、米ドル建て新成長国債券20%を基本としました。

・組入れファンドの当期中の騰落率（分配金再投資、円換算ベース）

ファンド名	騰落率
新成長国株式ポートフォリオ* ¹	-1.5%
新成長国債券ポートフォリオ（現地通貨建て）* ²	3.2%
新成長国債券ポートフォリオ（米ドル建て）* ³	6.3%

（注）純資産価格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。

正式名称はそれぞれ以下の通りです。

ルクセンブルグ籍外国投資証券 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・エクイティ・ポートフォリオ I X シェアクラス

* 2 ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ I X シェアクラス

* 3 ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ I X シェアクラス

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

新成長国市場の幅広い地域の株式に分散投資を行います。新成長国市場は、経済規模拡大によって、更なる発展および拡大の余地が期待できる市場と考えられます。同市場では、先進国との輸出を中心とした取引による外需と域内の巨大な人口を背景とした内需の両輪による高い成長力が期待される企業が多くみられます。当期も引き続き新成長国の株式に投資し、株式の組入比率を概ね高位に保ちながら、長期的なリターンを享受することをめざしました。

期中、個別銘柄ではゾマト、メディアテック、サムスン電子などがプラスに寄与しました。一方で、テンセント・ホールディングス、メイトウアン、ピンアン・インシュアランスなどがマイナスに寄与しました。

<ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ>

期首においては、ポーランドやチェコなどの現地通貨建て債券のほか、シンガポール・ドルやメキシコ・ペソなどの通貨に対して相対的に強気のポジションを取った一方で、イスラエルやチリなどの現地通貨建て債券のほか、トルコ・リラやチェコ・コルナなどの通貨に対して相対的に弱気のポジションを取りました。

期末においては、チェコや中国などの現地通貨建て債券のほか、シンガポール・ドルやポーランド・ズロチなどの通貨に対して相対的に強気のポジションを取った一方で、コロンビアやメキシコなどの現地通貨建て債券のほか、中国人民元やコロンビア・ペソなどの通貨に対して相対的に弱気のポジションを取りました。

<ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ>

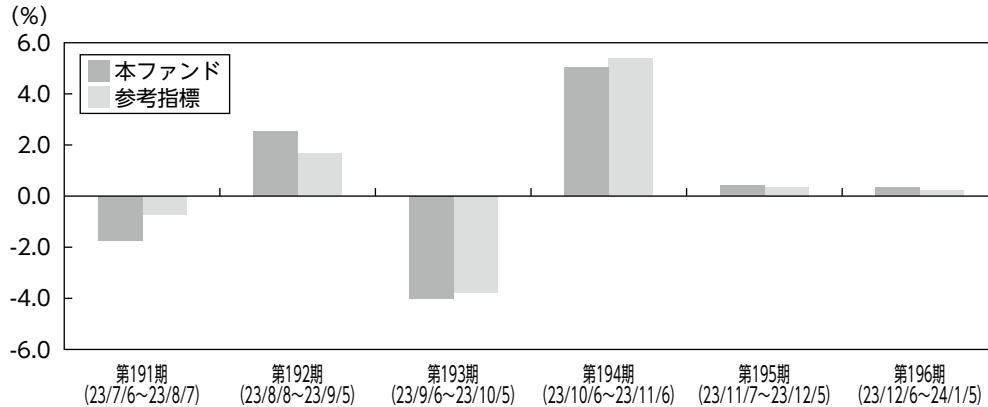
期首においてはメキシコや中国などを相対的に強気のポジションとした一方で、フィリピンやマレーシアなどを相対的に弱気のポジションとしました。

期末においてはメキシコや南アフリカなどを相対的に強気のポジションとした一方で、フィリピンやカタールなどを相対的に弱気のポジションとしました。

◆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（円ベース）20%、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）60%、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）20%を委託者が合成した指数であり、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+2.3%となった一方、参考指標のパフォーマンスは+2.9%となりました。

◆分配金について

収益分配金（1万円当たり、税引前）については、分配方針および基準価額の水準などを勘案し、第191期から第196期は各20円としました。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>

今後も引き続き新成長国市場全体の収益機会の追求を目的として、投資信託証券を通じて新成長国の株式および債券に投資し、基本資産配分に沿った運用を行います。

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

追加利上げ観測が落ち着きをみせ、新成長国株式市場には追い風となる材料が散見されつつある一方で、規制環境の変化や地政学リスク、企業ガバナンスに対する懸念など、投資に関わる不確実性はますます高まっています。企業が置かれる事業環境は引き続き流動的であるとともに、投資環境としてもマクロおよびミクロ経済ともに注視が必要な状況が続いております。グローバル景気は今なお不透明な環

境下にあることから、企業個々の業績動向の把握と株価動向などを加味した銘柄選択が重要となる局面にあると考えます。また運用においては、新成長国における一人当たり所得の増加は消費の拡大や経済発展を牽引する重要な要素であるとみており、労働人口の増加、労働参加率の上昇、前世代より教育水準が上がり都市化された人々の増加により、さらに高まることが予想されます。これらの成長ポテンシャルを勘案すると、新成長国株式市場は魅力的なバリュエーション水準にあると考えます。

今後も引き続き運用の基本方針に基づいて運用を行います。

<ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ>

現地通貨建て新成長国債券市場については、米国の景気動向や先進国の高金利長期化観測が新成長国債券市場の主な注目点になるとの見方をしています。グローバルの金融環境はタイト化しているにもかかわらず、新成長国ではインフレが各国中央銀行の目標水準に近づいていることから、金融緩和の動きが徐々に広がっていくとみられます。また、新成長国諸国の名目GDP成長率は鈍化しているものの相対的に高水準であることなども好材料です。一方、2024年の米国大統領選挙に向けて、不確実性が高まることから市場ボラティリティが高まる可能性があることには注意が必要です。また、南アフリカやメキシコなど新成長国でも多くの選挙が予定されており、マクロ環境や市場の見通しに影響を及ぼすとみられています。引き続き、地政学リスクに加え、グローバルの選挙動向や金融政策による新成長国市場への影響も注視する方針です。このような環境下、各国のファンダメンタルズなどを精査しつつ、ポジションを構築することが重要と考えます。

当社では、新成長国通貨については、シンガポール・ドルやポーランド・ズロチなどを強気にみる一方、中国人民元やコロンビア・ペソなどを弱気にみています。シンガポール・ドルについては、経常収支が黒字であることなどが下支えになる可能性を見込み、強気にみています。一方、中国人民元については、経済指標は強弱混在しており、依然として先行き不透明感が高いことなどから弱気にみています。現地通貨建て債券については、チェコや中国などを強気にみる一方、コロンビアやメキシコなどを弱気にみています。チェコについては、インフレが減速していることなどから強気にみています。一方、コロンビアについては、インフレが高水準であることや、双子の赤字を抱えていることなどから弱気にみています。

今後も引き続き運用の基本方針に基づいて運用を行います。

<ゴールドマン・サックス・エマージング・マーケット・デット・ポートフォリオ>

米ドル建て新成長国債券市場において、米国の景気動向や先進国の高金利長期化観測が新成長国債券市場の主な注目点になるとの見方をしています。グローバルの金融環境はタイト化しているにもかかわらず、新成長国ではインフレが各国中央銀行の目標水準に近づいていることから、金融緩和の動きが徐々に広がっていくとみられます。また、新成長国諸国の名目GDP成長率は鈍化しているものの相対的に高水準であることなども好材料です。一方、2024年の米国大統領選挙にかけて、不確実性が高まることから市場ボラティリティが高まる可能性があることには注意が必要です。また、南アフリカやメキシコなど新成長国でも多くの選挙が予定されており、マクロ環境や市場の見通しに影響を及ぼすとみられています。引き続き、地政学リスクに加え、グローバルの選挙動向や金融政策による新成長国市場への影響も注視する方針です。このような環境下、各国のファンダメンタルズなどを精査しつつ、ポジションを構築することが重要と考えます。

今後も引き続き運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(上記見通しは2024年1月5日現在のものであり、今後見通しは変更されることもあります。)

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第191期～第196期		項目の概要
	2023年7月6日～2024年1月5日		
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	20円 (1)	0.531% (0.028)	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、運用報告書等各种書類の送付、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)	(18)	(0.487)	
(受託会社)	(1)	(0.017)	
その他費用 (保管費用)	2 (1)	0.052 (0.026)	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)	(0)	(0.006)	
(その他)	(1)	(0.020)	
合計	22	0.583	

期中の平均基準価額は3,740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。

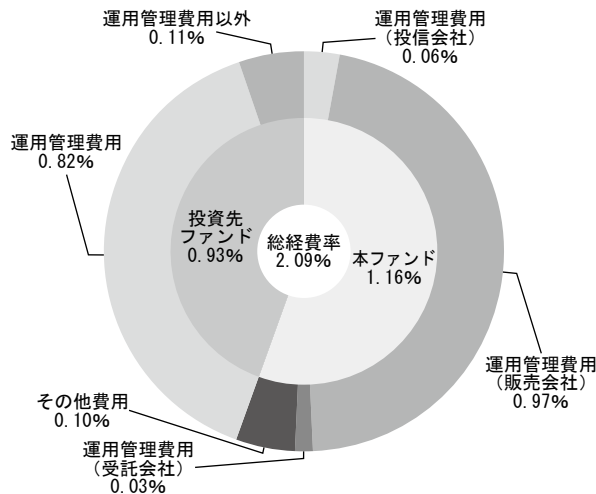
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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

当作成対象期間の運用・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2.09%です。



総経費率 (①+②+③)	2.09%
①本ファンドの費用の比率	1.16%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.82%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.11%

(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（2023年7月6日から2024年1月5日まで）
投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名		第 191 期 ~		第 196 期	
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	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・デット・ ローカル・ポートフォリオ IXシエアクラス	474,743	546 千米ドル	522,302	600 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・デット・ ポートフォリオ IXシエアクラス	73,253	181	119,600	300
	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・ エクイティ・ポートフォリオ IXシエアクラス	26,787	163	32,086	200

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2023年7月6日から2024年1月5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1月5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	第 196 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・デット・ ローカル・ポートフォリオ IXシエアクラス	5,866,172	6,746	978,319	59.9
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・デット・ ポートフォリオ IXシエアクラス	873,815	2,202	319,336	19.6
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・ エクイティ・ポートフォリオ IXシエアクラス	350,730	2,195	318,401	19.5
合 計	7,090,717	11,143	1,616,057	<99.0%>

(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1月5日現在

項 目	第 196 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 1,616,057	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27,373	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,643,430	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(1,617,357千円)の投資信託財産総額(1,643,430千円)に対する比率は98.4%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=145.02円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 191 期 末	第 192 期 末	第 193 期 末	第 194 期 末	第 195 期 末	第 196 期 末
	2023年8月7日	2023年9月5日	2023年10月5日	2023年11月6日	2023年12月5日	2024年1月5日
(A) 資 産	1,699,786,860円	1,715,486,871円	1,622,796,521円	1,681,791,578円	1,662,260,384円	1,643,430,327円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	13,229,079	13,860,211	31,741,157	23,266,801	25,263,093	27,373,204
投 資 証 券(評価額)	1,672,387,781	1,686,970,660	1,591,055,364	1,658,524,777	1,636,997,291	1,616,057,123
未 収 入 金	14,170,000	14,656,000	-	-	-	-
(B) 負 債	13,244,124	20,504,490	11,292,869	11,530,596	10,983,031	11,005,883
未 払 収 益 分 配 金	9,136,241	9,004,920	8,968,465	8,897,283	8,807,912	8,721,518
未 払 解 約 金	2,408,250	10,014,205	807,699	1,053,674	703,251	756,941
未 払 信 託 報 酬	1,622,824	1,418,229	1,448,172	1,508,274	1,405,364	1,458,404
未 払 利 息	72	75	57	44	52	58
そ の 他 未 払 費 用	76,737	67,061	68,476	71,321	66,452	68,962
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,686,542,736	1,694,982,381	1,611,503,652	1,670,260,982	1,651,277,353	1,632,424,444
元 本	4,568,120,739	4,502,460,281	4,484,232,586	4,448,641,957	4,403,956,056	4,360,759,039
次 期 繰 越 損 益 金	△2,881,578,003	△2,807,477,900	△2,872,728,934	△2,778,380,975	△2,752,678,703	△2,728,334,595
(D) 受 益 権 総 口 数	4,568,120,739口	4,502,460,281口	4,484,232,586口	4,448,641,957口	4,403,956,056口	4,360,759,039口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	3,692円	3,765円	3,594円	3,755円	3,750円	3,743円

(注) 当作成期首元本額は4,575,073,096円、当作成期間(第191期~第196期)中において、追加設定元本額は53,257,990円、同解約元本額は267,572,047円です。

■損益の状況

項 目	第 191 期	第 192 期	第 193 期	第 194 期	第 195 期	第 196 期
	自 2023年7月6日 至 2023年8月7日	自 2023年8月8日 至 2023年9月5日	自 2023年9月6日 至 2023年10月5日	自 2023年10月6日 至 2023年11月6日	自 2023年11月7日 至 2023年12月5日	自 2023年12月6日 至 2024年1月5日
(A) 配当等収益	19,306,871円	19,974,950円	20,448,134円	19,479,612円	18,372,033円	17,840,883円
受取配当金	19,188,569	19,938,083	20,327,753	19,427,956	18,240,693	17,690,625
その他収益金	165,601	180,368	177,660	166,990	162,796	159,803
支払利息	△ 47,299	△ 143,501	△ 57,279	△ 115,334	△ 31,456	△ 9,545
(B) 有価証券売買損益	△ 47,774,243	23,264,493	△ 86,501,365	62,614,914	△ 10,226,599	△ 10,174,025
売 買 益	38,670	56,905,001	26,749,946	71,397,907	17,539,724	13,806,813
売 買 損	△ 47,812,913	△ 33,640,508	△ 113,251,311	△ 8,782,993	△ 27,766,323	△ 23,980,838
(C) 信託報酬等	△ 1,775,339	△ 1,557,326	△ 1,590,643	△ 1,654,420	△ 1,548,031	△ 1,601,441
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 30,242,711	41,682,117	△ 67,643,874	80,440,106	6,597,403	6,065,417
(E) 前期繰越損益金	△ 2,020,645,057	△ 2,026,371,827	△ 1,981,742,692	△ 2,037,846,831	△ 1,942,693,228	△ 1,922,096,529
(F) 追加信託差損益金	△ 821,553,994	△ 813,783,270	△ 814,373,903	△ 812,076,967	△ 807,774,966	△ 803,581,965
(配当等相当額)	(478,822,195)	(473,510,315)	(473,146,320)	(471,018,213)	(467,866,170)	(464,816,455)
(売買損益相当額)	(△1,300,376,189)	(△1,287,293,585)	(△1,287,520,223)	(△1,283,095,180)	(△1,275,641,136)	(△1,268,398,420)
(G) 計 (D+E+F)	△ 2,872,441,762	△ 2,798,472,980	△ 2,863,760,469	△ 2,769,483,692	△ 2,743,870,791	△ 2,719,613,077
(H) 収益分配金	△ 9,136,241	△ 9,004,920	△ 8,968,465	△ 8,897,283	△ 8,807,912	△ 8,721,518
次期繰越損益金(G+H)	△ 2,881,578,003	△ 2,807,477,900	△ 2,872,728,934	△ 2,778,380,975	△ 2,752,678,703	△ 2,728,334,595
追加信託差損益金	△ 821,553,994	△ 813,783,270	△ 814,373,903	△ 812,076,967	△ 807,774,966	△ 803,581,965
(配当等相当額)	(478,822,195)	(473,510,315)	(473,146,320)	(471,018,213)	(467,866,170)	(464,816,455)
(売買損益相当額)	(△1,300,376,189)	(△1,287,293,585)	(△1,287,520,223)	(△1,283,095,180)	(△1,275,641,136)	(△1,268,398,420)
分配準備積立金	799,200,405	796,395,356	801,510,097	803,714,074	802,079,409	800,191,625
繰越損益金	△ 2,859,224,414	△ 2,790,089,986	△ 2,859,865,128	△ 2,770,018,082	△ 2,746,983,146	△ 2,724,944,255

(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。

■分配金のお知らせ

決 算 期	第191期	第192期	第193期	第194期	第195期	第196期
1 万 口 当 たり 分 配 金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

- ◇分配金には、課税扱いとなる普通分配金と、非課税扱いとなる元本払戻金（特別分配金）があります。
- ◇分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、下回る部分に相当する金額が元本払戻金（特別分配金）、残りの部分が普通分配金となります。
- ◇税率は、個人の受益者については原則20.315%（所得税15.315%、地方税5%）です。ただし、外国税額控除の適用となった場合には、軽減される場合があります。
- ◇税法が改正された場合等には、上記内容が変更になる場合もあります。

■分配原資の内訳

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項 目	第 191 期	第 192 期	第 193 期	第 194 期	第 195 期	第 196 期
	2023年7月6日 ~2023年8月7日	2023年8月8日 ~2023年9月5日	2023年9月6日 ~2023年10月5日	2023年10月6日 ~2023年11月6日	2023年11月7日 ~2023年12月5日	2023年12月6日 ~2024年1月5日
当期分配金	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率)	0.539	0.528	0.553	0.530	0.531	0.531
当期の収益	20	20	20	20	20	20
当期の収益以外	—	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	2,797	2,820	2,842	2,865	2,883	2,900

- (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・エクイティ・ポートフォリオ I X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・エクイティ・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、グローバル新成長国オープン
が投資対象とする外国投資信託証券です。2024年1月5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5月31日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
当座借越支払利息	11,915
有価証券貸付にかかる手数料	5,952
投資顧問報酬	15,307,505
保管費用	994,887
管理事務代行報酬	224,134
販売報酬およびサービシング報酬	264,911
名義書換事務代行報酬	160,287
年次税	345,979
監査報酬	10,804
管理会社報酬	298,720
取締役報酬	12,045
弁護士報酬	47,732
保険費用	32,498
印刷費用	63,687
出版費用	3,320
税務報告報酬	13,025
支払代理人報酬	24,155
規制報告報酬	39,619
その他費用	186,551
	<u>18,047,726</u>
費用合計	<u>18,047,726</u>

■保有有価証券明細（2023年5月31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-96.61%			
ブラジル			
12,815,969	Caixa Seguridade Participacoes SA	25,782,695	0.82
2,482,200	Hypera SA	20,150,466	0.64
4,137,800	Itau Unibanco Holding SA-Preferred	21,499,618	0.68
7,063,700	Odontoprev SA	15,560,558	0.50
5,320,000	Sendas Distribuidora SA	11,593,588	0.37
4,260,500	TIM SA	11,971,022	0.38
		<u>106,557,947</u>	<u>3.39</u>
中国			
9,343,236	Alibaba Group Holding Ltd.	92,201,340	2.93
1,160,200	ANTA Sports Products Ltd.	11,837,778	0.38
1,179,000	BYD Co. Ltd. Class H	35,464,136	1.13
10,279,500	China Merchants Bank Co. Ltd. Class H	47,762,486	1.52
26,100	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. Class A	810,305	0.02

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			
922,561	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. Class A	28,642,004	0.91
2,136,500	ENN Energy Holdings Ltd.	24,836,177	0.79
4,550,000	Haidilao International Holding Ltd.	9,569,126	0.30
729,180	KE Holdings, Inc. ADR	10,365,294	0.33
301,555	Kweichow Moutai Co. Ltd. Class A	68,879,331	2.19
3,657,000	Li Ning Co. Ltd.	19,611,044	0.62
3,400,590	Meituan Class B	47,702,274	1.51
1,939,000	NetEase, Inc.	32,633,926	1.04
12,586,000	PICC Property & Casualty Co. Ltd. Class H	14,989,998	0.48
8,550,000	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. Class H	54,063,533	1.72
861,303	Qingdao Haier Biomedical Co. Ltd. Class A	7,197,407	0.23
506,875	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co. Ltd. Class A	21,393,758	0.68
2,267,700	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	18,341,017	0.58
961,908	Silergy Corp.	12,466,941	0.40
1,388,220	Sungrow Power Supply Co. Ltd. Class A	21,455,227	0.68
1,333,200	Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.	12,526,974	0.40
974,229	Sunresin New Materials Co. Ltd. Class A	12,553,251	0.40
4,365,900	Tencent Holdings Ltd.	172,399,979	5.48
2,062,700	WuXi AppTec Co. Ltd. Class H	16,983,685	0.54
13,758,411	Yunnan Aluminium Co. Ltd. Class A	23,342,868	0.74
4,728,865	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls Co. Ltd. Class A	17,249,405	0.54
		835,279,264	26.54
キプロス			
17,650	TCS Group Holding PLC GDR	0	0.00
エジプト			
9,183,482	Commercial International Bank Egypt SAE	15,543,563	0.49
ギリシャ			
1,616,896	Hellenic Exchanges - Athens Stock Exchange SA	8,476,822	0.27
1,195,459	JUMBO SA	27,775,576	0.88
4,739,918	National Bank of Greece SA	29,607,122	0.94
1,401,421	Sarantis SA	11,147,934	0.36
		77,007,454	2.45
香港			
1,962,200	AIA Group Ltd.	18,808,558	0.60
7,124,700	Budweiser Brewing Co. APAC Ltd.	17,898,548	0.57
7,300,000	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	28,325,943	0.90
606,381	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd.	22,176,581	0.70
41,412,500	Sino Biopharmaceutical Ltd.	19,714,078	0.63
1,667,500	Techtronic Industries Co. Ltd.	15,428,345	0.49
		122,352,053	3.89
インド			
380,644	Amber Enterprises India Ltd.	9,732,574	0.31
313,143	Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	17,479,225	0.55
1,991,808	Axis Bank Ltd.	22,003,667	0.70
597,842	Cartrade Tech Ltd.	3,010,339	0.10
249,012	Coforge Ltd.	13,688,116	0.43
667,409	Computer Age Management Services Ltd.	17,863,704	0.57
3,622,192	Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd.	12,024,852	0.38
1,138,460	Godrej Properties Ltd.	19,112,040	0.61
1,927,937	HDFC Bank Ltd.	37,463,178	1.19

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			
4,882,216	ICICI Bank Ltd.	55,935,536	1.78
253,564	Info Edge India Ltd.	12,466,790	0.40
2,602,359	Infosys Ltd.	41,413,194	1.32
429,386	Navin Fluorine International Ltd.	24,203,984	0.77
1,121,909	Reliance Industries Ltd.	33,465,365	1.06
914,407	Route Mobile Ltd.	15,865,148	0.50
1,336,228	SBI Life Insurance Co. Ltd.	19,927,351	0.63
2,600,908	Sona Blw Precision Forgings Ltd.	17,010,033	0.54
2,595,540	Sun Pharmaceutical Industries Ltd.	30,578,694	0.97
3,319,583	Tata Consumer Products Ltd.	32,019,125	1.02
379,381	TeamLease Services Ltd.	10,183,485	0.32
26,708,146	Zomato Ltd.	22,265,615	0.71
		467,712,015	14.86
インドネシア			
70,666,100	Bank BTPN Syariah Tbk PT	8,950,795	0.28
99,189,200	Bank Central Asia Tbk PT	59,846,526	1.90
190,545,000	BFI Finance Indonesia Tbk PT	16,579,035	0.53
35,181,000	Map Aktif Adiperkasa PT	14,785,877	0.47
328,605,000	Pakuwon Jati Tbk PT	10,252,442	0.33
14,776,610	Semen Indonesia Persero Tbk PT	5,712,683	0.18
		116,127,358	3.69
メキシコ			
3,811,000	Aalsea SAB de CV	10,728,074	0.34
2,926,199	Arca Continental SAB de CV	29,144,432	0.92
6,477,600	Banco del Bajio SA	20,052,594	0.64
11,617,350	Gentera SAB de CV	12,285,875	0.39
8,136,656	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	31,054,006	0.99
		103,264,981	3.28
フィリピン			
6,418,700	BDO Unibank, Inc.	15,540,425	0.49
3,900,090	Del Monte Pacific Ltd.	618,895	0.02
3,365,510	Jollibee Foods Corp.	14,117,486	0.45
88,143,800	Monde Nissin Corp.	12,711,523	0.41
		42,988,329	1.37
ポーランド			
398,067	Dino Polska SA	39,278,243	1.25
ロシア			
12,186,652	Detsky Mir PJSC	0	0.00
3,030,992	Renaissance Insurance Group JSC	0	0.00
2,480,907	Sberbank of Russia PJSC	0	0.00
395,327	United Medical Group CY PLC GDR	0	0.00
		0	0.00
サウジアラビア			
1,561,521	Alinma Bank	13,583,758	0.43
197,053	Co for Cooperative Insurance	5,978,626	0.19
3,802,926	Saudi Arabian Oil Co.	31,935,369	1.01
1,465,937	Saudi National Bank	14,415,672	0.46
152,859	Saudi Tadawul Group Holding Co.	6,526,211	0.21
		72,439,636	2.30

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
普通株式			
シンガポール			
8,434,025	Nanofilm Technologies International Ltd.	9,146,394	0.29
593,266	TDCX, Inc. ADR	5,161,414	0.16
		<u>14,307,808</u>	<u>0.45</u>
スロベニア			
1,298,168	Nova Ljubljanska Banka dd GDR	20,583,861	0.65
南アフリカ			
1,560,137	Clicks Group Ltd.	18,585,487	0.59
1,673,441	JSE Ltd.	7,777,535	0.25
1,662,981	Mr Price Group Ltd.	10,668,242	0.34
25,655,571	Old Mutual Ltd.	13,920,612	0.44
		<u>50,951,876</u>	<u>1.62</u>
韓国			
149,374	JYP Entertainment Corp.	13,725,615	0.44
427,424	Kia Corp.	27,634,539	0.88
66,859	LG Chem Ltd.	34,873,736	1.11
411,055	LG Electronics, Inc.	38,003,770	1.21
118,033	NAVER Corp.	17,722,686	0.56
40,783	NCSOFT Corp.	9,856,901	0.31
373,522	NHN KCP Corp.	3,132,823	0.10
195,102	Orion Corp.	18,974,372	0.60
3,595,116	Samsung Electronics Co. Ltd.	193,218,476	6.14
		<u>357,142,918</u>	<u>11.35</u>
台湾			
3,666,621	Chailease Holding Co. Ltd.	24,129,046	0.77
1,885,000	MediaTek, Inc.	46,412,902	1.47
357,680	momo.com, Inc.	8,117,160	0.26
1,441,000	Nien Made Enterprise Co. Ltd.	16,500,988	0.52
17,315,444	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	313,476,073	9.96
2,070,170	Tong Hsing Electronic Industries Ltd.	12,326,014	0.39
17,587,000	United Microelectronics Corp.	29,547,329	0.94
		<u>450,509,512</u>	<u>14.31</u>
タイ			
16,709,200	Airports of Thailand PCL	33,959,324	1.08
4,011,000	PTT Exploration & Production PCL	16,060,279	0.51
		<u>50,019,603</u>	<u>1.59</u>
アラブ首長国連邦			
12,812,641	Abu Dhabi Commercial Bank PJSC	27,888,312	0.89
324,290	ADNOC Logistics & Services	177,466	0.00
		<u>28,065,778</u>	<u>0.89</u>
米国			
10,436,100	Samsonite International SA	26,470,188	0.84
ウルグアイ			
35,613	MercadoLibre, Inc.	44,189,679	1.40
普通株式合計 (取得原価 米ドル 2,942,109,820)		3,040,792,066	96.61
不動産投資信託—1.06%			
メキシコ			
10,016,297	Prologis Property Mexico SA de CV	33,308,311	1.06
不動産投資信託合計 (取得原価 米ドル 23,693,238)		33,308,311	1.06

口数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
投資信託証券—0.81%			
アイルランド			
4,562,720	iShares MSCI Emerging Markets IMI ESG Screened UCITS ETF	25,460,890	0.81
投資信託証券合計(取得原価 米ドル 25,983,762)		25,460,890	0.81
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 2,991,786,820)		3,099,561,267	98.48
投資評価額(取得原価 米ドル 2,991,786,820)		3,099,561,267	98.48
その他資産・負債		47,688,300	1.52
投資主資本		3,147,249,567	100.00
投資合計			
投資合計(取得原価 米ドル 2,991,786,820)		3,099,561,267	98.48
その他資産・負債		47,688,300	1.52
投資主資本		3,147,249,567	100.00

〈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・エマージグ・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ I X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・エマージグ・マーケット・デット・ローカル・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、グローバル新成長国オープンが投資対象とする外国投資信託証券です。2024年1月5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5月31日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
当座借越支払利息	604
投資顧問報酬	2,642,893
保管費用	267,832
管理事務代行報酬	116,732
販売報酬およびサービシング報酬	13,722
名義書換事務代行報酬	43,087
年次税	52,708
監査報酬	10,301
管理会社報酬	48,802
取締役報酬	3,450
弁護士報酬	9,167
保険費用	5,719
印刷費用	12,122
出版費用	3,172
税務報告報酬	13,025
支払代理人報酬	8,152
規制報告報酬	27,226
その他費用	46,755
	<u>3,325,469</u>
費用合計	<u>3,325,469</u>

■保有有価証券明細（2023年5月31日現在）

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日／満期日	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						
債券－79.94%						
ブラジル						
49,324,000	Brazil Letras do Tesouro Nacional	BRL	13.699%	01/07/2023	9,615,163	1.03
273,627,000	Brazil Letras do Tesouro Nacional	BRL	13.192%	01/01/2024	50,181,208	5.35
146,643,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional-Series F	BRL	10.000%	01/01/2025	29,463,937	3.14
60,666,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional-Series F	BRL	10.000%	01/01/2027	12,124,746	1.29
93,479,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional-Series F	BRL	10.000%	01/01/2029	18,262,020	1.95
12,867,000	Brazil Notas do Tesouro Nacional-Series F	BRL	10.000%	01/01/2031	2,468,152	0.26
					<u>122,115,226</u>	<u>13.02</u>
チリ						
4,323,946,800	Bonos de la Tesoreria de la Republica	CLP	1.500%	01/03/2026	5,064,533	0.54
1,945,000,000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	CLP	4.500%	01/03/2026	2,307,963	0.25
755,000,000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	CLP	4.700%	01/09/2030	897,437	0.09
3,065,000,000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	CLP	6.000%	01/04/2033	3,996,303	0.42
6,540,000,000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	CLP	7.000%	01/05/2034	9,261,113	0.99
2,245,000,000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	CLP	5.000%	01/03/2035	2,721,778	0.29
					<u>24,249,127</u>	<u>2.58</u>

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
コロンビア						
22,410,000,000	Colombian TES-Series B	COP	6.250%	26/11/2025	4,638,944	0.49
37,932,300,000	Colombian TES-Series B	COP	7.500%	26/08/2026	7,918,283	0.84
33,828,100,000	Colombian TES-Series B	COP	6.000%	28/04/2028	6,364,164	0.68
13,123,000,000	Colombian TES-Series B	COP	7.000%	26/03/2031	2,382,571	0.25
2,530,500,000	Colombian TES-Series B	COP	7.000%	30/06/2032	446,298	0.05
78,201,500,000	Colombian TES-Series B	COP	9.250%	28/05/2042	14,972,475	1.60
					36,722,735	3.91
チェコ						
299,020,000	Czech Republic Government Bond-Series 100	CZK	0.250%	10/02/2027	11,346,980	1.21
177,510,000	Czech Republic Government Bond-Series 103	CZK	2.000%	13/10/2033	6,369,527	0.68
258,350,000	Czech Republic Government Bond-Series 120	CZK	1.250%	14/02/2025	10,857,322	1.16
76,100,000	Czech Republic Government Bond-Series 125	CZK	1.500%	24/04/2040	2,210,079	0.23
446,720,000	Czech Republic Government Bond-Series 130	CZK	0.050%	29/11/2029	15,001,608	1.60
103,920,000	Czech Republic Government Bond-Series 138	CZK	1.750%	23/06/2032	3,747,112	0.40
					49,532,628	5.28
ドミニカ共和国						
68,050,000	Dominican Republic Central Bank Notes	DOP	13.000%	30/01/2026	1,285,915	0.13
49,950,000	Dominican Republic International Bond	DOP	8.000%	15/01/2027	818,730	0.09
22,060,000	Dominican Republic International Bond	DOP	8.000%	12/02/2027	360,764	0.04
					2,465,409	0.26
ハンガリー						
1,448,670,000	Hungary Government Bond-Series 25/B	HUF	5.500%	24/06/2025	3,764,985	0.40
3,488,230,000	Hungary Government Bond-Series 26/D	HUF	2.750%	22/12/2026	8,047,593	0.86
231,390,000	Hungary Government Bond-Series 27/A	HUF	3.000%	27/10/2027	524,822	0.06
3,242,440,000	Hungary Government Bond-Series 30/A	HUF	3.000%	21/08/2030	6,939,250	0.74
3,263,750,000	Hungary Government Bond-Series 32/A	HUF	4.750%	24/11/2032	7,452,510	0.79
					26,729,160	2.85
インドネシア						
11,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR64	IDR	6.125%	15/05/2028	736	0.00
107,345,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR70	IDR	8.375%	15/03/2024	7,311,491	0.78
306,457,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR71	IDR	9.000%	15/03/2029	23,214,271	2.47
73,400,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR72	IDR	8.250%	15/05/2036	5,594,363	0.60
42,633,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR74	IDR	7.500%	15/08/2032	3,060,247	0.33
305,892,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR80	IDR	7.500%	15/06/2035	21,987,901	2.34
73,187,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR83	IDR	7.500%	15/04/2040	5,265,656	0.56
53,533,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR87	IDR	6.500%	15/02/2031	3,594,461	0.38
15,673,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR91	IDR	6.375%	15/04/2032	1,044,518	0.11
33,392,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR93	IDR	6.375%	15/07/2037	2,210,911	0.24
12,077,000,000	Indonesia Treasury Bond-Series FR97	IDR	7.125%	15/06/2043	846,357	0.09
					74,130,912	7.90
メキシコ						
3,197,200	Mexican Bonos-Series M	MXN	7.750%	29/05/2031	169,790	0.02
114,906,000	Mexican Bonos-Series M	MXN	7.750%	13/11/2042	5,716,855	0.61
143,331,800	Mexican Bonos-Series M 20	MXN	8.500%	31/05/2029	7,986,837	0.85
218,272,100	Mexican Bonos-Series M 30	MXN	10.000%	20/11/2036	13,501,456	1.44
398,640,400	Mexican Bonos-Series M 30	MXN	8.500%	18/11/2038	21,628,097	2.30
					49,003,035	5.22
パナマ						
860,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA	USD	2.375%	14/09/2025	808,185	0.09

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ペルー						
59,380,000	Peru Government Bond	PEN	5.940%	12/02/2029	15,515,916	1.65
11,150,000	Peru Government Bond	PEN	5.400%	12/08/2034	2,632,335	0.28
24,345,000	Peru Government Bond	PEN	5.350%	12/08/2040	5,432,261	0.58
15,026,000	Peruvian Government International Bond	PEN	6.350%	12/08/2028	4,036,018	0.43
9,857,000	Peruvian Government International Bond	PEN	6.900%	12/08/2037	2,612,291	0.28
					30,228,821	3.22
フィリピン						
35,890,000	Philippine Government Bond-Series 1063	PHP	6.250%	22/03/2028	652,949	0.07
76,580,000	Philippine Government Bond-Series 1064	PHP	6.875%	10/01/2029	1,437,487	0.15
					2,090,436	0.22
ポーランド						
40,900,000	Poland Government Bond-Series 1026	PLN	0.250%	25/10/2026	8,016,627	0.86
10,425,000	Poland Government Bond-Series 1029	PLN	2.750%	25/10/2029	2,056,363	0.22
52,175,000	Poland Government Bond-Series 1030	PLN	1.250%	25/10/2030	8,951,690	0.96
85,125,000	Poland Government Bond-Series 425	PLN	0.750%	25/04/2025	18,238,238	1.94
36,815,000	Poland Government Bond-Series 428	PLN	2.750%	25/04/2028	7,535,532	0.80
25,145,000	Poland Government Bond-Series 432	PLN	1.750%	25/04/2032	4,233,053	0.45
14,760,000	Poland Government Bond-Series 726	PLN	2.500%	25/07/2026	3,146,315	0.34
58,630,000	Poland Government Bond-Series 727	PLN	2.500%	25/07/2027	12,136,979	1.29
					64,314,797	6.86
ルーマニア						
52,875,000	Romania Government Bond-Series 10Y	RON	4.750%	24/02/2025	11,061,532	1.18
34,900,000	Romania Government Bond-Series 10Y	RON	5.000%	12/02/2029	6,898,610	0.74
16,925,000	Romania Government Bond-Series 10Y	RON	4.150%	24/10/2030	3,068,455	0.33
42,305,000	Romania Government Bond-Series 10Y	RON	6.700%	25/02/2032	8,933,979	0.95
28,250,000	Romania Government Bond-Series 15YR	RON	5.800%	26/07/2027	5,890,644	0.63
25,825,000	Romania Government Bond-Series 5Y	RON	4.500%	17/06/2024	5,450,234	0.58
23,625,000	Romania Government Bond-Series 5Y	RON	4.250%	28/04/2036	3,878,877	0.41
					45,182,331	4.82
ロシア						
977,300,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6222	RUB	7.100%	16/10/2024	722,354	0.08
306,100,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6224	RUB	6.900%	23/05/2029	226,249	0.02
447,795,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6228	RUB	7.650%	10/04/2030	330,980	0.04
417,575,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6229	RUB	7.150%	12/11/2025	308,643	0.03
4,245,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6232	RUB	6.000%	06/10/2027	3,138	0.00
497,220,000	Russian Federal Bond - OFZ Bonds-Series 6239	RUB	6.900%	23/07/2031	367,511	0.04
					1,958,875	0.21
セルビア						
233,000,000	Serbia Treasury Bonds-Series 12.5	RSD	4.500%	20/08/2032	1,858,665	0.20
南アフリカ						
224,325,000	South Africa Government Bond-Series 2030	ZAR	8.000%	31/01/2030	9,667,592	1.03
67,575,000	South Africa Government Bond-Series 2032	ZAR	8.250%	31/03/2032	2,756,549	0.29
118,794,000	South Africa Government Bond-Series 2035	ZAR	8.875%	28/02/2035	4,719,052	0.50
356,560,000	South Africa Government Bond-Series 2037	ZAR	8.500%	31/01/2037	13,256,991	1.41
232,647,300	South Africa Government Bond-Series 2040	ZAR	9.000%	31/01/2040	8,760,922	0.94
135,540,000	South Africa Government Bond-Series 2044	ZAR	8.750%	31/01/2044	4,873,127	0.52
228,210,000	South Africa Government Bond-Series 2048	ZAR	8.750%	28/02/2048	8,124,854	0.87
242,990,000	South Africa Government Bond-Series R186	ZAR	10.500%	21/12/2026	12,564,212	1.34
260,670,000	South Africa Government Bond-Series R213	ZAR	7.000%	28/02/2031	10,122,616	1.08
					74,845,915	7.98

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
債券						
国際機関債						
400,000	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3.500%	25/06/2024	374,792	0.04
12,400,000	Egypt Government International Bond-European Investment Bank	EGP	8.000%	16/08/2023	377,229	0.04
56,600,000	Egypt Government International Bond-European Investment Bank	EGP	8.500%	24/08/2023	1,715,420	0.18
111,229,000,000	Indonesia Treasury Bond-European Bank for Reconstruction & Development	IDR	5.200%	28/05/2024	7,353,060	0.78
124,580,000,000	Indonesia Treasury Bond-European Bank for Reconstruction & Development	IDR	5.600%	30/01/2025	8,223,942	0.88
106,890,000,000	Indonesia Treasury Bond-Inter-American Development Bank	IDR	5.100%	17/11/2026	6,946,709	0.74
31,000,000,000	Indonesia Treasury Bond-International Bank for Reconstruction & Development	IDR	4.600%	09/02/2026	1,996,263	0.21
75,230,000,000	Indonesia Treasury Bond-International Bank for Reconstruction & Development	IDR	5.000%	01/12/2026	4,834,494	0.52
					31,821,909	3.39
タイ						
283,800,000	Thailand Government Bond	THB	2.875%	17/12/2028	8,422,764	0.90
219,210,000	Thailand Government Bond	THB	3.650%	20/06/2031	6,869,997	0.73
373,810,000	Thailand Government Bond	THB	3.775%	25/06/2032	11,869,542	1.27
422,680,000	Thailand Government Bond	THB	1.585%	17/12/2035	10,726,416	1.14
181,970,000	Thailand Government Bond	THB	3.400%	17/06/2036	5,570,544	0.60
346,150,000	Thailand Government Bond	THB	3.300%	17/06/2038	10,441,073	1.11
42,920,000	Thailand Government Bond	THB	3.450%	17/06/2043	1,303,479	0.14
19,670,000	Thailand Government Bond	THB	3.600%	17/06/2067	571,574	0.06
495,118,788	Thailand Government Bond-Series ILB	THB	1.250%	12/03/2028	13,698,441	1.46
					69,473,830	7.41
米国						
4,360,000,000	Citigroup, Inc.	COP	11.000%	25/07/2024	989,640	0.11
16,156,000,000	Indonesia Treasury Bond-JPMorgan Chase Bank NA	IDR	10.500%	19/08/2030	1,329,987	0.14
37,400,000	United States Treasury Bill	USD	5.487%	09/11/2023	36,513,237	3.89
					38,832,864	4.14
ウルグアイ						
33,950,531	Uruguay Government International Bond	UYU	3.875%	02/07/2040	937,384	0.10
ウズベキスタン						
390,000	National Bank of Uzbekistan	USD	4.850%	21/10/2025	361,455	0.04
ベネズエラ						
74,110,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	6.000%	28/10/2022	2,223,300	0.24
20,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	6.000%	15/11/2026	500	0.00
					2,223,800	0.24
債券合計 (取得原価 米ドル 882,143,268)					749,887,499	79.94
口数						
投資信託証券—9.54%					評価額	投資主資本割合 (%)
アイルランド					(米ドル)	
89,522,003	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (X Distribution Class)				89,522,003	9.54
投資信託証券合計 (取得原価 米ドル 89,522,003)					89,522,003	9.54
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 971,665,271)					839,409,502	89.48

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
その他の規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券						
債券—0.69%						
米国						
256,925,000	Egypt Government International Bond-JPMorgan Chase Bank NA-Series 144	EGP	0.000%	09/05/2024	5,851,322	0.63
7,763,000,000	Indonesia Treasury Bond-JPMorgan Chase Bank NA	IDR	8.250%	19/05/2036	591,676	0.06
					6,442,998	0.69
債券合計 (取得原価 米ドル 6,411,361)					6,442,998	0.69
その他の規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券合計 (取得原価 米ドル 6,411,361)					6,442,998	0.69
定期預金—6.82%						
米国						
63,960,915	Rabobank Nederland USD Time Deposit	USD	5.030%	01/06/2023	63,960,915	6.82
定期預金合計 (取得原価 米ドル 63,960,915)					63,960,915	6.82
デリバティブ取引を除く評価額 (取得原価 米ドル 1,042,037,547)					909,813,415	96.99

先物取引—0.04%

枚数	銘柄名称		評価額 (米ドル)	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
米ドル					
63	US Treasury Long Bond Futures 20/09/2023	買建	8,064,000	109,047	0.01
130	US Treasury Notes 10YR Futures 20/09/2023	買建	14,874,843	115,781	0.01
159	US Treasury Notes 5YR Futures 29/09/2023	買建	17,342,180	90,680	0.01
42	US Treasury Ultra Long Notes 10YR Futures 20/09/2023	買建	5,052,469	31,281	0.01
			45,333,492	346,789	0.04
先物取引未実現利益				346,789	0.04

枚数	銘柄名称		評価額 (米ドル)	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合(%)
米ドル					
12	US Treasury Notes 2YR Futures 29/09/2023	買建	2,471,063	(2,699)	(0.00)
(5)	US Treasury Ultra Long Bond Futures 20/09/2023	売建	(681,250)	(8,528)	(0.00)
			1,789,813	(11,227)	(0.00)
先物取引未実現損失				(11,227)	(0.00)

外国為替予約取引—(0.64%)

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(%)
EUR	769,628	SEK	8,746,603	02/06/2023	17,081	0.00
EUR	20,418,537	NOK	239,590,362	05/06/2023	328,104	0.04
USD	28,259,756	EUR	26,070,468	05/06/2023	418,339	0.04
USD	798,167	AUD	1,221,462	06/06/2023	6,668	0.00
USD	14,309,021	NZD	23,227,675	07/06/2023	379,927	0.03
PEN	548,691	USD	144,127	09/06/2023	5,039	0.00
USD	15,538,227	EUR	14,418,214	09/06/2023	137,142	0.02
USD	3,633,042	NOK	39,888,984	09/06/2023	56,588	0.01
USD	5,669,553	TWD	171,106,039	12/06/2023	102,797	0.01
USD	7,314,837	ZAR	141,603,506	12/06/2023	127,487	0.02
USD	1,410,256	KRW	1,847,393,052	15/06/2023	14,907	0.00
USD	5,949,071	NOK	65,340,445	15/06/2023	88,894	0.00
USD	12,390,417	NZD	20,170,831	15/06/2023	294,874	0.03
USD	14,931,796	ZAR	291,559,041	15/06/2023	137,565	0.01
USD	5,480,375	AUD	8,301,281	16/06/2023	99,163	0.01
GBP	5,683,569	USD	7,021,487	20/06/2023	16,940	0.00

外国為替予約取引

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(%)
USD	11,250,237	JPY	1,502,991,849	20/06/2023	497,605	0.06
USD	20,032,786	NOK	212,186,640	20/06/2023	997,729	0.10
AUD	3,383,863	JPY	297,133,824	21/06/2023	67,903	0.01
AUD	19,999,373	NZD	21,501,032	21/06/2023	73,934	0.00
CHF	21,214,007	EUR	21,513,652	21/06/2023	298,565	0.02
EUR	1,707,642	AUD	2,727,437	21/06/2023	56,991	0.01
EUR	3,456,938	CNH	25,797,193	21/06/2023	70,709	0.00
EUR	3,413,132	JPY	489,457,841	21/06/2023	146,224	0.02
EUR	3,598,481	NOK	41,751,367	21/06/2023	100,895	0.01
EUR	14,720,702	SEK	165,370,665	21/06/2023	505,740	0.07
GBP	1,693,236	EUR	1,953,693	21/06/2023	8,542	0.00
HUF	701,863,031	EUR	1,793,624	21/06/2023	91,344	0.01
MXN	487,459,441	USD	26,804,236	21/06/2023	664,923	0.08
NZD	19,565,111	AUD	18,056,928	21/06/2023	24,616	0.00
USD	16,927,465	AUD	25,331,978	21/06/2023	503,115	0.08
USD	24,017,565	CAD	32,528,669	21/06/2023	123,494	0.00
USD	13,435,640	CHF	12,202,245	21/06/2023	36,216	0.01
USD	25,686,761	CNH	177,212,710	21/06/2023	788,098	0.09
USD	8,091,910	CZK	174,566,349	21/06/2023	253,923	0.03
USD	39,633,661	EUR	36,277,945	21/06/2023	854,759	0.12
USD	7,173,364	GBP	5,782,718	21/06/2023	11,991	0.00
USD	2,786,247	HUF	959,082,651	21/06/2023	41,509	0.00
USD	5,772,360	ILS	20,947,815	21/06/2023	140,110	0.01
USD	11,348,736	JPY	1,507,652,606	21/06/2023	561,068	0.07
USD	2,695,277	NOK	28,486,993	21/06/2023	139,610	0.01
USD	28,309,338	NZD	46,192,326	21/06/2023	610,427	0.07
USD	14,401,958	RON	66,563,989	21/06/2023	106,119	0.01
USD	12,965,178	SEK	134,941,580	21/06/2023	537,752	0.05
USD	9,102,229	SGD	12,115,198	21/06/2023	148,355	0.01
USD	10,494,548	THB	355,271,183	21/06/2023	266,280	0.03
USD	7,480,068	TRY	161,501,603	21/06/2023	220,345	0.03
USD	24,131,657	ZAR	454,940,583	21/06/2023	1,060,841	0.12
USD	2,552,027	KRW	3,314,270,529	22/06/2023	47,996	0.01
AUD	15,198,848	NZD	16,362,151	26/06/2023	45,014	0.00
EUR	2,752,849	CHF	2,667,112	26/06/2023	12,990	0.00
EUR	13,500,144	SEK	154,778,353	26/06/2023	176,879	0.01
USD	3,801,967	CHF	3,434,516	26/06/2023	28,250	0.00
USD	5,499,512	EUR	5,073,178	26/06/2023	74,967	0.01
USD	1,498,944	NZD	2,470,365	26/06/2023	17,631	0.00
USD	864,604	SEK	9,230,256	26/06/2023	14,307	0.00
USD	6,900,613	SGD	9,293,241	26/06/2023	31,092	0.00
USD	6,404,187	CLP	5,152,766,142	29/06/2023	68,481	0.01
USD	863,375	SEK	9,280,219	30/06/2023	8,283	0.00
USD	1,849,573	MYR	8,486,599	03/07/2023	7,663	0.00
USD	27,141,634	BRL	136,991,124	05/07/2023	292,159	0.03
COP	21,893,550,878	USD	4,769,533	14/07/2023	160,032	0.01
USD	1,387,967	PHP	77,487,406	10/08/2023	15,212	0.00
USD	864,624	ZAR	16,739,987	16/08/2023	20,490	0.00
USD	1,445,394	SEK	15,486,396	17/08/2023	14,922	0.00
USD	5,582,715	JPY	750,316,877	22/11/2023	83,324	0.01
MXN	655,973,605	USD	31,224,053	20/12/2023	4,482,170	0.47
PLN	55,164,304	USD	11,783,700	20/12/2023	1,066,540	0.11
外国為替予約取引未実現利益					18,909,649	2.02

外国為替予約取引

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(%)
GBP	3,139,838	USD	3,890,253	01/06/2023	(3,449)	(0.00)
USD	7,105,321	GBP	5,747,364	01/06/2023	(9,339)	(0.00)
BRL	158,423,121	USD	31,635,084	02/06/2023	(419,628)	(0.04)
SEK	8,746,603	EUR	781,527	02/06/2023	(29,787)	(0.00)
USD	31,109,171	BRL	157,890,677	02/06/2023	(1,372)	(0.00)
EUR	18,189,261	USD	19,732,779	05/06/2023	(307,935)	(0.04)
NOK	110,606,583	EUR	9,326,352	05/06/2023	(44,846)	(0.00)
NZD	11,422,618	USD	7,034,663	07/06/2023	(184,787)	(0.02)
EUR	17,425,939	USD	18,857,677	09/06/2023	(243,832)	(0.03)
NOK	21,328,483	USD	1,970,463	09/06/2023	(58,148)	(0.01)
USD	8,247,604	PEN	30,944,390	09/06/2023	(164,855)	(0.02)
TWD	171,154,198	USD	5,657,990	12/06/2023	(89,668)	(0.01)
ZAR	181,543,069	USD	9,432,140	12/06/2023	(217,583)	(0.02)
IDR	164,168,793,435	USD	11,104,359	15/06/2023	(155,222)	(0.01)
NOK	29,637,824	USD	2,705,168	15/06/2023	(47,046)	(0.01)
NZD	3,816,911	AUD	3,602,409	15/06/2023	(46,301)	(0.01)
NZD	17,052,427	USD	10,691,876	15/06/2023	(466,301)	(0.04)
USD	23,526,332	IDR	357,196,254,905	15/06/2023	(296,653)	(0.04)
ZAR	241,870,398	USD	12,522,301	15/06/2023	(249,361)	(0.02)
AUD	15,106,819	USD	9,997,661	16/06/2023	(204,835)	(0.03)
JPY	1,936,130,442	USD	14,644,413	20/06/2023	(793,041)	(0.09)
NOK	363,528,583	USD	34,295,546	20/06/2023	(1,683,749)	(0.18)
USD	8,634,766	GBP	6,972,782	20/06/2023	(199)	(0.00)
AUD	25,055,639	USD	16,846,190	21/06/2023	(601,005)	(0.08)
CAD	37,848,014	USD	27,841,782	21/06/2023	(40,364)	(0.00)
CHF	13,563,179	USD	15,225,447	21/06/2023	(331,565)	(0.04)
CNH	749,839,226	USD	108,860,380	21/06/2023	(3,506,795)	(0.39)
CNY	31,207,386	USD	4,546,933	21/06/2023	(151,527)	(0.02)
CZK	118,412,219	EUR	5,014,002	21/06/2023	(42,982)	(0.00)
CZK	188,926,102	USD	8,705,725	21/06/2023	(222,989)	(0.03)
EUR	3,751,000	CAD	5,473,966	21/06/2023	(11,335)	(0.00)
EUR	11,156,737	CHF	10,969,251	21/06/2023	(119,590)	(0.00)
EUR	3,926,230	CZK	93,788,163	21/06/2023	(14,167)	(0.00)
EUR	5,332,406	GBP	4,700,874	21/06/2023	(121,592)	(0.01)
EUR	3,437,709	PLN	15,918,371	21/06/2023	(68,280)	(0.01)
EUR	44,210,547	USD	47,826,060	21/06/2023	(567,694)	(0.06)
GBP	3,008,965	CAD	5,108,169	21/06/2023	(25,897)	(0.00)
GBP	6,044,563	USD	7,510,994	21/06/2023	(25,351)	(0.00)
HUF	1,178,261,278	USD	3,379,591	21/06/2023	(7,598)	(0.00)
ILS	19,817,015	USD	5,465,696	21/06/2023	(137,486)	(0.01)
JPY	735,577,298	EUR	5,116,152	21/06/2023	(205,597)	(0.02)
JPY	1,508,901,023	USD	11,321,281	21/06/2023	(524,681)	(0.06)
KRW	3,872,027,731	USD	2,986,447	21/06/2023	(61,137)	(0.01)
NOK	48,507,686	USD	4,658,434	21/06/2023	(306,642)	(0.03)
NZD	5,903,247	EUR	3,355,731	21/06/2023	(47,229)	(0.01)
NZD	24,302,599	USD	15,247,045	21/06/2023	(674,160)	(0.07)
PLN	54,418,722	USD	13,073,055	21/06/2023	(277,256)	(0.01)
RON	11,638,088	USD	2,595,697	21/06/2023	(96,204)	(0.01)
SEK	177,734,871	EUR	15,749,397	21/06/2023	(466,673)	(0.06)
SEK	74,562,332	USD	7,205,386	21/06/2023	(338,578)	(0.04)
SGD	23,081,564	USD	17,205,244	21/06/2023	(146,554)	(0.01)

外国為替予約取引

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(%)
THB	1,159,695,878	USD	34,057,090	21/06/2023	(669,413)	(0.08)
TRY	266,997,012	USD	12,894,096	21/06/2023	(892,208)	(0.10)
USD	21,598,546	MXN	393,118,337	21/06/2023	(554,332)	(0.06)
USD	16,893,566	PLN	72,113,900	21/06/2023	(63,005)	(0.01)
ZAR	433,280,597	USD	23,045,602	21/06/2023	(1,073,201)	(0.12)
NZD	2,595,285	AUD	2,450,000	22/06/2023	(32,315)	(0.00)
CHF	9,310,703	EUR	9,604,032	26/06/2023	(38,960)	(0.00)
CZK	154,982,131	EUR	6,521,920	26/06/2023	(16,378)	(0.00)
EUR	8,715,898	CZK	207,879,396	26/06/2023	(13,137)	(0.00)
EUR	4,181,189	USD	4,490,299	26/06/2023	(19,520)	(0.00)
NZD	3,243,068	AUD	3,055,693	26/06/2023	(36,935)	(0.00)
NZD	39,121,466	USD	23,869,953	26/06/2023	(411,423)	(0.04)
SEK	30,758,700	EUR	2,695,497	26/06/2023	(48,675)	(0.01)
SEK	32,297,032	USD	3,026,115	26/06/2023	(50,890)	(0.00)
SGD	4,000,500	USD	2,962,824	26/06/2023	(5,673)	(0.00)
CLP	1,496,641,231	USD	1,886,376	29/06/2023	(46,145)	(0.01)
NOK	42,042,883	USD	3,828,574	30/06/2023	(55,079)	(0.00)
SEK	32,007,713	USD	2,976,079	30/06/2023	(26,846)	(0.00)
USD	702,288	PLN	3,038,490	30/06/2023	(11,807)	(0.00)
ZAR	36,310,607	USD	1,850,128	30/06/2023	(10,391)	(0.00)
MYR	442,477,901	USD	100,988,155	03/07/2023	(4,953,885)	(0.53)
NOK	40,171,514	USD	3,608,736	03/07/2023	(2,667)	(0.00)
USD	2,249,888	COP	10,503,830,413	14/07/2023	(115,161)	(0.02)
MXN	142,801,601	USD	7,967,366	14/08/2023	(5,130)	(0.00)
USD	1,704,847	MXN	30,799,745	14/08/2023	(12,465)	(0.00)
ZAR	56,985,911	USD	2,929,946	16/08/2023	(56,361)	(0.01)
AUD	70,913	USD	46,535	30/08/2023	(439)	(0.00)
TRY	87,735,176	USD	4,067,067	20/09/2023	(656,884)	(0.07)
外国為替予約取引未実現損失					(24,738,190)	(2.66)

特定クラス投資信託証券の外国為替予約取引ー(0.47%)

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(%)
USD	1,487,011	EUR	1,380,000	26/06/2023	11,432	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益					11,432	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	138,773,447	USD	152,754,595	26/06/2023	(4,369,716)	(0.47)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失					(4,369,716)	(0.47)

グローバル新成長国オープン

オプション-0.08%

想定元本	銘柄名称	償還年月日／満期日	権利行使価格	未実現 利益／損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
買建オプション						
オーストラリアドル						
24,336,000	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.65	50,889	117,025	0.01
24,490,000	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.66	201,195	301,316	0.03
				252,084	418,341	0.04
ユーロ						
6,832,000	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.03	(39,250)	2,553	0.00
13,684,000	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.07	(91,962)	2,411	0.00
22,563,000	Put EUR / Call USD	Expires 01/06/2023	Strike 1.09	287,149	362,989	0.04
30,236,000	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	89,645	176,402	0.02
				245,582	544,355	0.06
英ポンド						
13,058,000	Put GBP / Call USD	Expires 15/06/2023	Strike 1.23	(29,199)	45,212	0.01
ニュージーランドドル						
25,971,000	Put NZD / Call USD	Expires 13/06/2023	Strike 0.62	426,655	526,662	0.06
25,748,000	Put NZD / Call USD	Expires 22/06/2023	Strike 0.60	99,990	182,514	0.02
25,748,000	Put NZD / Call USD	Expires 22/06/2023	Strike 0.61	126,380	234,210	0.02
				653,025	943,386	0.10
米ドル						
7,100,000	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 2.40	(230,719)	7,131	0.00
4,345,000	Call USD / Put JPY	Expires 16/06/2023	Strike 136.70	71,054	96,850	0.01
7,857,000	Call USD / Put MXN	Expires 10/08/2023	Strike 18.17	(17,207)	116,551	0.01
15,715,000	Call USD / Put MXN	Expires 10/08/2023	Strike 18.18	(36,192)	230,178	0.02
8,214,000	Call USD / Put NOK	Expires 07/06/2023	Strike 11.00	82,436	124,163	0.01
8,063,000	Call USD / Put NOK	Expires 13/06/2023	Strike 11.08	40,879	99,900	0.01
4,707,000	Call USD / Put NOK	Expires 16/06/2023	Strike 11.00	42,113	85,559	0.01
8,073,000	Call USD / Put NOK	Expires 28/06/2023	Strike 11.20	31,622	93,098	0.01
7,988,000	Call USD / Put NOK	Expires 29/06/2023	Strike 11.37	7,581	56,196	0.01
8,057,000	Call USD / Put SEK	Expires 21/06/2023	Strike 10.83	39,826	86,597	0.01
8,073,000	Call USD / Put SEK	Expires 28/06/2023	Strike 10.94	13,280	66,481	0.01
15,715,000	Call USD / Put ZAR	Expires 08/06/2023	Strike 19.35	198,449	324,970	0.03
16,504,000	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	187,535	376,341	0.04
12,110,000	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 20.10	(18,516)	75,082	0.01
8,015,000	Call USD / Put ZAR	Expires 28/06/2023	Strike 20.21	(8,696)	79,228	0.01
7,220,000	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 2.80	101,307	361,981	0.04
7,220,000	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 2.96	6,591	287,666	0.03
16,270,000	Put USD / Call JPY	Expires 20/11/2023	Strike 132.00	(55,465)	282,561	0.03
				455,878	2,850,533	0.30
買建オプション合計 (取得原価 米ドル 3,224,457)					4,801,827	0.51
売建オプション						
オーストラリアドル						
(4,539,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 06/06/2023	Strike 1.07	(7,357)	(29,811)	(0.00)
(4,651,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 08/06/2023	Strike 1.07	(12,453)	(34,410)	(0.01)
(4,900,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 20/06/2023	Strike 1.06	(29,043)	(52,672)	(0.01)
(4,801,157)	Call AUD / Put NZD	Expires 28/06/2023	Strike 1.08	(5,431)	(27,483)	(0.00)
(4,539,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 06/06/2023	Strike 1.07	20,293	(2,161)	(0.00)
(4,651,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 08/06/2023	Strike 1.07	19,260	(2,697)	(0.00)
(4,900,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 20/06/2023	Strike 1.06	20,136	(3,492)	(0.00)
(4,801,156)	Put AUD / Call NZD	Expires 28/06/2023	Strike 1.08	8,598	(15,550)	(0.00)
(24,490,000)	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.66	(125,307)	(301,316)	(0.03)
				(111,304)	(469,592)	(0.05)

オプション

想定元本	銘柄名称	償還年月日／満期日	権利行使価格	未実現 利益／損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
売建オプション						
ユーロ						
(2,750,450)	Call EUR / Put CHF	Expires 08/06/2023	Strike 0.98	14,448	(3,368)	(0.00)
(3,017,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 16/06/2023	Strike 0.97	8,014	(12,306)	(0.00)
(2,989,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 22/06/2023	Strike 0.97	(3,714)	(23,323)	(0.00)
(2,988,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 28/06/2023	Strike 0.97	(4,878)	(24,834)	(0.00)
(3,007,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 14/06/2023	Strike 23.61	(9,328)	(27,192)	(0.00)
(3,007,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 20/06/2023	Strike 23.73	(1,094)	(18,905)	(0.00)
(2,988,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 28/06/2023	Strike 23.66	(12,092)	(28,886)	(0.01)
(6,832,000)	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.03	3,605	(2,553)	(0.00)
(13,684,000)	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.07	12,639	(2,411)	(0.00)
(2,728,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 31/05/2023	Strike 11.39	(30,428)	(54,234)	(0.01)
(2,868,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 08/06/2023	Strike 11.16	(94,919)	(117,727)	(0.01)
(3,017,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 16/06/2023	Strike 11.30	(59,105)	(87,161)	(0.01)
(2,989,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 21/06/2023	Strike 11.36	(47,027)	(70,191)	(0.01)
(2,988,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 28/06/2023	Strike 11.55	(6,371)	(33,439)	(0.01)
(2,750,449)	Put EUR / Call CHF	Expires 08/06/2023	Strike 0.98	616	(17,201)	(0.00)
(3,017,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 16/06/2023	Strike 0.97	4,664	(15,656)	(0.00)
(2,989,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 22/06/2023	Strike 0.97	8,277	(11,333)	(0.00)
(2,988,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 28/06/2023	Strike 0.97	6,409	(13,547)	(0.00)
(3,007,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 14/06/2023	Strike 23.61	15,758	(2,106)	(0.00)
(3,007,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 20/06/2023	Strike 23.73	9,768	(8,043)	(0.00)
(2,988,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 28/06/2023	Strike 23.66	10,433	(6,362)	(0.00)
(2,728,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 31/05/2023	Strike 11.39	23,806	0	(0.00)
(2,868,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 08/06/2023	Strike 11.16	22,805	(3)	(0.00)
(3,017,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 16/06/2023	Strike 11.30	22,401	(689)	(0.00)
(2,989,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 21/06/2023	Strike 11.36	20,782	(2,381)	(0.00)
(2,988,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 28/06/2023	Strike 11.55	9,282	(17,787)	(0.00)
(22,563,000)	Put EUR / Call USD	Expires 01/06/2023	Strike 1.09	(207,883)	(362,989)	(0.04)
(15,118,000)	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	(31,800)	(88,201)	(0.01)
(15,118,000)	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	(40,514)	(88,201)	(0.01)
				(355,446)	(1,141,029)	(0.12)
ニュージーランドドル						
(25,971,000)	Put NZD / Call USD	Expires 13/06/2023	Strike 0.62	(259,798)	(526,662)	(0.06)
米ドル						
(7,100,000)	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 1.75	87,835	(915)	(0.00)
(7,100,000)	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 2.08	146,548	(2,553)	(0.00)
(4,345,000)	Call USD / Put JPY	Expires 16/06/2023	Strike 136.70	(53,865)	(96,850)	(0.01)
(8,214,000)	Call USD / Put NOK	Expires 07/06/2023	Strike 11.00	(54,311)	(124,163)	(0.01)
(8,063,000)	Call USD / Put NOK	Expires 13/06/2023	Strike 11.08	(17,069)	(99,901)	(0.01)
(4,707,000)	Call USD / Put NOK	Expires 16/06/2023	Strike 11.00	5,027	(85,559)	(0.01)
(3,301,000)	Call USD / Put SGD	Expires 13/06/2023	Strike 1.33	(47,973)	(64,330)	(0.01)
(3,254,000)	Call USD / Put SGD	Expires 20/06/2023	Strike 1.34	(13,006)	(30,529)	(0.00)
(3,206,000)	Call USD / Put SGD	Expires 27/06/2023	Strike 1.35	(3,110)	(21,538)	(0.00)
(15,715,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 08/06/2023	Strike 19.35	(109,919)	(324,971)	(0.04)
(8,252,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	6,956	(188,170)	(0.02)
(8,252,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	(9,061)	(188,170)	(0.02)
(4,104,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 14/08/2023	Strike 19.38	(25,313)	(164,070)	(0.02)
(7,220,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 3.23	(13,546)	(174,484)	(0.02)
(7,220,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 3.66	36,583	(63,153)	(0.01)

オプション

想定元本	銘柄名称	償還年月日／満期日	権利行使価格	未実現 利益／損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
売建オプション						
米ドル						
(7,220,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 3.41	47,114	(125,157)	(0.01)
(7,220,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 3.85	66,565	(42,238)	(0.00)
(3,301,000)	Put USD / Call SGD	Expires 13/06/2023	Strike 1.33	16,208	(149)	(0.00)
(3,254,000)	Put USD / Call SGD	Expires 20/06/2023	Strike 1.34	12,268	(5,255)	(0.00)
(3,206,000)	Put USD / Call SGD	Expires 27/06/2023	Strike 1.35	3,584	(11,798)	(0.00)
(4,104,000)	Put USD / Call ZAR	Expires 14/08/2023	Strike 19.38	51,004	(74,044)	(0.01)
				132,519	(1,887,997)	(0.20)
売建オプション合計(取得原価 米ドル (3,431,252))					(4,025,280)	(0.43)
オプション合計(取得原価 米ドル (206,795))					776,547	0.08

スワップ契約-0.14%

現地通貨建 想定元本額	支払	受取	通貨	償還年月日／満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
金利スワップ						
16,325,000	Fixed 11.814%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2024	45,670	0.01
16,425,000	Fixed 11.905%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2024	43,960	0.01
22,000,000	Fixed 12.185%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2024	35,412	0.00
231,330,000	Fixed 12.795%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2024	295,706	0.03
116,310,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 13.950%	BRL	02/01/2024	115,610	0.01
150,360,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.060%	BRL	02/01/2025	25,313	0.00
152,590,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.064%	BRL	02/01/2025	170,338	0.02
14,750,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 10.850%	BRL	02/01/2026	4,078	0.00
124,100,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.915%	BRL	02/01/2026	629,768	0.07
19,525,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.500%	BRL	04/01/2027	148,375	0.02
51,900,000	Floating (BRL 1 month CETIP)	Fixed 11.230%	BRL	04/01/2027	413,626	0.04
24,235,180,000	Fixed 7.000%	Floating (CLP 6 month CLICP)	CLP	22/06/2025	112,391	0.01
4,298,210,000	Fixed 5.348%	Floating (CLP 6 month CLICP)	CLP	22/06/2028	39,334	0.00
255,870,000	Floating (CNY 3 month CNRR)	Fixed 2.500%	CNY	20/09/2025	29,070	0.00
592,410,000	Floating (CNY 1 month CNRR)	Fixed 3.000%	CNY	21/06/2028	1,787,274	0.19
913,895,000	Floating (CZK 6 month PRIBOR)	Fixed 4.500%	CZK	21/06/2028	133,266	0.02
119,840,000	Floating (CZK 6 month PRIBOR)	Fixed 4.750%	CZK	21/06/2033	181,932	0.02
65,988,870,000	Floating (KRW 3 month KSDA)	Fixed 3.500%	KRW	21/06/2028	97,798	0.01
17,819,240,000	Floating (KRW 3 month KSDA)	Fixed 3.500%	KRW	21/06/2033	195,806	0.02
1,410,220,000	Floating (MXN 1 month TIIE)	Fixed 10.500%	MXN	18/06/2025	420,629	0.05
278,595,000	Floating (MXN 1 month TIIE)	Fixed 8.700%	MXN	15/12/2027	106,127	0.01
202,350,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.605%	MYR	06/03/2024	35,143	0.00
23,990,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.500%	MYR	21/06/2028	25,901	0.00
15,470,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.680%	MYR	12/07/2032	852	0.00
15,460,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.735%	MYR	14/07/2032	15,749	0.00
26,080,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.750%	MYR	21/12/2032	81,536	0.01
19,340,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.750%	MYR	21/06/2033	16,348	0.00
17,420,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.750%	MYR	21/06/2033	13,810	0.00
62,700,000	Floating (PLN 6 month WIBOR)	Fixed 6.000%	PLN	21/06/2033	513,700	0.06
37,070,000	Fixed 3.000%	Floating (SGD 6 month IBOR)	SGD	21/06/2028	292,015	0.03
317,500,000	Floating (THB 1 month THOR)	Fixed 2.250%	THB	20/09/2025	11,699	0.00
109,600,000	Floating (THB 3 month THOR)	Fixed 2.250%	THB	21/12/2027	2,652	0.00
420,560,000	Floating (THB 1 month THOR)	Fixed 2.500%	THB	20/09/2028	89,038	0.01
567,220,000	Fixed 1.250%	Floating (TWD 3 month TAIBOR)	TWD	20/09/2028	117,331	0.01

スワップ契約							
現地通貨建 想定元本額	支払	受取	通貨	償還年月日/満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合 (%)	
金利スワップ							
105,500,000	Floating (USD 1 month SOFR)	Fixed 3.350%	USD	06/10/2027	48,429	0.01	
8,090,000	Fixed 3.000%	Floating (USD 1 month SOFR)	USD	21/06/2033	83,850	0.01	
23,960,000	Fixed 3.240%	Floating (USD 1 month SOFR)	USD	06/10/2035	83,551	0.01	
489,510,000	Fixed 8.250%	Floating (ZAR 3 month JIBAR)	ZAR	15/03/2025	294,870	0.03	
金利スワップ未実現利益					6,757,957	0.72	
スワップ契約未実現利益合計					6,757,957	0.72	

現地通貨建 想定元本額	支払	受取	通貨	償還年月日/満期日	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合 (%)	
金利スワップ							
51,745,399	Floating (BRL 1 month CETIP)	Fixed 9.200%	BRL	02/01/2024	(594,245)	(0.06)	
51,400,000	Fixed 12.713%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2025	(128,683)	(0.01)	
102,840,000	Fixed 13.300%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2025	(435,541)	(0.05)	
7,240,350,000	Fixed 5.500%	Floating (CLP 6 month CLICP)	CLP	22/06/2033	(201,553)	(0.02)	
1,255,000	Fixed 11.000%	Floating (COP 1 month CPIBR)	COP	21/06/2025	(3)	(0.00)	
20,802,920,000	Fixed 9.500%	Floating (COP 1 month CPIBR)	COP	21/06/2033	(301,985)	(0.03)	
910,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2033	(10,538)	(0.00)	
2,480,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2038	(22,426)	(0.00)	
78,865,000	Fixed 4.500%	Floating (ILS 3 month TELBOR)	ILS	21/06/2025	(68,283)	(0.01)	
43,595,000	Fixed 4.000%	Floating (ILS 3 month TELBOR)	ILS	21/06/2033	(281,570)	(0.03)	
1,879,340,000	Fixed 6.000%	Floating (INR 1 month MIBOR)	INR	20/09/2028	(36,099)	(0.00)	
293,025,000	Floating (MXN 1 month TIIE)	Fixed 8.330%	MXN	14/06/2028	(57,685)	(0.01)	
286,185,000	Fixed 8.500%	Floating (MXN 1 month TIIE)	MXN	08/06/2033	(159,043)	(0.02)	
26,240,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.250%	MYR	18/12/2024	(22,646)	(0.00)	
19,680,000	Floating (MYR 3 month LIBOR)	Fixed 2.250%	MYR	17/06/2025	(107,076)	(0.01)	
54,770,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 2.000%	MYR	16/06/2026	(456,083)	(0.05)	
79,810,000	Floating (MYR 3 month LIBOR)	Fixed 2.000%	MYR	16/06/2026	(301,959)	(0.03)	
27,140,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 4.000%	MYR	15/03/2028	(11,168)	(0.00)	
72,530,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.000%	MYR	15/12/2031	(709,079)	(0.08)	
22,970,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.271%	MYR	21/12/2031	(147,960)	(0.02)	
33,020,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.500%	MYR	16/03/2032	(83,102)	(0.01)	
30,780,000	Floating (MYR 3 month KLIBOR)	Fixed 3.750%	MYR	21/06/2033	(44,296)	(0.01)	
25,225,000	Floating (PLN 6 month WIBOR)	Fixed 7.500%	PLN	21/12/2024	(5,210)	(0.00)	
28,310,000	Floating (USD 1 month SOFR)	Fixed 3.300%	USD	21/06/2028	(418,386)	(0.04)	
275,075,000	Floating (ZAR 3 month JIBAR)	Fixed 9.250%	ZAR	21/06/2033	(814,625)	(0.09)	
金利スワップ未実現損失					(5,419,244)	(0.58)	
スワップ契約未実現損失合計					(5,419,244)	(0.58)	
投資評価額 (取得原価 米ドル 1,041,830,752)					902,077,412	96.14	
その他資産・負債					35,995,895	3.86	
投資主資本					938,073,307	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 1,042,037,547)	909,813,415	96.99
先物取引未実現利益	346,789	0.04
先物取引未実現損失	(11,227)	(0.00)
外国為替予約取引未実現利益	18,909,649	2.02
外国為替予約取引未実現損失	(24,738,190)	(2.66)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益	11,432	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失	(4,369,716)	(0.47)
買建オプション評価額 (取得原価 米ドル 3,224,457)	4,801,827	0.51
売建オプション評価額 (取得原価 米ドル (3,431,252))	(4,025,280)	(0.43)
スワップ契約未実現利益	6,757,957	0.72
スワップ契約未実現損失	(5,419,244)	(0.58)
その他資産・負債	35,995,895	3.86
投資主資本	938,073,307	100.00

〈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・エマージグ・マーケット・デット・ポートフォリオ IXシエアクラスの状況〉

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・エマージグ・マーケット・デット・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、グローバル新成長国オープンが投資対象とする外国投資信託証券です。2024年1月5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5月31日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
当座借越支払利息	302
有価証券貸付にかかる手数料	5,576
投資顧問報酬	9,780,723
保管費用	280,173
管理事務代行報酬	263,193
販売報酬およびサービシング報酬	506,091
名義書換事務代行報酬	117,852
年次税	300,155
監査報酬	12,531
管理会社報酬	268,993
取締役報酬	10,127
弁護士報酬	46,098
保険費用	22,411
印刷費用	37,844
出版費用	7,599
税務報告報酬	16,841
支払代理人報酬	11,121
規制報告報酬	64,733
その他費用	98,704
	<u>11,851,067</u>
費用合計	<u>11,851,067</u>

■保有有価証券明細（2023年5月31日現在）

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	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						
債券-88.83%						
アンゴラ						
5,600,000	Angolan Government International Bond	USD	9.500%	12/11/2025	5,569,438	0.18
15,380,000	Angolan Government International Bond	USD	8.250%	09/05/2028	13,735,148	0.45
11,969,000	Angolan Government International Bond	USD	8.000%	26/11/2029	10,229,485	0.33
9,310,000	Angolan Government International Bond	USD	8.750%	14/04/2032	7,847,515	0.25
940,000	Angolan Government International Bond	USD	9.125%	26/11/2049	704,659	0.02
					<u>38,086,245</u>	<u>1.23</u>
アルゼンチン						
471,785	Argentina Government International Bond	EUR	0.500%	09/07/2029	111,328	0.00
6,392,562	Argentina Government International Bond	USD	25.788%	09/07/2029	1,647,220	0.05
14,132,900	Argentina Government International Bond	EUR	0.125%	09/07/2030	3,440,612	0.11
26,121,473	Argentina Government International Bond	USD	0.500%	09/07/2030	6,961,764	0.23
35,302,540	Argentina Government International Bond	USD	1.500%	09/07/2035	8,352,228	0.27
6,050,000	Argentina Government International Bond	USD	3.875%	09/01/2038	1,761,684	0.06

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
アルゼンチン						
32,905,235	Argentina Government International Bond	USD	3.500%	09/07/2041	8,601,346	0.28
425,475	Argentina Government International Bond	USD	1.500%	09/07/2046	101,657	0.00
					30,977,839	1.00
アゼルバイジャン						
14,550,000	Azerbaijan International Bond	USD	3.500%	01/09/2032	12,422,317	0.40
3,470,000	State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	USD	6.950%	18/03/2030	3,584,979	0.12
					16,007,296	0.52
バーレーン						
12,180,000	Bahrain Government International Bond	USD	4.250%	25/01/2028	11,184,285	0.36
11,560,000	Bahrain Government International Bond	USD	7.000%	12/10/2028	11,720,569	0.38
7,980,000	Bahrain Government International Bond	USD	6.750%	20/09/2029	7,843,921	0.26
15,190,000	Bahrain Government International Bond	USD	7.375%	14/05/2030	15,351,052	0.50
1,380,000	Bahrain Government International Bond	USD	5.625%	30/09/2031	1,258,522	0.04
7,630,000	Bahrain Government International Bond	USD	5.450%	16/09/2032	6,691,071	0.22
4,430,000	Bahrain Government International Bond	USD	5.250%	25/01/2033	3,778,701	0.12
4,040,000	Bahrain Government International Bond	USD	5.625%	18/05/2034	3,450,574	0.11
12,340,000	CBB International Sukuk Programme Co. WLL	USD	3.950%	16/09/2027	11,542,960	0.37
					72,821,655	2.36
ベナン						
6,110,000	Benin Government International Bond	EUR	4.875%	19/01/2032	4,866,574	0.16
1,600,000	Benin Government International Bond	EUR	4.950%	22/01/2035	1,176,423	0.04
					6,042,997	0.20
バミューダ						
4,550,000	Bermuda Government International Bond	USD	5.000%	15/07/2032	4,490,315	0.14
6,750,000	Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	USD	2.625%	15/08/2025	6,046,600	0.20
					10,536,915	0.34
ブラジル						
3,100,000	Banco do Brasil SA	USD	4.750%	20/03/2024	3,070,628	0.10
7,310,000	Banco do Brasil SA	USD	6.250%	Perp.	6,373,260	0.21
25,590,000	Brazilian Government International Bond	USD	6.000%	20/10/2033	25,154,970	0.81
2,670,000	Brazilian Government International Bond	USD	5.000%	27/01/2045	2,071,019	0.07
18,210,000	Brazilian Government International Bond	USD	4.750%	14/01/2050	13,279,551	0.43
2,155,000	Samarco Mineracao SA	USD	4.125%	01/11/2022	1,228,350	0.04
1,980,000	Samarco Mineracao SA	USD	5.750%	24/10/2023	1,148,400	0.04
4,350,000	Samarco Mineracao SA	USD	5.375%	26/09/2024	2,501,250	0.08
					54,827,428	1.78
英領ヴァージン諸島						
744,958	Easy Tactic Ltd.	USD	7.500%	11/07/2028	63,191	0.00
1,760,000	Huarong Finance 2017 Co. Ltd.	USD	4.750%	27/04/2027	1,465,336	0.05
1,800,000	Huarong Finance II Co. Ltd.	USD	4.625%	03/06/2026	1,548,446	0.05
1,110,000	SF Holding Investment 2021 Ltd.	USD	2.375%	17/11/2026	1,009,767	0.03
2,100,000	SF Holding Investment 2021 Ltd.	USD	3.125%	17/11/2031	1,804,777	0.06
					5,891,517	0.19
ケイマン諸島						
6,526,000	Brazil Minas SPE / State of Minas Gerais	USD	5.333%	15/02/2028	6,425,059	0.21
1,500,000	China Aoyuan Group Ltd.	USD	5.880%	01/03/2027	82,500	0.00
4,360,000	DP World Crescent Ltd.	USD	3.750%	30/01/2030	4,098,291	0.13
370,000	Fantasia Holdings Group Co. Ltd.	USD	10.875%	09/01/2023	29,600	0.00
710,000	Fantasia Holdings Group Co. Ltd.	USD	11.875%	01/06/2023	56,800	0.00
1,310,000	Fantasia Holdings Group Co. Ltd.	USD	10.875%	02/03/2024	104,800	0.00

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ケイマン諸島						
19,160,000	Gaci First Investment Co.	USD	5.000%	13/10/2027	19,209,145	0.62
23,080,000	Gaci First Investment Co.	USD	4.750%	14/02/2030	22,967,312	0.75
1,030,000	IHS Holding Ltd.	USD	5.625%	29/11/2026	878,016	0.03
1,150,000	IHS Holding Ltd.	USD	6.250%	29/11/2028	922,769	0.03
8,090,000	KSA Sukuk Ltd.	USD	5.268%	25/10/2028	8,382,191	0.27
5,883,960	Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	USD	4.350%	05/04/2036	5,259,510	0.17
2,370,000	Maldives Sukuk Issuance Ltd.	USD	9.875%	08/04/2026	1,923,296	0.06
300,000	Meituan	USD	3.562%	27/04/2027	261,563	0.01
900,000	Meituan	USD	4.584%	27/04/2028	732,150	0.02
3,730,000	Meituan	USD	3.050%	28/10/2030	2,953,591	0.10
430,000	NIO, Inc.	USD	3.245%	01/02/2026	394,740	0.01
580,000	Redsun Properties Group Ltd.	USD	9.700%	16/04/2023	58,813	0.00
340,000	Redsun Properties Group Ltd.	USD	7.300%	13/01/2025	34,787	0.00
2,083,000	Shimao Group Holdings Ltd.	USD	5.600%	15/07/2026	218,715	0.01
3,840,000	Shimao Group Holdings Ltd.	USD	5.200%	16/01/2027	403,200	0.01
2,130,000	Shimao Group Holdings Ltd.	USD	4.600%	13/07/2030	223,650	0.01
1,830,000	Shimao Group Holdings Ltd.	USD	3.450%	11/01/2031	192,150	0.01
7,990,000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6.500%	09/07/2023	1,218,475	0.04
670,000	Sunac China Holdings Ltd.	USD	6.500%	10/01/2025	102,175	0.00
1,580,000	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	USD	6.000%	25/10/2023	82,950	0.00
3,880,000	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	USD	7.375%	13/01/2026	203,700	0.01
200,000	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	USD	7.850%	12/08/2026	10,500	0.00
2,750,000	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	USD	6.350%	13/01/2027	144,375	0.01
8,220,000	Yuzhou Group Holdings Co. Ltd.	USD	5.375%	Perp.	246,600	0.01
					77,821,423	2.52
チリ						
16,750,000	Chile Government International Bond	USD	3.500%	31/01/2034	14,833,046	0.48
3,720,000	Chile Government International Bond	USD	4.340%	07/03/2042	3,286,880	0.11
9,800,000	Chile Government International Bond	USD	4.000%	31/01/2052	7,874,031	0.25
17,840,000	Chile Government International Bond	USD	3.100%	22/01/2061	11,482,894	0.37
29,660,000	Chile Government International Bond	USD	3.250%	21/09/2071	18,970,017	0.61
200,000	Corp. Nacional del Cobre de Chile	USD	3.750%	15/01/2031	181,872	0.01
2,810,000	Empresa de los Ferrocarriles del Estado	USD	3.068%	18/08/2050	1,746,721	0.06
2,870,000	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	USD	3.650%	07/05/2030	2,637,064	0.09
3,954,016	GNL Quintero SA	USD	4.634%	31/07/2029	3,871,046	0.13
470,000	Inversiones CMPC SA	USD	4.375%	04/04/2027	454,902	0.01
					65,338,473	2.12
コロンビア						
1,292,000	Banco de Bogota SA	USD	6.250%	12/05/2026	1,254,652	0.04
3,890,000	Colombia Government International Bond	USD	3.875%	25/04/2027	3,518,534	0.11
10,220,000	Colombia Government International Bond	USD	4.500%	15/03/2029	8,920,706	0.29
19,780,000	Colombia Government International Bond	USD	3.000%	30/01/2030	15,273,819	0.50
32,333,000	Colombia Government International Bond	USD	3.125%	15/04/2031	24,112,981	0.78
7,890,000	Colombia Government International Bond	USD	3.250%	22/04/2032	5,735,872	0.19
4,910,000	Colombia Government International Bond	USD	8.000%	20/04/2033	4,950,017	0.16
7,570,000	Colombia Government International Bond	USD	7.500%	02/02/2034	7,286,182	0.24
1,380,000	Colombia Government International Bond	USD	5.625%	26/02/2044	1,001,728	0.03
4,330,000	Colombia Government International Bond	USD	5.000%	15/06/2045	2,892,148	0.09
370,000	Colombia Government International Bond	USD	5.200%	15/05/2049	248,155	0.01
20,980,000	Colombia Government International Bond	USD	4.125%	15/05/2051	12,337,341	0.40
16,870,000	Colombia Government International Bond	USD	3.875%	15/02/2061	9,241,428	0.30

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
コロンビア						
11,040,000	Ecopetrol SA	USD	4.625%	02/11/2031	8,302,439	0.27
10,160,000	Ecopetrol SA	USD	8.875%	13/01/2033	9,898,698	0.32
					114,974,700	3.73
コスタリカ						
4,670,000	Costa Rica Government International Bond	USD	6.125%	19/02/2031	4,682,924	0.15
23,010,000	Costa Rica Government International Bond	USD	6.550%	03/04/2034	23,282,611	0.76
1,760,000	Costa Rica Government International Bond	USD	5.625%	30/04/2043	1,526,329	0.05
					29,491,864	0.96
キプロス						
4,390,000	MHP SE	USD	7.750%	10/05/2024	2,677,900	0.09
ドミニカ共和国						
10,190,000	Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	USD	6.750%	30/03/2029	10,013,267	0.33
100,380,000	Dominican Republic Central Bank Notes	DOP	13.000%	30/01/2026	1,896,842	0.06
7,350,000	Dominican Republic International Bond	USD	6.875%	29/01/2026	7,439,284	0.24
339,000	Dominican Republic International Bond	USD	8.625%	20/04/2027	354,230	0.01
20,760,000	Dominican Republic International Bond	USD	5.500%	22/02/2029	19,355,586	0.63
17,090,000	Dominican Republic International Bond	USD	4.500%	30/01/2030	14,804,597	0.48
10,646,000	Dominican Republic International Bond	USD	7.050%	03/02/2031	10,592,770	0.34
2,360,000	Dominican Republic International Bond	USD	4.875%	23/09/2032	1,991,244	0.06
6,230,000	Dominican Republic International Bond	USD	6.850%	27/01/2045	5,544,949	0.18
6,520,000	Dominican Republic International Bond	USD	6.500%	15/02/2048	5,486,629	0.18
3,610,000	Dominican Republic International Bond	USD	6.400%	05/06/2049	3,002,067	0.10
9,920,000	Dominican Republic International Bond	USD	5.875%	30/01/2060	7,409,248	0.24
					87,890,713	2.85
エクアドル						
19,641,187	Ecuador Government International Bond	USD	5.500%	31/07/2030	9,717,477	0.31
22,182,312	Ecuador Government International Bond	USD	17.723%	31/07/2030	6,665,674	0.22
51,590,014	Ecuador Government International Bond	USD	2.500%	31/07/2035	18,145,369	0.59
18,117,141	Ecuador Government International Bond	USD	1.500%	31/07/2040	5,778,824	0.19
					40,307,344	1.31
エジプト						
810,000	Egypt Government International Bond	USD	5.800%	30/09/2027	512,252	0.02
8,300,000	Egypt Government International Bond	USD	6.588%	21/02/2028	5,261,412	0.17
1,780,000	Egypt Government International Bond	USD	7.600%	01/03/2029	1,109,743	0.04
26,020,000	Egypt Government International Bond	EUR	5.625%	16/04/2030	14,828,957	0.48
6,176,000	Egypt Government International Bond	USD	5.875%	16/02/2031	3,364,916	0.11
3,558,000	Egypt Government International Bond	EUR	6.375%	11/04/2031	2,023,633	0.06
6,480,000	Egypt Government International Bond	USD	7.053%	15/01/2032	3,582,257	0.12
3,490,000	Egypt Government International Bond	USD	7.625%	29/05/2032	1,950,919	0.06
6,570,000	Egypt Government International Bond	USD	7.300%	30/09/2033	3,548,933	0.11
4,090,000	Egypt Government International Bond	USD	7.903%	21/02/2048	2,025,368	0.07
13,970,000	Egypt Government International Bond	USD	8.700%	01/03/2049	7,223,992	0.23
11,610,000	Egypt Government International Bond	USD	8.875%	29/05/2050	6,047,968	0.20
750,000	Egypt Government International Bond	USD	8.150%	20/11/2059	375,664	0.01
9,040,000	Egypt Government International Bond	USD	7.500%	16/02/2061	4,341,302	0.14
					56,197,316	1.82
エルサルバドル						
9,236,000	El Salvador Government International Bond	USD	5.875%	30/01/2025	7,955,960	0.26
4,190,000	El Salvador Government International Bond	USD	6.375%	18/01/2027	2,685,832	0.09
960,000	El Salvador Government International Bond	USD	8.625%	28/02/2029	577,440	0.02

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
エルサルバドル						
1,080,000	El Salvador Government International Bond	USD	8.250%	10/04/2032	632,551	0.02
1,540,000	El Salvador Government International Bond	USD	7.650%	15/06/2035	819,553	0.03
9,789,000	El Salvador Government International Bond	USD	7.625%	01/02/2041	5,056,018	0.16
950,000	El Salvador Government International Bond	USD	7.125%	20/01/2050	473,713	0.01
25,460,000	El Salvador Government International Bond	USD	9.500%	15/07/2052	14,404,695	0.47
					32,605,762	1.06
エチオピア						
4,920,000	Ethiopia International Bond	USD	6.625%	11/12/2024	3,365,809	0.11
ガボン						
2,616,719	Gabon Government International Bond	USD	6.375%	12/12/2024	2,536,530	0.08
3,670,000	Gabon Government International Bond	USD	6.625%	06/02/2031	2,883,280	0.09
200,000	Gabon Government International Bond	USD	7.000%	24/11/2031	156,946	0.01
					5,576,756	0.18
ガーナ						
13,120,000	Ghana Government International Bond	USD	6.375%	11/02/2027	5,335,445	0.17
8,330,000	Ghana Government International Bond	USD	7.750%	07/04/2029	3,376,461	0.11
3,720,000	Ghana Government International Bond	USD	7.625%	16/05/2029	1,507,111	0.05
3,230,000	Ghana Government International Bond	USD	10.750%	14/10/2030	2,213,866	0.07
15,040,000	Ghana Government International Bond	USD	8.125%	26/03/2032	6,087,590	0.20
12,716,000	Ghana Government International Bond	USD	8.625%	07/04/2034	5,155,130	0.16
5,940,000	Ghana Government International Bond	USD	7.875%	11/02/2035	2,407,527	0.08
6,272,000	Ghana Government International Bond	USD	8.875%	07/05/2042	2,412,384	0.08
2,398,000	Ghana Government International Bond	USD	8.627%	16/06/2049	919,789	0.03
2,379,000	Ghana Government International Bond	USD	8.950%	26/03/2051	913,673	0.03
					30,328,976	0.98
グアテマラ						
8,895,000	Guatemala Government Bond	USD	4.500%	03/05/2026	8,575,091	0.28
21,240,000	Guatemala Government Bond	USD	4.375%	05/06/2027	20,213,630	0.66
7,260,000	Guatemala Government Bond	USD	5.250%	10/08/2029	6,944,589	0.22
1,260,000	Guatemala Government Bond	USD	4.900%	01/06/2030	1,179,952	0.04
2,480,000	Guatemala Government Bond	USD	4.650%	07/10/2041	1,975,016	0.06
8,420,000	Guatemala Government Bond	USD	6.125%	01/06/2050	7,706,574	0.25
					46,594,852	1.51
ホンジュラス						
3,330,000	Honduras Government International Bond	USD	5.625%	24/06/2030	2,677,978	0.09
香港						
1,330,000	CNAC HK Finbridge Co. Ltd.	USD	5.125%	14/03/2028	1,309,787	0.04
7,960,000	CNAC HK Finbridge Co. Ltd.	USD	3.875%	19/06/2029	7,293,052	0.24
2,470,000	CNAC HK Finbridge Co. Ltd.	USD	3.000%	22/09/2030	2,093,745	0.07
					10,696,584	0.35
ハンガリー						
1,233,000	Hungary Government International Bond	EUR	5.000%	22/02/2027	1,321,463	0.04
42,240,000	Hungary Government International Bond	USD	6.125%	22/05/2028	42,991,978	1.39
19,030,000	Hungary Government International Bond	USD	5.250%	16/06/2029	18,478,178	0.60
12,860,000	Hungary Government International Bond	USD	2.125%	22/09/2031	9,810,958	0.32
10,890,000	Hungary Government International Bond	USD	6.250%	22/09/2032	11,089,314	0.36
12,810,000	Hungary Government International Bond	USD	5.500%	16/06/2034	12,282,196	0.40
780,000	Hungary Government International Bond	USD	7.625%	29/03/2041	865,823	0.03
12,340,000	Hungary Government International Bond	USD	3.125%	21/09/2051	7,381,140	0.24
2,880,000	Hungary Government International Bond	USD	6.750%	25/09/2052	2,907,871	0.10

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ハンガリー						
3,470,000	Magyar Export-Import Bank Zrt	USD	6.125%	04/12/2027	3,449,371	0.11
					110,578,292	3.59
インド						
1,910,000	Adani Electricity Mumbai Ltd.	USD	3.949%	12/02/2030	1,443,320	0.05
2,940,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD	4.200%	04/08/2027	2,541,660	0.08
740,000	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	USD	4.375%	03/07/2029	595,822	0.02
6,720,000	Reliance Industries Ltd.	USD	2.875%	12/01/2032	5,634,199	0.18
					10,215,001	0.33
インドネシア						
2,022,000	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	USD	4.300%	Perp.	1,657,170	0.05
4,340,000	Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT	USD	5.450%	15/05/2030	4,246,397	0.14
3,640,000	Indonesia Asahan Aluminium PT / Mineral Industri Indonesia Persero PT	USD	5.800%	15/05/2050	3,242,057	0.11
14,370,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.150%	20/09/2027	14,100,814	0.46
11,910,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.550%	11/01/2028	11,890,676	0.39
12,510,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.650%	20/09/2032	12,437,942	0.40
9,840,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.850%	11/01/2033	9,969,962	0.32
5,270,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.625%	15/04/2043	4,985,130	0.16
1,840,000	Indonesia Government International Bond	USD	3.500%	14/02/2050	1,396,689	0.05
3,670,000	Indonesia Government International Bond	USD	5.650%	11/01/2053	3,839,471	0.12
20,100,000	Indonesia Government International Bond	USD	4.450%	15/04/2070	16,919,175	0.55
3,240,000	Indonesia Government International Bond	USD	3.350%	12/03/2071	2,148,995	0.07
1,680,000	Pertamina Geothermal Energy PT	USD	5.150%	27/04/2028	1,680,000	0.05
3,147,000	Pertamina Persero PT	USD	2.300%	09/02/2031	2,586,079	0.08
2,150,000	Pertamina Persero PT	USD	6.500%	27/05/2041	2,221,079	0.07
4,080,000	Pertamina Persero PT	USD	6.000%	03/05/2042	4,034,692	0.13
12,210,000	Pertamina Persero PT	USD	4.175%	21/01/2050	9,525,174	0.31
3,050,000	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	USD	3.800%	23/06/2050	2,425,894	0.08
					109,307,396	3.54
イラク						
8,481,250	Iraq International Bond	USD	5.800%	15/01/2028	7,859,977	0.25
イスラエル						
4,580,400	Leviathan Bond Ltd.	USD	5.750%	30/06/2023	4,568,892	0.15
コートジボワール						
10,760,000	Ivory Coast Government International Bond	EUR	5.250%	22/03/2030	9,413,761	0.31
2,700,000	Ivory Coast Government International Bond	EUR	4.875%	30/01/2032	2,190,165	0.07
6,910,000	Ivory Coast Government International Bond	USD	6.125%	15/06/2033	6,004,116	0.19
400,000	Ivory Coast Government International Bond	EUR	6.625%	22/03/2048	290,807	0.01
					17,898,849	0.58
ジャマイカ						
5,258,000	Jamaica Government International Bond	USD	7.875%	28/07/2045	6,097,006	0.20
ヨルダン						
750,000	Jordan Government International Bond	USD	5.750%	31/01/2027	711,186	0.02
1,860,000	Jordan Government International Bond	USD	7.750%	15/01/2028	1,873,336	0.06
9,160,000	Jordan Government International Bond	USD	7.750%	15/01/2028	9,225,677	0.30
8,410,000	Jordan Government International Bond	USD	7.500%	13/01/2029	8,314,420	0.27
12,110,000	Jordan Government International Bond	USD	5.850%	07/07/2030	10,865,304	0.35
					30,989,923	1.00
カザフスタン						
20,880,000	KazMunayGas National Co. JSC	USD	4.750%	19/04/2027	19,655,388	0.64
8,360,000	KazMunayGas National Co. JSC	USD	3.500%	14/04/2033	6,286,532	0.20

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
カザフスタン						
510,000	KazMunayGas National Co. JSC	USD	5.750%	19/04/2047	393,163	0.01
					26,335,083	0.85
ケニア						
4,852,000	Kenya Government International Bond	USD	6.875%	24/06/2024	4,479,488	0.14
3,449,000	Kenya Government International Bond	USD	7.000%	22/05/2027	2,964,450	0.10
600,000	Kenya Government International Bond	USD	7.250%	28/02/2028	502,234	0.02
6,570,000	Kenya Government International Bond	USD	8.000%	22/05/2032	5,303,961	0.17
					13,250,133	0.43
レバノン						
10,250,000	Lebanon Government International Bond	USD	8.250%	12/04/2021	628,658	0.02
1,300,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.100%	04/10/2022	79,625	0.00
8,810,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.650%	22/04/2024	539,612	0.02
17,763,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.200%	26/02/2025	1,086,207	0.03
650,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.600%	27/11/2026	39,748	0.00
18,708,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.750%	29/11/2027	1,141,749	0.04
3,780,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.650%	03/11/2028	230,760	0.01
33,519,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.850%	25/05/2029	2,039,212	0.07
22,177,000	Lebanon Government International Bond	USD	6.650%	26/02/2030	1,346,865	0.04
7,853,000	Lebanon Government International Bond	USD	7.050%	02/11/2035	480,211	0.02
					7,612,647	0.25
ルクセンブルク						
5,240,000	Altice Financing SA	EUR	4.250%	15/08/2029	4,294,561	0.14
2,218,000	Rede D' or Finance SARL	USD	4.500%	22/01/2030	1,883,248	0.06
					6,177,809	0.20
マレーシア						
4,600,000	Genm Capital Labuan Ltd.	USD	3.882%	19/04/2031	3,701,942	0.12
16,790,000	Petronas Capital Ltd.	USD	4.550%	21/04/2050	15,466,276	0.50
4,150,000	Petronas Capital Ltd.	USD	4.800%	21/04/2060	3,935,497	0.13
					23,103,715	0.75
モーリシャス						
276,950	Greenko Power II Ltd.	USD	4.300%	13/12/2028	237,485	0.01
380,000	Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.	USD	5.500%	06/04/2025	360,527	0.01
890,000	India Airport Infrastructure	USD	6.250%	25/10/2025	848,528	0.03
2,000,000	India Green Power Holdings	USD	4.000%	22/02/2027	1,718,750	0.05
2,853,000	MTN Mauritius Investments Ltd.	USD	4.755%	11/11/2024	2,785,833	0.09
					5,951,123	0.19
メキシコ						
3,240,000	Banco Mercantil del Norte SA	USD	5.875%	Perp.	2,768,167	0.09
7,090,000	Banco Mercantil del Norte SA	USD	6.750%	Perp.	6,661,480	0.22
3,807,000	BBVA Bancomer SA	USD	5.125%	18/01/2033	3,357,774	0.11
3,060,000	Cemex SAB de CV	USD	9.125%	Perp.	3,048,816	0.10
13,830,000	Mexico City Airport Trust	USD	3.875%	30/04/2028	12,807,617	0.42
5,543,000	Mexico City Airport Trust	USD	5.500%	31/10/2046	4,236,252	0.14
6,595,000	Mexico City Airport Trust	USD	5.500%	31/10/2046	5,040,245	0.16
1,739,000	Mexico City Airport Trust	USD	5.500%	31/07/2047	1,339,334	0.04
1,570,000	Mexico Government International Bond	USD	5.400%	09/02/2028	1,605,659	0.05
1,380,000	Mexico Government International Bond	USD	4.500%	22/04/2029	1,344,161	0.04
6,950,000	Mexico Government International Bond	USD	2.659%	24/05/2031	5,785,406	0.19
6,000,000	Mexico Government International Bond	USD	4.750%	27/04/2032	5,747,565	0.19
8,490,000	Mexico Government International Bond	USD	4.875%	19/05/2033	8,124,251	0.26

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
メキシコ						
7,235,000	Mexico Government International Bond	USD	3.500%	12/02/2034	6,089,464	0.20
15,510,000	Mexico Government International Bond	EUR	2.250%	12/08/2036	12,007,097	0.39
566,000	Mexico Government International Bond	USD	4.750%	08/03/2044	478,596	0.02
4,950,000	Mexico Government International Bond	EUR	2.125%	25/10/2051	2,939,282	0.10
22,074,000	Mexico Government International Bond	USD	4.400%	12/02/2052	17,096,975	0.55
3,880,000	Mexico Government International Bond	USD	6.338%	04/05/2053	3,897,460	0.13
28,320,000	Mexico Government International Bond	USD	3.771%	24/05/2061	18,886,254	0.61
6,350,000	Mexico Government International Bond	USD	3.750%	19/04/2071	4,169,553	0.14
2,210,000	Petroleos Mexicanos	USD	6.490%	23/01/2027	1,916,932	0.06
2,539,000	Petroleos Mexicanos	USD	6.500%	13/03/2027	2,202,583	0.07
2,010,000	Petroleos Mexicanos	USD	5.350%	12/02/2028	1,624,236	0.05
1,248,000	Petroleos Mexicanos	USD	5.950%	28/01/2031	895,814	0.03
1,250,000	Petroleos Mexicanos	USD	5.625%	23/01/2046	689,294	0.02
1,928,000	Petroleos Mexicanos	USD	6.750%	21/09/2047	1,168,170	0.04
6,600,000	Petroleos Mexicanos	USD	6.350%	12/02/2048	3,842,685	0.12
12,399,000	Petroleos Mexicanos	USD	7.690%	23/01/2050	8,078,816	0.26
7,441,000	Petroleos Mexicanos	USD	6.950%	28/01/2060	4,441,533	0.14
2,150,000	Petroleos Mexicanos-Series WI	USD	6.700%	16/02/2032	1,609,813	0.05
					153,901,284	4.99
モンゴル						
4,140,000	Mongolia Government International Bond	USD	5.125%	07/04/2026	3,703,779	0.12
2,960,000	Mongolia Government International Bond	USD	3.500%	07/07/2027	2,409,403	0.08
2,890,000	Mongolia Government International Bond	USD	8.650%	19/01/2028	2,866,757	0.09
					8,979,939	0.29
モロッコ						
9,080,000	Morocco Government International Bond	USD	2.375%	15/12/2027	7,973,216	0.26
10,100,000	Morocco Government International Bond	USD	5.950%	08/03/2028	10,242,561	0.33
8,750,000	Morocco Government International Bond	EUR	1.500%	27/11/2031	6,960,651	0.22
16,360,000	Morocco Government International Bond	USD	3.000%	15/12/2032	12,922,989	0.42
12,290,000	Morocco Government International Bond	USD	6.500%	08/09/2033	12,551,408	0.41
1,730,000	Morocco Government International Bond	USD	5.500%	11/12/2042	1,471,309	0.05
1,360,000	Morocco Government International Bond	USD	4.000%	15/12/2050	903,761	0.03
2,010,000	OCP SA	USD	5.125%	23/06/2051	1,453,376	0.05
					54,479,271	1.77
モザンビーク						
4,370,000	Mozambique International Bond	USD	5.000%	15/09/2031	3,110,074	0.10
オランダ						
883,600	Greenko Dutch BV	USD	3.850%	29/03/2026	782,867	0.03
2,490,000	IHS Netherlands Holdco BV	USD	8.000%	18/09/2027	2,227,199	0.07
2,930,000	Metinvest BV	USD	8.500%	23/04/2026	1,948,450	0.06
200,000	Metinvest BV	USD	7.750%	17/10/2029	116,000	0.00
1,520,000	Minejesa Capital BV	USD	4.625%	10/08/2030	1,362,600	0.04
4,616,535	MV24 Capital BV	USD	6.748%	01/06/2034	4,091,901	0.13
4,870,000	NE Property BV	EUR	1.875%	09/10/2026	4,495,831	0.15
1,490,000	NE Property BV	EUR	3.375%	14/07/2027	1,417,860	0.05
1,220,000	Prosus NV	USD	3.257%	19/01/2027	1,109,065	0.04
2,480,000	Prosus NV	USD	3.680%	21/01/2030	2,059,308	0.07
5,690,000	Prosus NV	USD	4.193%	19/01/2032	4,682,173	0.15
					24,293,254	0.79

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ナイジェリア						
1,410,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.625%	21/11/2025	1,350,110	0.04
8,890,000	Nigeria Government International Bond	USD	6.500%	28/11/2027	7,543,298	0.24
12,000,000	Nigeria Government International Bond	USD	6.125%	28/09/2028	9,713,610	0.32
7,240,000	Nigeria Government International Bond	USD	8.375%	24/03/2029	6,293,669	0.20
6,079,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.143%	23/02/2030	4,834,811	0.16
4,020,000	Nigeria Government International Bond	USD	8.747%	21/01/2031	3,373,262	0.11
8,225,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.875%	16/02/2032	6,480,149	0.21
8,830,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.375%	28/09/2033	6,517,268	0.21
3,700,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.696%	23/02/2038	2,569,132	0.08
4,690,000	Nigeria Government International Bond	USD	7.625%	28/11/2047	3,091,965	0.10
200,000	Nigeria Government International Bond	USD	9.248%	21/01/2049	152,385	0.01
9,728,000	Nigeria Government International Bond	USD	8.250%	28/09/2051	6,618,372	0.22
					58,538,031	1.90
北マケドニア						
12,560,000	North Macedonia Government International Bond	EUR	2.750%	18/01/2025	12,776,902	0.42
870,000	North Macedonia Government International Bond	EUR	6.960%	13/03/2027	948,573	0.03
1,550,000	North Macedonia Government International Bond	EUR	1.625%	10/03/2028	1,329,310	0.04
					15,054,785	0.49
オマーン						
7,800,000	Oman Government International Bond	USD	4.750%	15/06/2026	7,589,868	0.25
9,430,000	Oman Government International Bond	USD	5.375%	08/03/2027	9,277,706	0.30
12,080,000	Oman Government International Bond	USD	6.750%	28/10/2027	12,539,402	0.41
26,860,000	Oman Government International Bond	USD	5.625%	17/01/2028	26,652,641	0.86
4,150,000	Oman Government International Bond	USD	6.000%	01/08/2029	4,170,314	0.13
16,620,000	Oman Government International Bond	USD	6.250%	25/01/2031	16,870,463	0.55
7,900,000	Oman Government International Bond	USD	7.375%	28/10/2032	8,641,376	0.28
2,470,000	Oman Government International Bond	USD	6.500%	08/03/2047	2,260,489	0.07
10,840,000	Oman Government International Bond	USD	6.750%	17/01/2048	10,220,412	0.33
					98,222,671	3.18
パキスタン						
8,389,000	Pakistan Government International Bond	USD	8.250%	15/04/2024	4,479,160	0.14
18,448,000	Pakistan Government International Bond	USD	6.000%	08/04/2026	7,087,814	0.23
13,516,000	Pakistan Government International Bond	USD	6.875%	05/12/2027	5,145,811	0.17
7,610,000	Pakistan Government International Bond	USD	7.375%	08/04/2031	2,805,521	0.09
2,190,000	Pakistan Government International Bond	USD	7.875%	31/03/2036	793,875	0.03
17,010,000	Pakistan Government International Bond	USD	8.875%	08/04/2051	5,991,390	0.19
3,900,000	Pakistan Water & Power Development Authority	USD	7.500%	04/06/2031	1,296,750	0.04
					27,600,321	0.89
パナマ						
4,550,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	USD	4.000%	11/08/2041	3,624,723	0.12
15,790,000	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	USD	5.125%	11/08/2061	11,903,568	0.39
1,590,000	Autoridad del Canal de Panama	USD	4.950%	29/07/2035	1,501,964	0.05
9,820,000	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA	USD	2.375%	14/09/2025	9,228,345	0.30
1,150,000	Banco Nacional de Panama	USD	2.500%	11/08/2030	914,486	0.03
3,340,000	Panama Government International Bond	USD	3.160%	23/01/2030	2,948,076	0.09
5,070,000	Panama Government International Bond	USD	6.400%	14/02/2035	5,314,437	0.17
15,870,000	Panama Government International Bond	USD	4.500%	16/04/2050	12,149,120	0.39
1,760,000	Panama Government International Bond	USD	4.500%	01/04/2056	1,307,601	0.04
37,940,000	Panama Government International Bond	USD	3.870%	23/07/2060	24,799,860	0.80
3,280,000	Panama Government International Bond	USD	4.500%	19/01/2063	2,368,849	0.08

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
パナマ						
11,130,000	Panama Notas del Tesoro	USD	3.750%	17/04/2026	10,683,381	0.35
					86,744,410	2.81
パプアニューギニア						
2,140,000	Papua New Guinea Government International Bond	USD	8.375%	04/10/2028	1,960,566	0.06
パラグアイ						
289,000	Paraguay Government International Bond	USD	5.000%	15/04/2026	284,888	0.01
13,340,000	Paraguay Government International Bond	USD	5.000%	15/04/2026	13,150,172	0.43
6,446,000	Paraguay Government International Bond	USD	4.700%	27/03/2027	6,279,709	0.20
5,950,000	Paraguay Government International Bond	USD	4.950%	28/04/2031	5,707,783	0.19
8,667,000	Paraguay Government International Bond	USD	2.739%	29/01/2033	6,906,158	0.22
1,000,000	Paraguay Government International Bond	USD	6.100%	11/08/2044	935,207	0.03
3,350,000	Paraguay Government International Bond	USD	5.600%	13/03/2048	2,891,025	0.09
8,420,000	Paraguay Government International Bond	USD	5.400%	30/03/2050	7,095,555	0.23
					43,250,497	1.40
ペルー						
1,944,263	Atlantica Transmision Sur SA	USD	6.875%	30/04/2043	1,839,151	0.06
1,360,000	Peruvian Government International Bond	USD	2.392%	23/01/2026	1,277,298	0.04
2,840,000	Peruvian Government International Bond	USD	4.125%	25/08/2027	2,784,514	0.09
2,390,000	Peruvian Government International Bond	USD	2.783%	23/01/2031	2,037,905	0.07
2,660,000	Peruvian Government International Bond	EUR	1.250%	11/03/2033	2,061,456	0.07
4,760,000	Peruvian Government International Bond	USD	3.000%	15/01/2034	3,892,978	0.13
1,340,000	Peruvian Government International Bond	USD	3.300%	11/03/2041	1,000,407	0.03
8,540,000	Peruvian Government International Bond	USD	2.780%	01/12/2060	4,948,802	0.16
4,090,000	Peruvian Government International Bond	USD	3.600%	15/01/2072	2,673,285	0.09
34,030,000	Peruvian Government International Bond	USD	3.230%	28/07/2121	19,584,095	0.63
					42,099,891	1.37
フィリピン						
5,000,000	Philippine Government International Bond	USD	4.625%	17/07/2028	5,065,763	0.16
14,540,000	Philippine Government International Bond	USD	5.609%	13/04/2033	15,526,975	0.50
11,710,000	Philippine Government International Bond	USD	5.950%	13/10/2047	12,869,729	0.42
					33,462,467	1.08
ポーランド						
7,680,000	Bank Gospodarstwa Krajowego	USD	5.375%	22/05/2033	7,704,000	0.25
3,320,000	Poland Government International Bond	USD	5.500%	16/11/2027	3,439,470	0.11
4,500,000	Poland Government International Bond	USD	5.750%	16/11/2032	4,781,048	0.16
					15,924,518	0.52
カタール						
9,000,000	Qatar Government International Bond	USD	5.103%	23/04/2048	8,934,795	0.29
5,540,000	Qatar Government International Bond	USD	4.400%	16/04/2050	5,017,453	0.16
8,590,000	QatarEnergy	USD	3.125%	12/07/2041	6,475,980	0.21
18,010,000	QatarEnergy	USD	3.300%	12/07/2051	12,958,600	0.42
					33,386,828	1.08
ルーマニア						
7,930,000	Romanian Government International Bond	USD	3.000%	27/02/2027	7,242,172	0.23
490,000	Romanian Government International Bond	USD	5.250%	25/11/2027	481,600	0.01
20,440,000	Romanian Government International Bond	USD	6.625%	17/02/2028	20,976,397	0.68
60,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.875%	26/05/2028	57,103	0.00
3,220,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.875%	11/03/2029	2,962,477	0.10
9,740,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.500%	08/02/2030	8,430,249	0.27
1,260,000	Romanian Government International Bond	EUR	3.624%	26/05/2030	1,162,435	0.04

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ルーマニア						
5,220,000	Romanian Government International Bond	EUR	1.750%	13/07/2030	4,189,395	0.13
10,340,000	Romanian Government International Bond	USD	3.000%	14/02/2031	8,564,648	0.28
4,360,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.124%	16/07/2031	3,464,622	0.11
4,380,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.000%	28/01/2032	3,366,730	0.11
11,210,000	Romanian Government International Bond	USD	3.625%	27/03/2032	9,474,356	0.31
2,980,000	Romanian Government International Bond	USD	7.125%	17/01/2033	3,142,209	0.10
9,900,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.000%	14/04/2033	7,314,464	0.24
830,000	Romanian Government International Bond	USD	6.000%	25/05/2034	816,048	0.03
860,000	Romanian Government International Bond	EUR	2.750%	14/04/2041	545,382	0.02
2,860,000	Romanian Government International Bond	EUR	3.375%	28/01/2050	1,825,227	0.06
1,490,000	Romanian Government International Bond	USD	4.000%	14/02/2051	1,017,569	0.03
780,000	Romanian Government International Bond	USD	7.625%	17/01/2053	828,750	0.03
					85,861,833	2.78
ロシア						
14,100,000	Russian Foreign Bond - Eurobond	EUR	1.850%	20/11/2032	903,316	0.03
54,600,000	Russian Foreign Bond - Eurobond	USD	5.100%	28/03/2035	3,276,000	0.11
7,300,000	Russian Foreign Bond - Eurobond	EUR	2.650%	27/05/2036	467,675	0.01
					4,646,991	0.15
サウジアラビア						
20,130,000	Saudi Government International Bond	USD	4.750%	18/01/2028	20,276,144	0.66
11,040,000	Saudi Government International Bond	USD	5.500%	25/10/2032	11,667,293	0.38
4,840,000	Saudi Government International Bond	USD	4.875%	18/07/2033	4,879,204	0.16
5,430,000	Saudi Government International Bond	USD	5.000%	18/01/2053	4,993,455	0.16
16,790,000	Saudi Government International Bond	USD	3.750%	21/01/2055	12,567,231	0.41
26,360,000	Saudi Government International Bond	USD	4.500%	22/04/2060	22,790,131	0.74
9,820,000	Saudi Government International Bond	USD	3.450%	02/02/2061	6,900,170	0.22
					84,073,628	2.73
セルビア						
6,930,000	Serbia International Bond	EUR	3.125%	15/05/2027	6,525,291	0.21
6,740,000	Serbia International Bond	USD	6.250%	26/05/2028	6,686,872	0.22
5,650,000	Serbia International Bond	EUR	6.645%	23/09/2028	4,540,245	0.15
2,040,000	Serbia International Bond	EUR	1.500%	26/06/2029	1,637,578	0.05
10,140,000	Serbia International Bond	USD	2.125%	01/12/2030	7,629,133	0.25
2,310,000	Serbia International Bond	EUR	1.650%	03/03/2033	1,582,520	0.05
5,490,000	Serbia International Bond	USD	6.500%	26/09/2033	5,336,431	0.17
1,250,000	Serbia International Bond	EUR	2.050%	23/09/2036	788,046	0.03
					34,726,116	1.13
南アフリカ						
9,245,000	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	6.750%	06/08/2023	9,162,373	0.30
8,800,000	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	7.125%	11/02/2025	8,436,428	0.27
3,470,000	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	4.314%	23/07/2027	2,989,197	0.10
12,990,000	Eskom Holdings SOC Ltd.	USD	6.350%	10/08/2028	11,792,484	0.38
3,160,000	South Africa Government International Bond	USD	4.875%	14/04/2026	2,994,914	0.10
2,250,000	South Africa Government International Bond	USD	4.850%	27/09/2027	2,079,472	0.07
7,360,000	South Africa Government International Bond	USD	4.300%	12/10/2028	6,359,169	0.21
20,340,000	South Africa Government International Bond	USD	4.850%	30/09/2029	17,572,845	0.57
600,000	South Africa Government International Bond	USD	5.875%	22/06/2030	540,183	0.02
4,380,000	South Africa Government International Bond	USD	5.875%	20/04/2032	3,781,692	0.12
4,150,000	South Africa Government International Bond	USD	5.375%	24/07/2044	2,831,794	0.09
1,360,000	South Africa Government International Bond	USD	5.000%	12/10/2046	868,901	0.03
14,360,000	South Africa Government International Bond	USD	5.650%	27/09/2047	9,796,536	0.32

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
南アフリカ						
22,200,000	South Africa Government International Bond	USD	5.750%	30/09/2049	15,095,389	0.49
3,260,000	South Africa Government International Bond	USD	7.300%	20/04/2052	2,620,526	0.08
10,110,000	Transnet SOC Ltd.	USD	8.250%	06/02/2028	9,693,089	0.31
					106,614,992	3.46
韓国						
1,090,000	SK Hynix, Inc.	USD	6.375%	17/01/2028	1,102,611	0.04
スリランカ						
5,170,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	5.750%	18/04/2023	1,907,355	0.06
9,200,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.850%	14/03/2024	3,367,614	0.11
2,310,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.125%	03/06/2025	902,367	0.03
5,605,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.850%	03/11/2025	2,150,190	0.07
10,000,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.825%	18/07/2026	3,805,750	0.12
10,470,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.200%	11/05/2027	3,833,800	0.13
4,479,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	6.750%	18/04/2028	1,637,869	0.05
350,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	7.850%	14/03/2029	128,625	0.00
9,670,000	Sri Lanka Government International Bond	USD	7.550%	28/03/2030	3,549,301	0.12
					21,282,871	0.69
国際機関債						
7,150,000	African Export-Import Bank	USD	2.634%	17/05/2026	6,421,058	0.21
7,280,000	African Export-Import Bank	USD	3.798%	17/05/2031	5,916,674	0.19
3,950,000	Black Sea Trade & Development Bank	USD	3.500%	25/06/2024	3,701,071	0.12
20,180,000	Eastern & Southern African Trade & Development Bank	USD	4.875%	23/05/2024	19,362,508	0.63
					35,401,311	1.15
タイ						
350,000	Bangkok Bank PCL	USD	3.466%	23/09/2036	282,325	0.01
2,400,000	PTT Treasury Center Co. Ltd.	USD	3.700%	16/07/2070	1,598,124	0.05
					1,880,449	0.06
トリニダード・トバゴ						
6,210,000	Trinidad & Tobago Government International Bond	USD	4.500%	26/06/2030	5,924,309	0.19
チュニジア						
2,633,000	Tunisia Government Bond	EUR	6.750%	31/10/2023	2,649,730	0.09
860,000	Tunisia Government Bond	EUR	5.625%	17/02/2024	741,065	0.02
2,060,000	Tunisia Government Bond	USD	5.750%	30/01/2025	1,277,316	0.04
7,120,000	Tunisia Government Bond	EUR	6.375%	15/07/2026	4,102,814	0.13
					8,770,925	0.28
トルコ						
10,740,000	Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	USD	5.125%	22/06/2026	9,601,318	0.31
3,936,000	Turkey Government International Bond	USD	5.750%	22/03/2024	3,834,943	0.12
2,110,000	Turkey Government International Bond	USD	6.350%	10/08/2024	2,045,318	0.07
990,000	Turkey Government International Bond	USD	7.375%	05/02/2025	959,246	0.03
2,060,000	Turkey Government International Bond	USD	4.750%	26/01/2026	1,844,395	0.06
1,450,000	Turkey Government International Bond	USD	4.250%	14/04/2026	1,266,508	0.04
13,594,000	Turkey Government International Bond	USD	6.000%	25/03/2027	12,108,584	0.39
18,516,000	Turkey Government International Bond	USD	9.875%	15/01/2028	18,492,207	0.60
670,000	Turkey Government International Bond	USD	6.125%	24/10/2028	583,706	0.02
10,910,000	Turkey Government International Bond	USD	5.250%	13/03/2030	8,690,088	0.28
12,600,000	Turkey Government International Bond	USD	5.950%	15/01/2031	10,189,809	0.33
11,380,000	Turkey Government International Bond	USD	5.875%	26/06/2031	9,082,662	0.30
3,520,000	Turkey Government International Bond	USD	9.375%	19/01/2033	3,384,392	0.11
10,030,000	Turkey Government International Bond	USD	6.500%	20/09/2033	8,079,441	0.26

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
トルコ						
2,310,000	Turkey Government International Bond	USD	6.000%	14/01/2041	1,628,235	0.05
25,640,000	Turkey Government International Bond	USD	5.750%	11/05/2047	16,877,466	0.55
11,610,000	Yapi ve Kredi Bankasi AS	USD	13.875%	Perp.	11,612,612	0.38
					120,280,930	3.90
ウクライナ						
1,649,000	NPC Ukrenergo	USD	6.875%	09/11/2028	305,065	0.01
510,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/09/2025	106,695	0.00
520,000	Ukraine Government International Bond	EUR	6.750%	20/06/2026	98,112	0.00
13,330,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/09/2026	2,596,351	0.08
12,910,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/09/2027	2,526,648	0.08
9,290,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/09/2028	1,815,475	0.06
2,770,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/09/2029	541,306	0.02
15,530,000	Ukraine Government International Bond	USD	6.876%	21/05/2031	2,875,923	0.09
12,030,000	Ukraine Government International Bond	EUR	4.375%	27/01/2032	2,382,079	0.08
25,628,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.375%	25/09/2034	4,789,232	0.16
21,682,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.253%	15/03/2035	4,098,928	0.13
5,970,000	Ukraine Government International Bond	USD	7.750%	01/08/2041	1,740,718	0.06
					23,876,532	0.77
アラブ首長国連邦						
18,060,000	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	USD	4.600%	02/11/2047	16,750,650	0.54
2,810,000	DP World Ltd.	USD	5.625%	25/09/2048	2,605,896	0.08
3,510,000	DP World Ltd.	USD	4.700%	30/09/2049	2,939,897	0.10
7,960,000	Emirate of Dubai Government International Bonds	USD	3.900%	09/09/2050	5,625,193	0.18
8,970,000	Finance Department Government of Sharjah	USD	3.625%	10/03/2033	7,300,750	0.24
8,140,000	Finance Department Government of Sharjah	USD	4.000%	28/07/2050	5,025,534	0.16
7,700,000	NBK Tier 1 Financing 2 Ltd.	USD	4.500%	Perp.	7,094,125	0.23
					47,342,045	1.53
英国						
2,050,000	Prudential Funding Asia PLC	USD	2.950%	03/11/2033	1,753,811	0.06
1,519,000	Ukraine Railways / Rail Capital Markets PLC	USD	8.250%	09/07/2024	342,724	0.01
					2,096,535	0.07
米国						
289,036	Brazil Loan Trust 1	USD	5.477%	24/07/2023	288,531	0.01
2,348,302	Brazil Loan Trust 1	USD	5.477%	24/07/2023	2,344,192	0.08
4,050,000	Kosmos Energy Ltd.	USD	7.750%	01/05/2027	3,466,436	0.11
1,000,000	Kosmos Energy Ltd.	USD	7.500%	01/03/2028	828,245	0.03
12,220,000	Sasol Financing USA LLC	USD	5.875%	27/03/2024	12,057,107	0.39
2,920,000	Sasol Financing USA LLC	USD	8.750%	03/05/2029	2,806,558	0.09
69,310,000	United States Treasury Note/Bond	USD	0.375%	31/12/2025	63,074,807	2.04
51,400,000	United States Treasury Note/Bond	USD	0.750%	31/01/2028	44,711,977	1.45
18,500,000	United States Treasury Note/Bond	USD	3.125%	15/11/2028	17,898,027	0.58
5,780,000	United States Treasury Note/Bond	USD	2.375%	15/11/2049	4,284,877	0.14
					151,760,757	4.92
ウルグアイ						
9,660,000	Uruguay Government International Bond	USD	5.750%	28/10/2034	10,558,863	0.34
13,440,000	Uruguay Government International Bond	USD	5.100%	18/06/2050	13,218,341	0.43
6,030,000	Uruguay Government International Bond	USD	4.975%	20/04/2055	5,809,724	0.19
					29,586,928	0.96
ウズベキスタン						
7,050,000	National Bank of Uzbekistan	USD	4.850%	21/10/2025	6,533,993	0.21

グローバル新成長国オープン

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
債券						
ウズベキスタン						
4,040,000	Uzbekistan International Bond	USD	5.375%	20/02/2029	3,691,267	0.12
10,139,000	Uzbekistan International Bond	USD	3.700%	25/11/2030	8,141,440	0.27
					18,366,700	0.60
ベネズエラ						
564,690,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	6.000%	28/10/2022	16,940,700	0.55
46,220,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	6.000%	16/05/2024	1,548,370	0.05
202,623,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	6.000%	15/11/2026	5,065,575	0.16
635,000	Petroleos de Venezuela SA	USD	5.375%	12/04/2027	15,875	0.00
3,335,300	Venezuela Government International Bond	USD	8.250%	13/10/2024	295,174	0.01
9,523,000	Venezuela Government International Bond	USD	7.650%	21/04/2025	842,786	0.03
					24,708,480	0.80
ベトナム						
1,400,000	Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	USD	7.950%	10/10/2025	1,179,493	0.04
ザンビア						
11,281,000	Zambia Government International Bond	USD	5.375%	20/09/2022	5,115,454	0.17
3,550,000	Zambia Government International Bond	USD	8.500%	14/04/2024	1,753,922	0.06
1,540,000	Zambia Government International Bond	USD	8.970%	30/07/2027	752,656	0.02
					7,622,032	0.25
債券合計 (取得原価 米ドル 4,047,291,339)					2,739,799,463	88.83

口数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
投資信託証券—5.88%			
アイルランド			
181,390,220	Goldman Sachs US\$ Treasury Liquid Reserves Fund (X Distribution Class)	181,390,220	5.88
投資信託証券合計 (取得原価 米ドル 181,390,220)		181,390,220	5.88
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 4,228,681,559)		2,921,189,683	94.71

額面	銘柄名称	通貨	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
その他の規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券						
債券—0.05%						
ペルー						
1,743,775	Atlantica Transmision Sur SA	USD	6.875%	30/04/2043	1,649,502	0.05
債券合計 (取得原価 米ドル 1,880,286)				1,649,502	0.05	
その他の規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券合計 (取得原価 米ドル 1,880,286)				1,649,502	0.05	
デリバティブ取引を除く評価額 (取得原価 米ドル 4,230,561,845)					2,922,839,185	94.76

先物取引—0.09%	枚数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
ユーロ					
(2)	German Federal Republic Bonds 30YR Futures 08/06/2023	売建	(294,058)	3,118	0.00
(148)	German Federal Republic Bonds 5YR Futures 08/06/2023	売建	(18,637,701)	152,741	0.01
			(18,931,759)	155,859	0.01
米ドル					
764	US Treasury Long Bond Futures 20/09/2023	買建	97,792,000	1,050,708	0.03
636	US Treasury Notes 10YR Futures 20/09/2023	買建	72,772,313	493,653	0.02
(9)	US Treasury Notes 2YR Futures 29/09/2023	売建	(1,853,297)	1,688	0.00
498	US Treasury Notes 5YR Futures 29/09/2023	買建	54,317,016	132,847	0.00

先物取引

枚数	銘柄名称		評価額 (米ドル)	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
	米ドル				
563	US Treasury Ultra Long Bond Futures 20/09/2023	買建	76,708,750	870,998	0.03
510	US Treasury Ultra Long Notes 10YR Futures 20/09/2023	買建	61,351,406	374,997	0.01
			361,088,188	2,924,891	0.09
先物取引未実現利益				3,080,750	0.10

枚数	銘柄名称		評価額 (米ドル)	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合(%)
	ユーロ				
(33)	Euro OAT Futures 08/06/2023	売建	(4,588,046)	(81,875)	(0.00)
(29)	German Federal Republic Bonds 10YR Futures 08/06/2023	売建	(4,202,226)	(35,855)	(0.00)
			(8,790,272)	(117,730)	(0.00)
	米ドル				
(8)	US Treasury Long Bond Futures 20/09/2023	売建	(1,024,000)	(9,812)	(0.00)
(13)	US Treasury Notes 10YR Futures 20/09/2023	売建	(1,487,484)	(4,672)	(0.00)
733	US Treasury Notes 2YR Futures 29/09/2023	買建	150,940,735	(157,201)	(0.01)
(25)	US Treasury Notes 5YR Futures 29/09/2023	売建	(2,726,758)	(13,867)	(0.00)
(12)	US Treasury Ultra Long Bond Futures 20/09/2023	売建	(1,635,000)	(21,469)	(0.00)
(15)	US Treasury Ultra Long Notes 10YR Futures 20/09/2023	売建	(1,804,453)	(12,891)	(0.00)
			142,263,040	(219,912)	(0.01)
先物取引未実現損失				(337,642)	(0.01)

外国為替予約取引-0.27%

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(%)
EUR	1,349,105	SEK	15,332,205	02/06/2023	29,942	0.00
EUR	35,992,402	NOK	422,334,163	05/06/2023	578,303	0.02
USD	42,036,347	EUR	38,795,965	05/06/2023	604,995	0.01
USD	3,067,514	AUD	4,694,322	06/06/2023	25,626	0.00
USD	10,210	JPY	1,352,097	07/06/2023	557	0.00
USD	22,348,453	NZD	36,278,131	07/06/2023	593,308	0.02
USD	22,499,743	EUR	20,877,412	09/06/2023	199,142	0.00
USD	5,534,484	NOK	60,765,870	09/06/2023	86,204	0.00
USD	11,482,549	TWD	346,736,967	12/06/2023	201,827	0.01
USD	12,129,531	ZAR	234,814,176	12/06/2023	211,100	0.00
USD	9,652,545	NOK	105,911,474	15/06/2023	153,681	0.00
USD	18,937,319	NZD	30,840,850	15/06/2023	443,444	0.01
USD	23,390,883	ZAR	456,740,347	15/06/2023	215,055	0.00
USD	8,648,206	AUD	13,099,686	16/06/2023	156,482	0.01
GBP	8,628,074	USD	10,659,132	20/06/2023	25,716	0.00
USD	22,829,219	JPY	3,054,015,009	20/06/2023	980,334	0.04
USD	35,982,107	NOK	381,162,177	20/06/2023	1,788,417	0.06
AUD	6,076,726	JPY	533,591,515	21/06/2023	121,939	0.01
AUD	36,914,499	NZD	39,686,236	21/06/2023	136,466	0.00
CHF	38,751,346	EUR	39,297,017	21/06/2023	547,187	0.01
EUR	3,129,511	AUD	4,998,439	21/06/2023	104,445	0.00
EUR	6,139,458	CNH	45,815,339	21/06/2023	125,577	0.00
EUR	6,288,401	JPY	901,783,779	21/06/2023	269,406	0.01
EUR	5,955,678	NOK	68,992,328	21/06/2023	176,714	0.01
EUR	25,897,726	SEK	290,953,358	21/06/2023	887,775	0.02
GBP	2,581,075	EUR	2,978,101	21/06/2023	13,021	0.00

外国為替予約取引

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(%)
HUF	1,258,936,138	EUR	3,217,235	21/06/2023	163,844	0.01
MXN	245,485,878	USD	13,509,034	21/06/2023	324,508	0.02
NZD	35,644,880	AUD	32,897,356	21/06/2023	44,735	0.00
USD	35,647,848	AUD	53,298,349	21/06/2023	1,091,096	0.03
USD	43,566,203	CAD	59,012,799	21/06/2023	218,102	0.00
USD	26,363,721	CHF	23,776,845	21/06/2023	254,099	0.01
USD	39,589,178	CNH	272,039,188	21/06/2023	1,367,245	0.06
USD	66,075,557	EUR	60,470,050	21/06/2023	1,436,778	0.04
USD	11,798,137	ILS	42,717,330	21/06/2023	312,704	0.01
USD	19,978,026	JPY	2,653,530,030	21/06/2023	991,291	0.03
USD	4,949,489	NOK	52,312,018	21/06/2023	256,397	0.01
USD	52,458,486	NZD	85,657,743	21/06/2023	1,094,407	0.04
USD	23,950,807	SEK	249,794,892	21/06/2023	945,981	0.05
USD	22,438,971	SGD	29,858,999	21/06/2023	371,341	0.00
USD	9,612,017	TRY	204,002,843	21/06/2023	441,805	0.02
USD	9,190,770	ZAR	172,455,778	21/06/2023	445,242	0.02
USD	7,437,740	KRW	9,659,257,269	22/06/2023	139,882	0.01
AUD	25,372,632	NZD	27,312,499	26/06/2023	76,419	0.00
EUR	4,863,097	CHF	4,711,636	26/06/2023	22,948	0.00
EUR	22,275,085	SEK	255,278,994	26/06/2023	301,384	0.01
USD	6,762,573	CHF	6,109,013	26/06/2023	50,221	0.00
USD	557,781,673	EUR	508,638,687	26/06/2023	13,914,735	0.46
USD	2,285,557	NZD	3,766,760	26/06/2023	26,883	0.00
USD	1,318,315	SEK	14,073,934	26/06/2023	21,815	0.00
USD	11,162,431	SGD	15,034,578	26/06/2023	48,938	0.00
USD	2,685,000	CLP	2,176,138,800	29/06/2023	9,277	0.00
USD	1,317,091	SEK	14,157,106	30/06/2023	12,636	0.00
USD	5,840	GBP	4,663	08/08/2023	60	0.00
USD	1,364,353	ZAR	26,415,243	16/08/2023	32,332	0.00
USD	2,553,388	SEK	27,357,779	17/08/2023	26,361	0.00
USD	8,477,697	JPY	1,139,402,525	22/11/2023	126,532	0.01
外国為替予約取引未実現利益					33,246,661	1.08

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(%)
GBP	4,783,501	USD	5,926,749	01/06/2023	(5,255)	(0.00)
USD	10,807,368	GBP	8,741,896	01/06/2023	(14,221)	(0.00)
SEK	15,332,205	EUR	1,369,965	02/06/2023	(52,215)	(0.00)
EUR	28,305,509	USD	30,709,392	05/06/2023	(481,108)	(0.01)
NOK	193,943,042	EUR	16,353,175	05/06/2023	(78,520)	(0.00)
AUD	5,130,366	USD	3,378,464	06/06/2023	(54,023)	(0.00)
NZD	17,844,058	USD	10,989,242	07/06/2023	(288,577)	(0.01)
ILS	9,975,029	USD	2,754,524	08/06/2023	(74,140)	(0.00)
EUR	26,624,623	USD	28,811,741	09/06/2023	(372,149)	(0.01)
NOK	32,491,274	USD	3,001,755	09/06/2023	(88,580)	(0.00)
TWD	346,894,571	USD	11,467,589	12/06/2023	(181,739)	(0.01)
ZAR	360,552,457	USD	18,877,980	12/06/2023	(577,467)	(0.02)
HKD	26,292,994	USD	3,361,995	15/06/2023	(4,515)	(0.00)
NOK	45,160,648	USD	4,122,001	15/06/2023	(71,686)	(0.00)
NZD	7,943,412	AUD	7,497,010	15/06/2023	(96,356)	(0.00)
NZD	26,550,080	USD	16,647,323	15/06/2023	(726,431)	(0.02)

外国為替予約取引

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(%)
ZAR	374,002,595	USD	19,367,025	15/06/2023	(389,458)	(0.01)
AUD	24,821,250	USD	16,413,643	16/06/2023	(323,545)	(0.01)
CHF	39,114	USD	44,366	16/06/2023	(1,440)	(0.00)
JPY	3,635,628,079	USD	27,496,419	20/06/2023	(1,486,585)	(0.06)
NOK	664,242,590	USD	62,664,138	20/06/2023	(3,075,581)	(0.08)
USD	13,141,472	GBP	10,612,019	20/06/2023	(258)	(0.00)
AUD	48,320,356	USD	32,468,963	21/06/2023	(1,139,766)	(0.07)
CAD	67,889,947	USD	49,937,345	21/06/2023	(68,495)	(0.00)
CHF	23,702,493	USD	26,602,305	21/06/2023	(574,332)	(0.01)
CNH	203,981,929	USD	29,741,310	21/06/2023	(1,081,530)	(0.07)
CZK	208,054,096	EUR	8,809,813	21/06/2023	(75,572)	(0.00)
CZK	68,820,012	USD	3,199,294	21/06/2023	(109,292)	(0.00)
EUR	5,694,000	CAD	8,309,453	21/06/2023	(17,207)	(0.00)
EUR	19,528,664	CHF	19,203,538	21/06/2023	(212,678)	(0.00)
EUR	7,246,470	CZK	173,100,688	21/06/2023	(26,147)	(0.00)
EUR	8,887,707	GBP	7,840,113	21/06/2023	(208,855)	(0.01)
EUR	6,010,482	PLN	27,831,161	21/06/2023	(119,269)	(0.00)
EUR	393,050,430	USD	423,238,821	21/06/2023	(3,091,993)	(0.10)
GBP	5,310,643	CAD	9,015,614	21/06/2023	(45,706)	(0.00)
GBP	10,035,688	USD	12,473,055	21/06/2023	(44,763)	(0.00)
ILS	28,074,623	USD	7,748,016	21/06/2023	(199,577)	(0.01)
JPY	1,335,767,378	EUR	9,293,102	21/06/2023	(375,975)	(0.01)
JPY	2,568,178,516	USD	19,276,796	21/06/2023	(900,775)	(0.04)
KRW	6,944,993,342	USD	5,356,826	21/06/2023	(109,896)	(0.00)
NOK	81,686,323	USD	7,847,018	21/06/2023	(518,654)	(0.02)
NZD	10,623,017	EUR	6,041,214	21/06/2023	(87,668)	(0.01)
NZD	45,861,806	USD	28,785,206	21/06/2023	(1,284,488)	(0.05)
PLN	44,593,456	USD	10,608,058	21/06/2023	(122,535)	(0.00)
SEK	318,264,562	EUR	28,201,595	21/06/2023	(835,247)	(0.02)
SEK	102,851,112	USD	10,020,494	21/06/2023	(548,436)	(0.03)
SGD	47,836,831	USD	35,655,650	21/06/2023	(301,302)	(0.01)
TRY	253,247,465	USD	11,810,263	21/06/2023	(426,437)	(0.01)
USD	5,544,501	CZK	124,797,023	21/06/2023	(58,855)	(0.00)
USD	12,635,426	GBP	10,213,223	21/06/2023	(12,725)	(0.00)
USD	3,935,362	HKD	30,832,558	21/06/2023	(2,328)	(0.00)
USD	3,451,419	HUF	1,284,327,386	21/06/2023	(224,118)	(0.01)
USD	23,001,894	MXN	426,124,387	21/06/2023	(1,010,931)	(0.03)
ZAR	97,889,706	USD	5,316,745	21/06/2023	(352,591)	(0.02)
NZD	3,941,655	AUD	3,721,000	22/06/2023	(49,079)	(0.00)
NZD	121,195	USD	74,784	22/06/2023	(2,111)	(0.00)
CHF	15,046,575	EUR	15,520,284	26/06/2023	(62,610)	(0.00)
CZK	264,267,979	EUR	11,120,421	26/06/2023	(27,457)	(0.00)
EUR	13,564,139	CZK	323,530,540	26/06/2023	(19,908)	(0.00)
EUR	42,039,643	USD	45,670,617	26/06/2023	(719,313)	(0.02)
NZD	5,344,682	AUD	5,035,882	26/06/2023	(60,871)	(0.00)
NZD	58,197,448	USD	35,517,148	26/06/2023	(620,028)	(0.02)
SEK	55,471,697	EUR	4,861,406	26/06/2023	(88,017)	(0.00)
SEK	49,245,258	USD	4,614,102	26/06/2023	(77,596)	(0.00)
SGD	7,022,211	USD	5,200,744	26/06/2023	(9,958)	(0.00)
CLP	2,658,319,900	USD	3,350,563	29/06/2023	(81,963)	(0.00)
NOK	63,897,502	USD	5,818,698	30/06/2023	(83,675)	(0.00)

外国為替予約取引

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(%)
SEK	48,660,883	USD	4,524,486	30/06/2023	(40,807)	(0.00)
USD	5,315,369	PLN	23,000,595	30/06/2023	(90,148)	(0.00)
ZAR	55,392,363	USD	2,822,397	30/06/2023	(15,852)	(0.00)
NOK	61,333,474	USD	5,509,784	03/07/2023	(4,073)	(0.00)
MXN	236,041,268	USD	13,169,510	14/08/2023	(8,482)	(0.00)
USD	2,706,866	MXN	48,905,706	14/08/2023	(19,986)	(0.00)
ZAR	89,922,212	USD	4,623,375	16/08/2023	(88,936)	(0.00)
SEK	27,319,421	USD	2,567,390	17/08/2023	(43,907)	(0.00)
AUD	108,177	USD	70,989	30/08/2023	(670)	(0.00)
外国為替予約取引未実現損失					(24,847,439)	(0.81)

特定クラス投資信託証券の外国為替予約取引ー(0.75%)

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(%)
USD	615,761	JPY	81,002,938	07/06/2023	37,423	0.00
USD	10,072,793	CHF	9,056,846	16/06/2023	133,255	0.00
USD	15,897	HKD	124,154	21/06/2023	41	0.00
USD	239,869,866	EUR	219,621,999	26/06/2023	5,036,873	0.17
PLN	13,306,518	USD	3,077,532	30/06/2023	49,718	0.00
USD	123,536	PLN	522,452	30/06/2023	752	0.00
USD	1,303,229	SGD	1,748,683	20/07/2023	9,458	0.00
USD	4,436,174	GBP	3,557,910	08/08/2023	26,072	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益					5,293,592	0.17

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(%)
JPY	5,918,249,027	USD	44,641,379	07/06/2023	(2,386,755)	(0.08)
HKD	12,528,075	USD	1,601,886	15/06/2023	(2,116)	(0.00)
USD	238,952	HKD	1,871,781	15/06/2023	(66)	(0.00)
CHF	185,704,610	USD	203,979,487	16/06/2023	(175,866)	(0.00)
HKD	209,794	USD	26,853	21/06/2023	(60)	(0.00)
EUR	940,147,400	USD	1,028,537,616	26/06/2023	(23,275,725)	(0.75)
SGD	33,612,562	USD	25,246,776	20/07/2023	(378,357)	(0.02)
GBP	169,673,473	USD	212,559,073	08/08/2023	(2,245,343)	(0.07)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失					(28,464,288)	(0.92)

オプションー0.05%

想定元本	銘柄名称	償還年月日/満期日	権利行使価格	未実現 利益/損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
買建オプション						
オーストラリアドル						
37,107,000	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.65	77,594	178,437	0.01
38,646,000	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.66	317,492	475,486	0.01
				395,086	653,923	0.02
ユーロ						
11,958,000	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.03	(68,699)	4,469	0.00
24,039,000	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.07	(161,551)	4,235	0.00
35,406,000	Put EUR / Call USD	Expires 01/06/2023	Strike 1.09	450,596	569,604	0.02
46,060,000	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	136,560	268,723	0.01
				356,906	847,031	0.03

グローバル新成長国オープン

オプション

想定元本	銘柄名称	償還年月日／満期日	権利行使価格	未実現 利益／損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資資本割合(%)
買建オプション						
英ポンド						
19,823,000	Put GBP / Call USD	Expires 15/06/2023	Strike 1.23	(44,327)	68,635	0.00
ニュージーランドドル						
40,755,000	Put NZD / Call USD	Expires 13/06/2023	Strike 0.62	669,529	826,465	0.03
39,260,000	Put NZD / Call USD	Expires 22/06/2023	Strike 0.60	152,463	278,292	0.01
39,260,000	Put NZD / Call USD	Expires 22/06/2023	Strike 0.61	192,701	357,119	0.01
				1,014,693	1,461,876	0.05
米ドル						
22,200,000	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 2.40	(721,402)	22,298	0.00
7,986,000	Call USD / Put JPY	Expires 16/06/2023	Strike 136.70	130,595	178,008	0.01
12,988,000	Call USD / Put MXN	Expires 10/08/2023	Strike 18.17	(28,444)	192,664	0.01
25,975,000	Call USD / Put MXN	Expires 10/08/2023	Strike 18.18	(59,820)	380,456	0.01
12,513,000	Call USD / Put NOK	Expires 07/06/2023	Strike 11.00	125,581	189,147	0.01
12,286,000	Call USD / Put NOK	Expires 13/06/2023	Strike 11.08	62,290	152,224	0.01
8,652,000	Call USD / Put NOK	Expires 16/06/2023	Strike 11.00	77,409	157,267	0.01
12,256,000	Call USD / Put NOK	Expires 28/06/2023	Strike 11.20	48,007	141,336	0.00
12,196,000	Call USD / Put NOK	Expires 29/06/2023	Strike 11.37	11,574	85,799	0.00
12,285,000	Call USD / Put SEK	Expires 21/06/2023	Strike 10.83	60,725	132,039	0.00
12,256,000	Call USD / Put SEK	Expires 28/06/2023	Strike 10.94	20,161	100,928	0.00
25,975,000	Call USD / Put ZAR	Expires 08/06/2023	Strike 19.35	328,012	537,137	0.02
25,898,000	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	294,279	590,552	0.02
18,384,000	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 20.10	(28,109)	113,981	0.00
12,227,000	Call USD / Put ZAR	Expires 28/06/2023	Strike 20.21	(13,266)	120,864	0.00
22,990,000	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 2.80	322,582	1,152,624	0.04
22,990,000	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 2.96	20,986	915,988	0.03
24,707,000	Put USD / Call JPY	Expires 20/11/2023	Strike 132.00	(84,226)	429,086	0.01
				566,934	5,592,398	0.18
買建オプション合計 (取得原価 米ドル 6,334,572)					8,623,863	0.28
売建オプション						
オーストラリアドル						
(7,962,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 06/06/2023	Strike 1.07	(12,905)	(52,292)	(0.00)
(7,665,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 08/06/2023	Strike 1.07	(20,523)	(56,708)	(0.00)
(7,442,000)	Call AUD / Put NZD	Expires 20/06/2023	Strike 1.06	(44,110)	(79,996)	(0.00)
(7,324,079)	Call AUD / Put NZD	Expires 28/06/2023	Strike 1.08	(8,284)	(41,924)	(0.00)
(7,962,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 06/06/2023	Strike 1.07	35,596	(3,792)	(0.00)
(7,665,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 08/06/2023	Strike 1.07	31,741	(4,445)	(0.00)
(7,442,000)	Put AUD / Call NZD	Expires 20/06/2023	Strike 1.06	30,582	(5,304)	(0.00)
(7,324,080)	Put AUD / Call NZD	Expires 28/06/2023	Strike 1.08	13,116	(23,722)	(0.00)
(38,646,000)	Put AUD / Call USD	Expires 14/06/2023	Strike 0.66	(197,738)	(475,486)	(0.02)
				(172,525)	(743,669)	(0.02)
ユーロ						
(4,532,295)	Call EUR / Put CHF	Expires 08/06/2023	Strike 0.98	23,808	(5,551)	(0.00)
(4,712,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 16/06/2023	Strike 0.97	12,516	(19,219)	(0.00)
(4,560,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 22/06/2023	Strike 0.97	(5,665)	(35,582)	(0.00)
(4,559,000)	Call EUR / Put CHF	Expires 28/06/2023	Strike 0.97	(7,443)	(37,892)	(0.00)
(4,744,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 14/06/2023	Strike 23.61	(14,716)	(42,899)	(0.00)
(4,567,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 20/06/2023	Strike 23.73	(1,662)	(28,712)	(0.00)
(4,559,000)	Call EUR / Put CZK	Expires 28/06/2023	Strike 23.66	(18,449)	(44,074)	(0.00)
(11,958,000)	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.03	6,310	(4,469)	(0.00)
(24,039,000)	Call EUR / Put NOK	Expires 01/06/2023	Strike 12.07	22,203	(4,235)	(0.00)

オプション

想定元本	銘柄名称	償還年月日／満期日	権利行使価格	未実現 利益／損失 (米ドル)	評価額 (米ドル)	投資資本割合 (%)
売建オプション						
ユーロ						
(4,782,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 31/05/2023	Strike 11.39	(53,338)	(95,068)	(0.00)
(4,726,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 08/06/2023	Strike 11.16	(156,412)	(193,996)	(0.01)
(4,712,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 16/06/2023	Strike 11.30	(92,311)	(136,130)	(0.01)
(4,560,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 21/06/2023	Strike 11.36	(71,745)	(107,083)	(0.00)
(4,559,000)	Call EUR / Put SEK	Expires 28/06/2023	Strike 11.55	(9,720)	(51,020)	(0.00)
(4,532,296)	Put EUR / Call CHF	Expires 08/06/2023	Strike 0.98	1,015	(28,344)	(0.00)
(4,712,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 16/06/2023	Strike 0.97	7,284	(24,452)	(0.00)
(4,560,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 22/06/2023	Strike 0.97	12,627	(17,290)	(0.00)
(4,559,000)	Put EUR / Call CHF	Expires 28/06/2023	Strike 0.97	9,779	(20,669)	(0.00)
(4,744,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 14/06/2023	Strike 23.61	24,860	(3,323)	(0.00)
(4,567,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 20/06/2023	Strike 23.73	14,835	(12,215)	(0.00)
(4,559,000)	Put EUR / Call CZK	Expires 28/06/2023	Strike 23.66	15,918	(9,707)	(0.00)
(4,782,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 31/05/2023	Strike 11.39	41,731	0	(0.00)
(4,726,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 08/06/2023	Strike 11.16	37,579	(5)	(0.00)
(4,712,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 16/06/2023	Strike 11.30	34,986	(1,077)	(0.00)
(4,560,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 21/06/2023	Strike 11.36	31,706	(3,632)	(0.00)
(4,559,000)	Put EUR / Call SEK	Expires 28/06/2023	Strike 11.55	14,162	(27,138)	(0.00)
(35,406,000)	Put EUR / Call USD	Expires 01/06/2023	Strike 1.09	(326,212)	(569,604)	(0.02)
(23,030,000)	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	(48,442)	(134,361)	(0.01)
(23,030,000)	Put EUR / Call USD	Expires 07/06/2023	Strike 1.07	(61,717)	(134,361)	(0.01)
				(556,513)	(1,792,108)	(0.06)
ニュージーランドドル						
(40,755,000)	Put NZD / Call USD	Expires 13/06/2023	Strike 0.62	(407,688)	(826,465)	(0.03)
米ドル						
(22,200,000)	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 1.75	274,641	(2,859)	(0.00)
(22,200,000)	Call 12 month SOFR Swaption	Expires 28/07/2023	Strike 2.08	458,219	(7,981)	(0.00)
(7,986,000)	Call USD / Put JPY	Expires 16/06/2023	Strike 136.70	(99,003)	(178,008)	(0.01)
(12,513,000)	Call USD / Put NOK	Expires 07/06/2023	Strike 11.00	(82,736)	(189,146)	(0.01)
(12,286,000)	Call USD / Put NOK	Expires 13/06/2023	Strike 11.08	(26,010)	(152,224)	(0.00)
(8,652,000)	Call USD / Put NOK	Expires 16/06/2023	Strike 11.00	9,240	(157,267)	(0.01)
(5,180,000)	Call USD / Put SGD	Expires 13/06/2023	Strike 1.33	(75,281)	(100,948)	(0.00)
(4,941,000)	Call USD / Put SGD	Expires 20/06/2023	Strike 1.34	(19,749)	(46,356)	(0.00)
(4,890,000)	Call USD / Put SGD	Expires 27/06/2023	Strike 1.35	(4,743)	(32,851)	(0.00)
(25,975,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 08/06/2023	Strike 19.35	(181,682)	(537,137)	(0.02)
(12,949,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	10,916	(295,276)	(0.01)
(12,949,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 13/06/2023	Strike 19.35	(14,218)	(295,276)	(0.01)
(6,476,000)	Call USD / Put ZAR	Expires 14/08/2023	Strike 19.38	(39,944)	(258,898)	(0.01)
(22,990,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 3.23	(43,134)	(555,595)	(0.02)
(22,990,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 23/08/2023	Strike 3.66	116,488	(201,094)	(0.01)
(22,990,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 3.41	150,022	(398,527)	(0.01)
(22,990,000)	Put 12 month SOFR Swaption	Expires 05/09/2023	Strike 3.85	211,956	(134,496)	(0.00)
(5,180,000)	Put USD / Call SGD	Expires 13/06/2023	Strike 1.33	25,434	(233)	(0.00)
(4,941,000)	Put USD / Call SGD	Expires 20/06/2023	Strike 1.34	18,628	(7,980)	(0.00)
(4,890,000)	Put USD / Call SGD	Expires 27/06/2023	Strike 1.35	5,467	(17,995)	(0.00)
(6,476,000)	Put USD / Call ZAR	Expires 14/08/2023	Strike 19.38	80,484	(116,840)	(0.00)
				774,995	(3,686,987)	(0.12)
売建オプション合計 (取得原価 米ドル (6,687,499))					(7,049,229)	(0.23)
オプション合計 (取得原価 米ドル (352,927))					1,574,634	0.05

スワップ契約-0.12%

現地通貨建 想定元本額	支払	受取	通貨	償還年月日/満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
金利スワップ						
234,120,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 13.950%	BRL	02/01/2024	231,527	0.01
34,130,000	Fixed 10.950%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2025	196,046	0.01
150,803,510	Fixed 6.320%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2025	3,949,410	0.13
293,490,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.060%	BRL	02/01/2025	282,385	0.01
249,520,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.064%	BRL	02/01/2025	278,542	0.01
46,880,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 10.850%	BRL	02/01/2026	12,962	0.00
32,230,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.915%	BRL	02/01/2026	41,800	0.00
39,160,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 13.030%	BRL	04/01/2027	355,820	0.01
29,850,000	Floating (BRL 1 month CETIP)	Fixed 11.230%	BRL	04/01/2027	231,785	0.01
588,640,000	Floating (CNY 3 month CNRR)	Fixed 2.500%	CNY	20/09/2025	66,887	0.00
10,450,000	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	Fixed 2.500%	EUR	21/06/2028	84,519	0.00
3,910,000	Fixed 2.250%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2053	45,207	0.00
108,701,760,000	Floating (KRW 3 month KSDA)	Fixed 3.500%	KRW	21/06/2028	125,915	0.00
25,873,810,000	Floating (KRW 3 month KSDA)	Fixed 3.500%	KRW	21/06/2033	167,349	0.01
1,499,110,000	Floating (MXN 1 month TIIE)	Fixed 10.500%	MXN	18/06/2025	69,961	0.00
113,125,000	Floating (PLN 6 month WIBOR)	Fixed 6.000%	PLN	21/06/2033	1,030,328	0.03
69,110,000	Fixed 3.000%	Floating (SGD 6 month IBOR)	SGD	21/06/2028	544,331	0.02
382,870,000	Floating (USD 1 month SOFR)	Fixed 3.350%	USD	06/10/2027	571,112	0.02
25,450,000	Fixed 3.000%	Floating (USD 1 month SOFR)	USD	21/06/2033	304,458	0.01
87,270,000	Fixed 3.240%	Floating (USD 1 month SOFR)	USD	06/10/2035	65,208	0.00
1,300,710,000	Fixed 8.250%	Floating (ZAR 3 month JIBAR)	ZAR	15/03/2025	783,517	0.03
金利スワップ未実現利益					9,439,069	0.31
クレジット・デフォルト・スワップ						
24,550,000	Floating (Brazilian Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	212,976	0.01
19,090,000	Floating (Chile Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	170,768	0.01
27,190,000	Floating (Indonesia Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	151,984	0.01
49,860,000	Floating (Mexico Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	101,237	0.00
49,030,000	Floating (Peruvian Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	682,439	0.02
37,920,000	Floating (Philippine Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	381,109	0.01
19,290,000	Floating (Turkey Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	77,693	0.00
クレジット・デフォルト・スワップ未実現利益					1,778,206	0.06
スワップ契約未実現利益合計					11,217,275	0.37

スワップ契約								
現地通貨建 想定元本額	支払	受取	通貨	償還年月日/満期日	未実現損失 (米ドル)	投資主資本割合 (%)		
金利スワップ								
154,258,268	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 11.814%	BRL	02/01/2024	(499,128)	(0.02)		
51,180,000	Floating (BRL 1 month BRCDI)	Fixed 12.300%	BRL	02/01/2024	(40,444)	(0.00)		
91,800,600	Floating (BRL 1 month CETIP)	Fixed 9.200%	BRL	02/01/2024	(1,107,829)	(0.04)		
133,850,000	Fixed 13.300%	Floating (BRL 1 month BRCDI)	BRL	02/01/2025	(566,799)	(0.02)		
143,620,000	Fixed 3.000%	Floating (CNY 3 month CNRR)	CNY	21/06/2028	(495,071)	(0.02)		
12,160,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2025	(49,028)	(0.00)		
42,820,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2026	(225,596)	(0.01)		
39,680,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2030	(378,996)	(0.01)		
28,530,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2033	(330,399)	(0.01)		
6,670,000	Fixed 2.500%	Floating (EUR 6 month EURIBOR)	EUR	21/06/2038	(60,315)	(0.00)		
371,475,000	Floating (MXN 1 month TIIE)	Fixed 8.330%	MXN	14/06/2028	(73,128)	(0.00)		
290,925,000	Fixed 8.500%	Floating (MXN 1 month TIIE)	MXN	08/06/2033	(175,225)	(0.01)		
52,760,000	Floating (USD 1 month SOFR)	Fixed 3.300%	USD	21/06/2028	(779,714)	(0.02)		
242,005,000	Floating (ZAR 3 month JIBAR)	Fixed 9.250%	ZAR	21/06/2033	(757,650)	(0.02)		
金利スワップ未実現損失					(5,539,322)	(0.18)		
クレジット・デフォルト・スワップ								
2,940,000	Floating (Argentine Republic Government International Bond)	Fixed 5.000%	USD	20/12/2025	(1,608,528)	(0.05)		
12,930,000	Fixed 1.000%	Floating (China Government International Bond)	USD	20/06/2028	(87,144)	(0.01)		
25,910,000	Fixed 1.000%	Floating (Colombia Government International Bond)	USD	20/06/2028	(43,648)	(0.00)		
6,990,000	Floating (Egypt Government International Bond)	Fixed 1.000%	USD	20/06/2028	(307,283)	(0.01)		
クレジット・デフォルト・スワップ未実現損失					(2,046,603)	(0.07)		
スワップ契約未実現損失合計					(7,585,925)	(0.25)		
投資評価額 (取得原価 米ドル 4,230,208,918)					2,916,016,803	94.54		
その他資産・負債					168,509,812	5.46		
投資主資本					3,084,526,615	100.00		
投資合計								
デリバティブ取引を除く投資合計 (取得原価 米ドル 4,230,561,845)					2,922,839,185	94.76		
先物取引未実現利益					3,080,750	0.10		
先物取引未実現損失					(337,642)	(0.01)		
外国為替予約取引未実現利益					33,246,661	1.08		
外国為替予約取引未実現損失					(24,847,439)	(0.81)		
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益					5,293,592	0.17		
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失					(28,464,288)	(0.92)		
買建オプション評価額 (取得原価 米ドル 6,334,572)					8,623,863	0.28		
売建オプション評価額 (取得原価 米ドル (6,687,499))					(7,049,229)	(0.23)		
スワップ契約未実現利益					11,217,275	0.37		
スワップ契約未実現損失					(7,585,925)	(0.25)		
その他資産・負債					168,509,812	5.46		
投資主資本					3,084,526,615	100.00		