

GSグローバル・ビッグデータ投資戦略

Aコース(為替ヘッジあり)

第6期末(2022年3月10日)		第6期	
基準価額	14,470円	騰落率	4.50%
純資産総額	23,584百万円	分配金合計	0円

Bコース(為替ヘッジなし)

第6期末(2022年3月10日)		第6期	
基準価額	15,569円	騰落率	9.69%
純資産総額	97,601百万円	分配金合計	0円

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

■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信／内外／株式
信託期間	原則として無期限
運用方針	主として日本を含む先進国の株式を主要投資対象とし、計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時にポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行う投資信託証券への投資を通じ、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	<p>本ファンド</p> <p>以下の指定投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> 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・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ アイルランド籍外国投資証券 ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー ②ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド
指定投資信託証券①	日本を含む先進国の株式および株式関連証券
指定投資信託証券②	米ドル建ての短期的な市場性を有する金融市場証券
運用方法・組入制限	<p>①外貨建資産については、Aコースでは、原則として対円での為替ヘッジを行い、Bコースでは、原則として対円での為替ヘッジは行いません。</p> <p>②投資信託証券への投資は、高位に維持することを基本とします。</p> <p>③株式への直接投資は行いません。</p>
分配方針	原則として毎計算期末(毎年3月10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。

Aコース(為替ヘッジあり)

Bコース(為替ヘッジなし)

追加型投信／内外／株式

第6期(決算日2022年3月10日)

作成対象期間:2021年3月11日～2022年3月10日

受益者の皆様へ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「GSグローバル・ビッグデータ投資戦略 Aコース(為替ヘッジあり)／Bコース(為替ヘッジなし)」は、このたび、第6期の決算を行いました。本ファンドは、日本を含む先進国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI(人工知能)を活用した独自開発の計量モデルを用いて多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。今期の運用経過等について、以下のとおりご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

〒106-6147 東京都港区六本木6-10-1 六本木ヒルズ森タワー
 お問い合わせ先: 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

GSグローバル・ビッグデータ投資戦略 Aコース（為替ヘッジあり）

（以下、「Aコース（為替ヘッジあり）」といいます。）

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 引 前 分 配 金	期 騰 落 中 率	参 考 指 標	期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産 額
2期(2018年6月25日)	11,797	0	13.5	11,407	9.8	99.3	50,345
3期(2019年6月25日)	11,329	0	△ 4.0	11,859	4.0	98.7	55,030
4期(2020年3月10日)	10,354	0	△ 8.6	10,856	△ 8.5	95.0	32,765
5期(2021年3月10日)	13,847	0	33.7	15,046	38.6	99.4	26,390
6期(2022年3月10日)	14,470	0	4.5	16,187	7.6	99.1	23,584

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 参考指標(MSCIワールド・インデックス(円ヘッジ・ベース))は、2017年2月24日を10,000として指数化しております。

■当期中の基準価額と市況推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	参 考 指 標	騰 落 率	投 資 信 託 証 券 比 率
(期 首) 2021年3月10日	13,847	—	15,046	—	99.4
3月末	14,150	2.2	15,372	2.2	101.7
4月末	14,854	7.3	16,120	7.1	98.6
5月末	14,945	7.9	16,216	7.8	100.2
6月末	15,257	10.2	16,580	10.2	99.5
7月末	15,589	12.6	16,933	12.5	99.0
8月末	15,885	14.7	17,312	15.1	100.4
9月末	15,565	12.4	16,767	11.4	99.4
10月末	15,876	14.7	17,558	16.7	101.0
11月末	15,873	14.6	17,604	17.0	98.7
12月末	16,461	18.9	18,056	20.0	100.6
2022年1月末	14,830	7.1	16,835	11.9	98.7
2月末	14,868	7.4	16,686	10.9	99.0
(期 末) 2022年3月10日	14,470	4.5	16,187	7.6	99.1

(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ワールド・インデックス(円ヘッジ・ベース))は、2017年2月24日を10,000として指数化しております。

GSグローバル・ビッグデータ投資戦略 Bコース（為替ヘッジなし）

（以下、「Bコース（為替ヘッジなし）」といいます。）

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	税 引 前 分 配 金	期 騰 落 中 率	参 考 指 標	期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産 額
2期 (2018年6月25日)	11,847	0	14.2	11,495	10.6	99.4	195,293
3期 (2019年6月25日)	11,272	0	△ 4.9	11,796	2.6	99.4	216,753
4期 (2020年3月10日)	9,998	0	△11.3	10,437	△11.5	98.5	125,066
5期 (2021年3月10日)	14,193	0	42.0	15,566	49.1	98.6	106,453
6期 (2022年3月10日)	15,569	0	9.7	17,531	12.6	98.5	97,601

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 参考指標 (MSCIワールド・インデックス (円ベース)) は、2017年2月24日を10,000として指数化しております。

■当期中の基準価額と市況推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	参 考 指 標	騰 落 率	投 資 信 託 証 券 比 率
(期 首) 2021年3月10日	14,193	—	15,566	—	98.6
3月末	14,717	3.7	16,053	3.1	99.0
4月末	15,329	8.0	16,770	7.7	99.1
5月末	15,558	9.6	17,052	9.5	99.7
6月末	15,904	12.1	17,410	11.8	99.5
7月末	16,115	13.5	17,655	13.4	99.6
8月末	16,441	15.8	18,051	16.0	99.6
9月末	16,314	14.9	17,717	13.8	99.2
10月末	16,935	19.3	18,856	21.1	99.7
11月末	16,818	18.5	18,777	20.6	99.7
12月末	17,638	24.3	19,536	25.5	99.2
2022年1月末	15,894	12.0	18,153	16.6	99.7
2月末	15,963	12.5	18,084	16.2	100.1
(期 末) 2022年3月10日	15,569	9.7	17,531	12.6	98.5

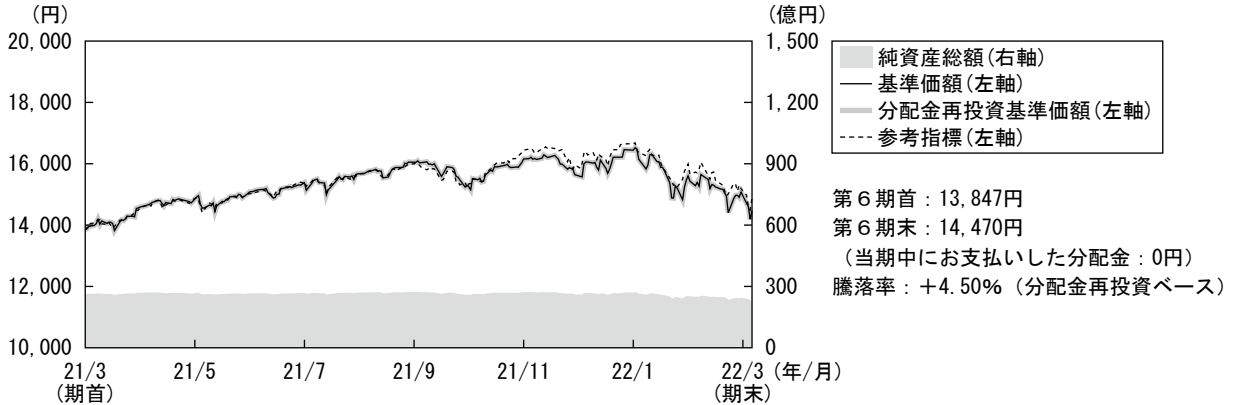
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 参考指標 (MSCIワールド・インデックス (円ベース)) は、2017年2月24日を10,000として指数化しております。

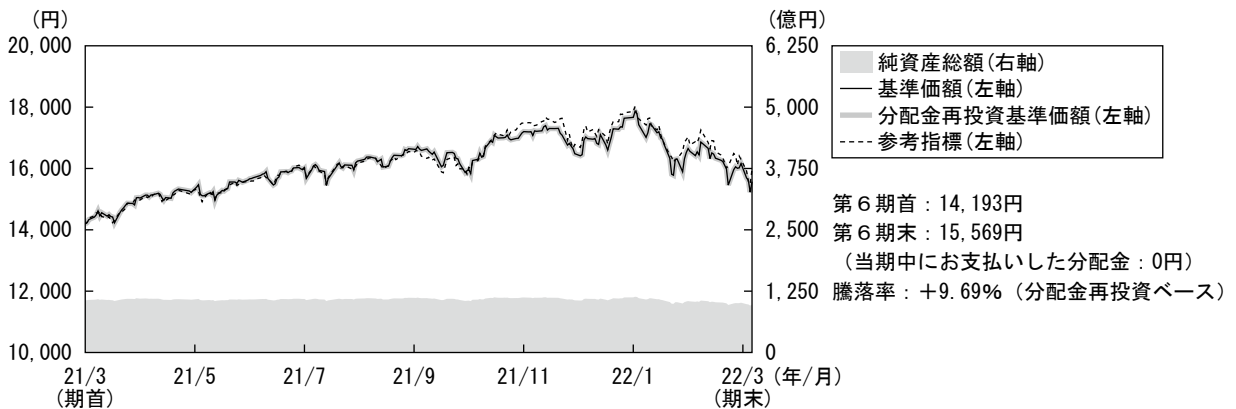
■運用経過

◆基準価額等の推移について（2021年3月11日～2022年3月10日）

○Aコース（為替ヘッジあり）



○Bコース（為替ヘッジなし）



(注1) 参考指標は、Aコース（為替ヘッジあり）はMSCIワールド・インデックス（円ヘッジ・ベース）、Bコース（為替ヘッジなし）はMSCIワールド・インデックス（円ベース）であり、投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しています。

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

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

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

◆基準価額の主な変動要因

- Aコース（為替ヘッジあり）の基準価額は、期首の13,847円から623円上昇し、期末には14,470円となりました。
- Bコース（為替ヘッジなし）の基準価額は、期首の14,193円から1,376円上昇し、期末には15,569円となりました。
- （以下、2ファンドを総称して「本ファンド」といいます。）

上昇要因

世界株式市場（現地通貨ベース）が上昇したこと、銘柄選択における投資テーマ「モメンタム」、「バリュー」および「収益性」がプラス寄与となったことなどが、基準価額の上昇要因となりました。また、Bコース（為替ヘッジなし）においては、米ドルなどが円に対して上昇したことも基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

米国などにおける国別配分効果がマイナス寄与になったことなどが、基準価額の下落要因となりました。

◆組入れファンドの当期中の騰落率（分配金再投資ベース）

ファンド名	騰落率 (米ドルベース)	騰落率 (円換算ベース)
ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ* ¹	4.23%	11.38%
ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド* ²	0.09%	6.95%

（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。

- *1 ルクセンブルク籍外国投資証券（米ドル建て）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・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラス
- *2 アイルランド籍外国投資証券（米ドル建て）ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー-ゴールドマン・サックス US\$リキッド・リザーブズ・ファンド X アキュムレーション・クラス

◆投資環境について

＜世界株式市場＞

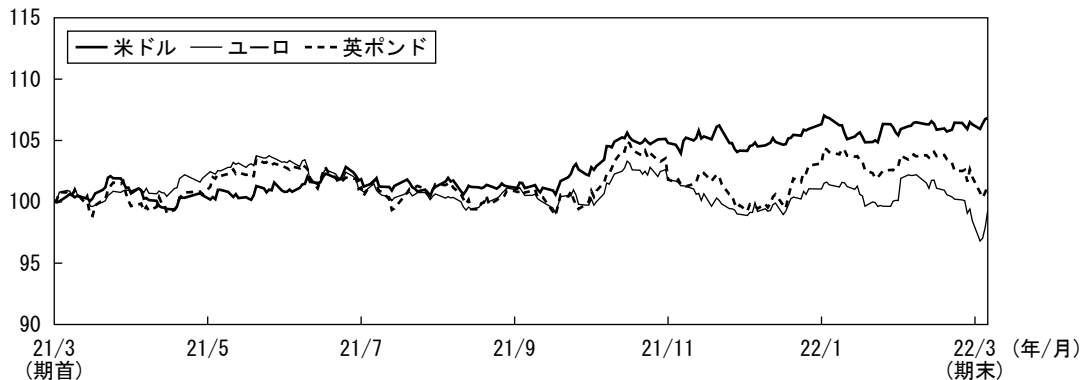
当期の世界株式市場は上昇しました。

期初は、欧米をはじめ主要国で新型コロナウイルスのワクチン接種ペースが加速し、経済活動再開に対する期待から世界株式市場は上昇基調で推移しました。期中盤では、FRB（米連邦準備制度理事会）によるテーパリング（量的緩和の縮小）の早期着手をめぐる懸念が後退したことから世界株式市場は上昇し、好調な動きとなりましたが、資源価格や原材料価格の上昇による企業の減益懸念と、中国景気の減速、南アフリカで出現した新型コロナウイルスの新たな変異株に対する警戒感から下落する場面も見られました。2022年に入ると、FOMC（米連邦公開市場委員会）議事要旨において、早期利上げの可能性が示唆され、予想よりタカ派的との見方が広がり、世界株式市場は下落しました。期末には、ロシアがウクライナに対して軍事侵攻に踏み切ったことが嫌気され、世界株式市場は軟調に推移したものの、前期末比で上昇する結果となりました。

＜外国為替市場＞

外国為替市場では、米ドル、英ポンドなどが円に対して上昇した一方、ユーロなどが下落しました。

○為替レート（対円）の推移



出所：一般社団法人投資信託協会

(注) 各通貨は期首を100として指数化しています。

＜短期金融市場＞

当期において、米国T-Bill 1 ヶ月は前期末の0.03%程度から0.13%程度まで上昇して期末を迎えました。

◆ポートフォリオについて

＜本ファンド＞

本ファンドは、ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオおよびゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンドを主要投資対象とし、期を通じてゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオを概ね高位に組入れることで、日本を含む先進国の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行いました。また、Aコース（為替ヘッジあり）では対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減をめざしました。

＜ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ＞

日本を含む先進国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざしました。

当期においては、国別配分効果がマイナス寄与、銘柄選択効果がプラス寄与となりました。国別配分効果は、米国を中心にマイナス寄与となった一方、銘柄選択効果は、スイスやベルギーなどがプラス寄与となりました。また、当運用では、最新のビッグデータや伝統的な市場・業績データなどをもとに、モメンタム（Momentum）・バリュー（Value）・収益性（Profitability）の投資テーマを通じた数百もの評価基準（MV Pモデル）に基づき、投資対象候補銘柄すべての投資魅力度を総合的に評価した上で、ポートフォリオの最適化を図っていますが、当期は、「モメンタム」、「バリュー」および「収益性」がすべてプラス寄与となりました。

＜ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド＞

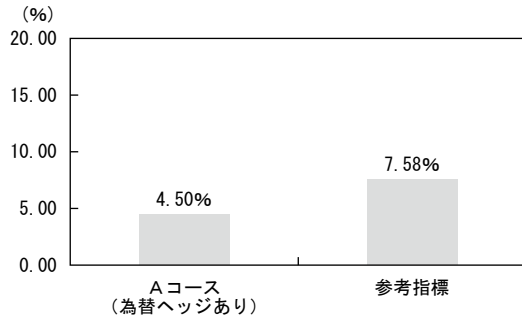
主として米ドル建ての短期金融市場証券に分散投資することにより、元本と流動性を確保しつつ、米ドルベースでの最大限の収益を得ることを目標として運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

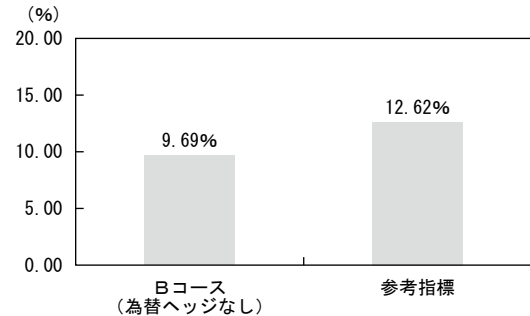
本ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、本ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。

<当期の基準価額と参考指標の対比（騰落率）>

○Aコース（為替ヘッジあり）



○Bコース（為替ヘッジなし）



(注) 各コースの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。

当期のAコース（為替ヘッジあり）のパフォーマンス（分配金再投資ベース）は、+4.50%となった一方、参考指標のパフォーマンスは+7.58%となりました。Bコース（為替ヘッジなし）のパフォーマンス（分配金再投資ベース）は、+9.69%となった一方、参考指標のパフォーマンスは+12.62%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、当期は、Aコース（為替ヘッジあり）およびBコース（為替ヘッジなし）の分配は行わないこととしました。収益分配金に充てなかった収益については、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

今後の運用方針について

<本ファンド>

今後も引き続き、ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオおよびゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンドを主要投資対象とし、期を通じてゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオを高位に組入れ、日本を含む先進国の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。また、Aコース（為替ヘッジあり）では対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減をめざします。

<ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ>

日本を含む先進国の株式を主な投資対象とし、ビッグデータやAI（人工知能）を活用したゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント独自開発の計量モデルを用い、多様な銘柄評価基準に基づいて幅広い銘柄に分散投資することにより、信託財産の長期的な成長をめざします。

<ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド>

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

■本ファンドのデータ

◆本ファンドの組入資産の内容（2022年3月10日現在）

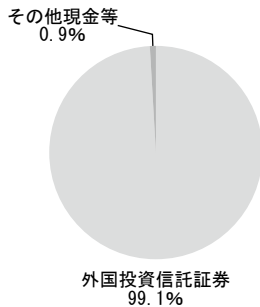
< Aコース（為替ヘッジあり） >

○組入れファンド

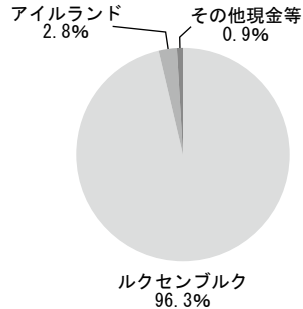
（組入銘柄数：2銘柄）

ファンド名	比率
ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ	96.3%
ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド	2.8%

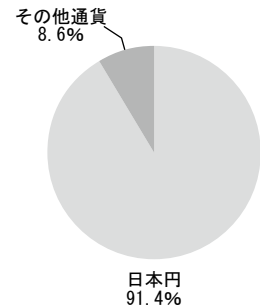
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



（注）上記の比率は全てAコース（為替ヘッジあり）の純資産総額に対する割合です。

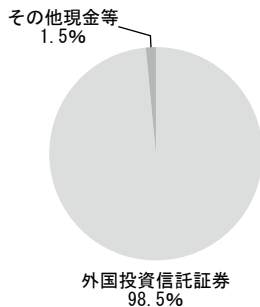
< Bコース（為替ヘッジなし） >

○組入れファンド

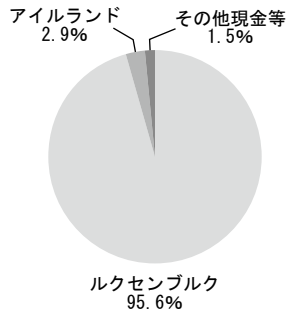
（組入銘柄数：2銘柄）

ファンド名	比率
ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ	95.6%
ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド	2.9%

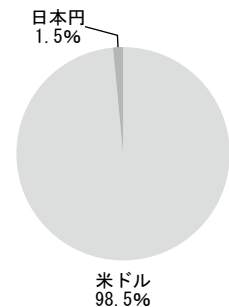
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



（注）上記の比率は全てBコース（為替ヘッジなし）の純資産総額に対する割合です。

◆組入上位ファンドの概要

<ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ> (2021年5月31日現在)

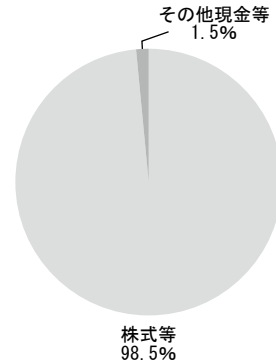
*2022年3月10日時点で入手可能な直近までの状況をご報告申し上げます。

○組入上位10銘柄

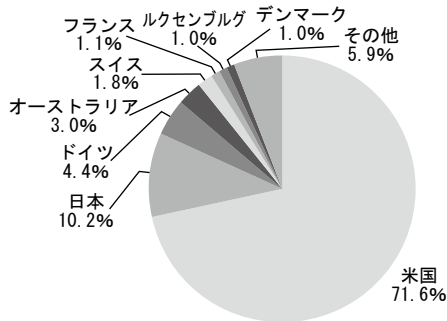
(組入銘柄数：181銘柄)

	銘柄	国	比率
1	アップル	米国	4.7%
2	マイクロソフト	米国	4.2%
3	アルファベット クラスC	米国	3.3%
4	フェイスブック	米国	2.6%
5	アマゾン・ドット・コム	米国	1.6%
6	ジョンソン・エンド・ジョンソン	米国	1.6%
7	アンセム	米国	1.3%
8	HCAヘルスケア	米国	1.2%
9	ペイパル・ホールディングス	米国	1.2%
10	ウォルマート	米国	1.2%

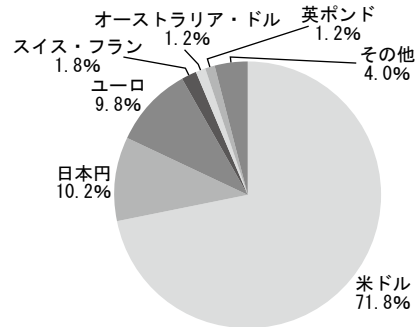
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

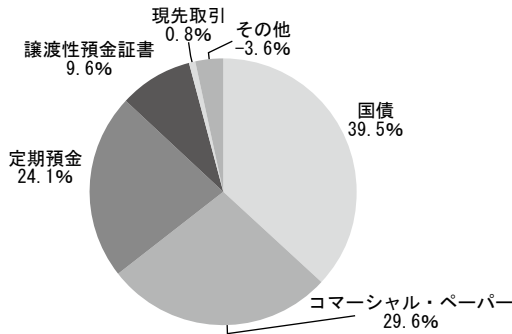


(注) 上記の比率は全て組入れファンドの純資産総額に対する割合です。

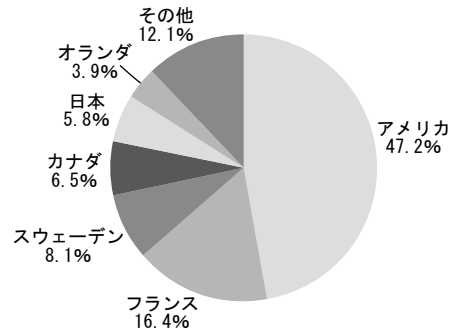
<ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド> (2021年6月30日現在)

*2022年3月10日時点で入手可能な直近までの状況をご報告申し上げます。

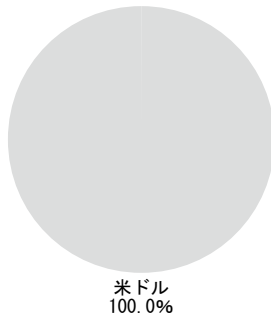
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



○組入上位10銘柄

(組入銘柄数：167銘柄)

	銘柄	種別	通貨	比率
1	United States Treasury Bill 0.085% 2021/7/8	国債	米ドル	5.0%
2	United States Treasury Bill 0.040% 2021/8/5	国債	米ドル	3.9%
3	United States Treasury Bill 0.015% 2021/7/29	国債	米ドル	3.8%
4	Skandinaviska Enskilda Banken AB 0.040% 2021/7/1	定期預金	米ドル	3.4%
5	Swedbank AB 0.030% 2021/7/1	定期預金	米ドル	3.3%
6	United States Treasury Bill 0.045% 2021/7/27	国債	米ドル	3.3%
7	Canadian Imperial Bank of Commerce 0.050% 2021/7/1	定期預金	米ドル	3.2%
8	Societe Generale 0.200% 2021/7/1	定期預金	米ドル	2.8%
9	Societe Generale 0.200% 2021/7/2	定期預金	米ドル	2.8%
10	United States Treasury Bill 0.039% 2021/12/16	国債	米ドル	2.7%

(注) 上記の比率は全て組入れファンドの純資産総額に対する割合です。

Aコース（為替ヘッジあり）

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2021年3月11日～2022年3月10日		
	金額	比率	
信託報酬 （投信会社）	207円 (101)	1.347% (0.660)	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）	(101)	(0.660)	
（受託会社）	(4)	(0.027)	
その他費用 （保管費用）	1 (0)	0.009 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用
（監査費用）	(1)	(0.006)	
（その他）	(0)	(0.003)	
合計	208	1.356	
期中の平均基準価額は15,346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。

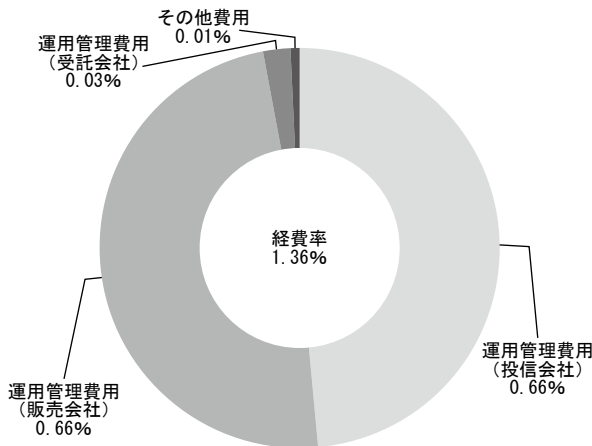
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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）

■経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料、有価証券取引税及び投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）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経費率（年率）は1.36%です。



経費率 (①+②)	1.36%
①このファンドの費用の比率	1.36%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	-%

(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、この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②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注8) 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（2021年3月11日から2022年3月10日まで）

投資信託証券

銘 柄 名	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外		千米ドル		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・ グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラス	—	—	2,630,708	52,300
国				
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシー - ゴールドマン・ サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ ファンド X アキュムレーション・クラス	—	—	92	1,000

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2021年3月11日から2022年3月10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（2022年3月10日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	当 期 末			比 率
	口 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
オフショアファンド	口	千米ドル	千円	%
ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. - ゴールドマン・サックス・ グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラス	10,467,825	195,853	22,720,908	96.3
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシー - ゴールドマン・ サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ ファンド X アキュムレーション・クラス	519	5,592	648,731	2.8
合 計	10,468,344	201,445	23,369,640	<99.1%>

(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

2022年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 23,369,640	% 97.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	614,407	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	23,984,047	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（23,369,640千円）の投資信託財産総額（23,984,047千円）に対する比率は97.4%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=116.01円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2022年3月10日
(A) 資 産	45,213,743,529円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	507,490,903
投 資 証 券(評価額)	23,369,640,856
未 収 入 金	21,336,611,770
(B) 負 債	21,629,015,526
未 払 金	21,432,291,050
未 払 解 約 金	20,710,735
未 払 信 託 報 酬	174,980,106
未 払 利 息	1,246
そ の 他 未 払 費 用	1,032,389
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	23,584,728,003
元 本	16,298,488,656
次 期 繰 越 損 益 金	7,286,239,347
(D) 受 益 権 総 口 数	16,298,488,656口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,470円

■損益の状況

項 目	当 期	
	自 2021年3月11日 至 2022年3月10日	
(A) 配 当 等 収 益	△	313,978円
受 取 利 息		1,799
支 払 利 息	△	315,777
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益		1,052,974,952
売 買 益		4,400,298,827
売 買 損	△	3,347,323,875
(C) 信 託 報 酬 等	△	358,523,710
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)		694,137,264
(E) 前 期 繰 越 損 益 金		3,900,797,334
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金		2,691,304,749
(配 当 等 相 当 額)	(1,627,639,253)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,063,665,496)
(G) 計 (D+E+F)		7,286,239,347
(H) 収 益 分 配 金		0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)		7,286,239,347
追 加 信 託 差 損 益 金		2,691,304,749
(配 当 等 相 当 額)	(1,627,639,253)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,063,665,496)
分 配 準 備 積 立 金		4,595,248,576
繰 越 損 益 金	△	313,978

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

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

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

(注4) 期首元本額は19,058,009,597円、当作成期間中において、追加設定元本額は2,329,677,340円、同解約元本額は5,089,198,281円です。

Bコース（為替ヘッジなし）

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2021年3月11日～2022年3月10日		
	金額	比率	
信託報酬 （投信会社）	217円 (106)	1.347% (0.660)	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）	(106)	(0.660)	
（受託会社）	(4)	(0.027)	
その他費用 （保管費用）	1 (0)	0.007 (0.000)	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 海外資産等の海外保管銀行等に支払う保管・送金・受渡に係る費用 監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 目論見書・運用報告書等の作成・印刷に係る費用、信託事務処理等に要するその他の諸費用
（監査費用）	(1)	(0.003)	
（その他）	(0)	(0.003)	
合計	218	1.354	
期中の平均基準価額は16,135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。

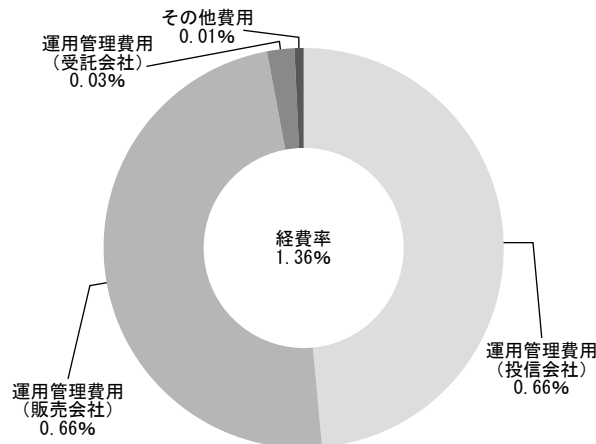
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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）

■経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料、有価証券取引税及び投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）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経費率（年率）は1.36%です。



経費率 (①+②)	1.36%
①このファンドの費用の比率	1.36%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	—%

(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、この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②の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注8) 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（2021年3月11日から2022年3月10日まで）

投資信託証券

銘柄名	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国	口	千米ドル	口	千米ドル
ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. - ゴールドマン・サックス・ グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラス	—	—	9,537,622	189,000

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2021年3月11日から2022年3月10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（2022年3月10日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末			比率
	口数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
オフショアファンド	口	千米ドル	千円	%
ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. - ゴールドマン・サックス・ グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラス	42,982,468	804,201	93,295,472	95.6
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシー - ゴールドマン・ サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ ファンド X アキュムレーション・クラス	2,258	24,327	2,822,210	2.9
合計	42,984,727	828,529	96,117,683	<98.5%>

(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

2022年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 96,117,683	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,459,344	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	98,577,027	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（96,117,683千円）の投資信託財産総額（98,577,027千円）に対する比率は97.5%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=116.01円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2022年3月10日
(A) 資 産	98,577,027,090円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,459,343,750
投 資 証 券(評価額)	96,117,683,340
(B) 負 債	975,790,780
未 払 解 約 金	252,577,733
未 払 信 託 報 酬	719,974,526
未 払 利 息	6,040
そ の 他 未 払 費 用	3,232,481
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	97,601,236,310
元 本	62,688,649,238
次 期 繰 越 損 益 金	34,912,587,072
(D) 受 益 権 総 口 数	62,688,649,238口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,569円

■損益の状況

項 目	当 期
	自 2021年3月11日 至 2022年3月10日
(A) 配 当 等 収 益	△ 1,036,738円
受 取 利 息	5,370
支 払 利 息	△ 1,042,108
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,653,855,801
売 買 損 益	11,381,932,561
売 買 損 益	△ 2,728,076,760
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,463,362,055
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	7,189,457,008
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	17,008,884,268
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,714,245,796
(配 当 等 相 当 額)	(6,462,433,893)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,251,811,903)
(G) 計 (D+E+F)	34,912,587,072
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	34,912,587,072
追 加 信 託 差 損 益 金	10,714,245,796
(配 当 等 相 当 額)	(6,462,433,893)
(売 買 損 益 相 当 額)	(4,251,811,903)
分 配 準 備 積 立 金	24,199,378,014
繰 越 損 益 金	△ 1,036,738

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

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

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

(注4) 期首元本額は75,002,250,713円、当作成期間中において、追加設定元本額は8,105,816,384円、同解約元本額は20,419,417,859円です。

■分配原資の内訳

Aコース（為替ヘッジあり）

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

項 目	第 6 期
	2021年3月11日～2022年3月10日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	4,470

Bコース（為替ヘッジなし）

（単位：円・％、1万口当たり・税引前）

項 目	第 6 期
	2021年3月11日～2022年3月10日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	5,569

（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・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ IOアキュムレーション・スナップ・シェアクラスの状況〉

ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. - ゴールドマン・サックス・グローバル CORE エクイティ・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、GSグローバル・ビッグデータ投資戦略 Aコース（為替ヘッジあり）／Bコース（為替ヘッジなし）が投資対象とする外国投資信託証券です。2022年3月10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（2021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	19,492
スワップ契約を除く支払利息	1,143
有価証券貸付にかかる手数料	12,097
投資顧問報酬	7,020,982
保管費用	235,795
管理事務代行報酬	252,187
販売報酬およびサービシング報酬	654,547
名義書換事務代行報酬	108,066
年次税	311,457
監査報酬	6,633
管理会社報酬	272,365
取締役報酬	14,966
弁護士報酬	49,269
保険費用	7,114
印刷費用	32,178
出版費用	5,656
税務報告報酬	16,251
支払代理人報酬	14,410
規制報告報酬	16,803
その他費用	79,300
	9,130,711
投資顧問報酬調整額	(22)
費用合計	9,130,689

■保有有価証券明細（2021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-98.38%			
オーストラリア			
1,048,768	BHP Group Plc.	31,717,013	0.83
2,216,414	Fortescue Metals Group Ltd.	37,927,914	1.00
141,162	JB Hi-Fi Ltd.	5,254,074	0.14
11,546	Rio Tinto Ltd.	1,099,100	0.03
		75,998,101	2.00
バミューダ			
712,470	Arch Capital Group Ltd.	28,263,685	0.74
カナダ			
6,900	Franco-Nevada Corp.	1,036,057	0.03
46,700	Hydro One Ltd. 144A	1,190,983	0.03
189,800	Magna International, Inc.	18,947,008	0.50
257,209	Superior Plus Corp.	3,195,685	0.08
		24,369,733	0.64

GS グローバル・ビッグデータ投資戦略

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
普通株式			
デンマーク			
511	AP Moller - Maersk A/S "A"	1,344,176	0.04
11,248	AP Moller - Maersk A/S "B"	30,986,074	0.82
16,325	DSV Panalpina A/S	3,979,134	0.10
		<u>36,309,384</u>	<u>0.96</u>
フィンランド			
18,443	Nokian Renkaat OYJ	739,966	0.02
フランス			
234,045	BNP Paribas S.A.	15,953,272	0.42
74,699	Compagnie de Saint-Gobain	5,024,480	0.13
23,129	L'Oreal S.A.	10,461,549	0.28
46,812	Publicis Groupe S.A.	3,168,649	0.08
340,943	Rexel S.A.	6,924,652	0.18
216,159	Schneider Electric S.E.	34,469,860	0.91
		<u>76,002,462</u>	<u>2.00</u>
ドイツ			
107,642	adidas AG	39,180,783	1.03
11,574	Allianz S.E.	3,068,811	0.08
131,045	alstria office REIT-AG	2,394,529	0.06
77,054	BASF S.E.	6,299,328	0.17
115,178	Brenntag S.E.	10,820,046	0.28
64,661	Covestro AG 144A	4,515,274	0.12
604,847	Deutsche Post AG	40,956,091	1.08
232,591	Deutsche Telekom AG	4,831,799	0.13
63,262	Henkel AG & Co. KGaA-Preferred	7,302,093	0.19
33,695	HUGO BOSS AG	1,888,895	0.05
29,140	LANXESS AG	2,168,846	0.06
42,363	Merck KGaA	7,586,200	0.20
26,154	Porsche Automobil Holding S.E.-Preferred	2,906,859	0.08
17,243	Puma S.E.	1,971,834	0.05
15,351	Rheinmetall AG	1,601,963	0.04
74,841	RWE AG	2,856,169	0.08
98,265	Volkswagen AG-Preferred	27,046,882	0.71
		<u>167,396,402</u>	<u>4.41</u>
香港			
555,600	AIA Group Ltd.	7,395,998	0.20
86,500	Techtronic Industries Co., Ltd.	1,632,063	0.04
		<u>9,028,061</u>	<u>0.24</u>
アイルランド			
37,942	Perrigo Co., Plc.	1,745,712	0.05
イタリア			
915,415	Banco BPM SpA	3,222,896	0.08
404,958	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	4,819,116	0.13
40,282	Prysmian SpA	1,383,413	0.04
		<u>9,425,425</u>	<u>0.25</u>
日本			
440,600	Dai Nippon Printing Co., Ltd.	9,579,762	0.25
262,100	Ebara Corp.	12,893,158	0.34
3,313,700	ENEOS Holdings, Inc.	13,686,706	0.36
207,000	Fujitsu Ltd.	33,803,910	0.89
2,672,700	Inpex Corp.	18,258,864	0.48
175,600	JFE Holdings, Inc.	2,371,816	0.06
575,300	Konami Holdings Corp.	37,195,283	0.98
904,900	Konica Minolta, Inc.	5,027,570	0.13
1,498,800	Mitsui & Co., Ltd.	33,237,020	0.88
366,800	NEC Corp.	17,164,899	0.45

GS グローバル・ビッグデータ投資戦略

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
普通株式			
日本			
280,300	NGK Insulators Ltd.	4,982,757	0.13
513,300	Nippon Telegraph & Telephone Corp.	13,887,102	0.37
820,900	Nippon Yusen KK	33,533,700	0.88
1,422,000	Nomura Holdings, Inc.	7,811,493	0.21
114,800	NTT Data Corp.	1,859,054	0.05
1,645,600	ORIX Corp.	29,152,478	0.77
233,100	SoftBank Group Corp.	17,752,602	0.47
2,152,300	Sumitomo Corp.	30,509,011	0.80
130,700	Taiheiyo Cement Corp.	3,046,057	0.08
76,700	Tokyo Electron Ltd.	33,731,655	0.89
4,858,300	Yamada Holdings Co., Ltd.	23,698,259	0.63
		383,183,156	10.10
ルクセンブルク			
38,760	APERAM S.A.	2,130,393	0.06
200,789	ArcelorMittal S.A.	6,490,248	0.17
264,173	Eurofins Scientific S.E.	28,194,625	0.74
		36,815,266	0.97
オランダ			
63,707	ASM International NV	19,755,442	0.52
23,621	NXP Semiconductors NV	4,981,433	0.13
36,306	Signify NV 144A	2,241,970	0.06
		26,978,845	0.71
ノルウェー			
477,658	Golden Ocean Group Ltd.	4,720,190	0.12
1,913,152	Norsk Hydro ASA	12,496,768	0.33
		17,216,958	0.45
スペイン			
3,565,183	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	22,163,201	0.58
84,017	Iberdrola S.A.	1,156,005	0.03
		23,319,206	0.61
スウェーデン			
278,246	Volvo AB "B"	7,341,552	0.19
スイス			
51,200	Chubb Ltd.	8,708,096	0.23
22,921	Compagnie Financiere Richemont S.A.	2,778,611	0.07
267,126	Ferrexpo Plc.	1,704,551	0.04
67,055	Kuehne & Nagel International AG	22,622,130	0.60
48,549	Lonza Group AG	31,324,022	0.83
7,846	Sika AG	2,525,039	0.07
21,218	Tecan Group AG	10,627,844	0.28
		80,290,293	2.12
英国			
245,963	Anglo American Plc.	10,928,061	0.29
1,963,845	CNH Industrial NV	33,829,862	0.89
428,507	Rio Tinto Plc.-ADR	37,395,806	0.99
		82,153,729	2.17
米国			
360,407	Activision Blizzard, Inc.	35,276,637	0.93
473,234	AES Corp.	12,015,411	0.32
770,656	Ally Financial, Inc.	41,877,447	1.10
1,654	Alphabet, Inc. "A"	3,920,245	0.10
52,378	Alphabet, Inc. "C"	126,857,421	3.34
19,194	Amazon.com, Inc.	62,184,721	1.64
14,114	American Financial Group, Inc.	1,865,447	0.05

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
普通株式			
米国			
125,106	Anthem, Inc.	49,805,950	1.31
84,487	Aon Plc. "A"	21,469,414	0.57
1,421,383	Apple, Inc.	178,326,711	4.70
283,197	Applied Materials, Inc.	39,268,096	1.04
6,679	Archer-Daniels-Midland Co.	446,291	0.01
977,211	Axalta Coating Systems Ltd.	31,690,953	0.84
83,909	Baker Hughes Co.	2,037,310	0.05
304,155	Bank of New York Mellon Corp.	15,794,769	0.42
116,451	Biogen, Inc.	31,410,328	0.83
25,430	Camden Property Trust	3,167,688	0.08
274,165	Capital One Financial Corp.	44,030,899	1.16
189,433	Celanese Corp.	31,228,030	0.82
12,131	Chipotle Mexican Grill, Inc.	16,522,058	0.44
114,860	Cigna Corp.	30,000,283	0.79
16,551	Citigroup, Inc.	1,296,605	0.03
58,827	CMS Energy Corp.	3,685,512	0.10
111,870	Costco Wholesale Corp.	42,334,964	1.12
44,064	Danaher Corp.	11,399,797	0.30
282,889	Dick's Sporting Goods, Inc.	27,955,091	0.74
151,803	DocuSign, Inc.	30,809,937	0.81
5,749	Dominion Energy, Inc.	436,981	0.01
285,158	DR Horton, Inc.	27,149,893	0.72
567,393	Duke Realty Corp.	26,378,101	0.70
431,350	Equity LifeStyle Properties, Inc.	30,548,207	0.81
111,008	Estee Lauder Cos., Inc. "A"	34,072,795	0.90
27,166	Evercore, Inc. "A"	3,957,814	0.10
73,415	Eversource Energy	5,989,196	0.16
41,281	Extra Space Storage, Inc.	6,134,357	0.16
297,484	Facebook, Inc. "A"	98,190,544	2.59
240,584	Fidelity National Information Services, Inc.	35,861,451	0.95
53,001	First American Financial Corp.	3,353,903	0.09
181,456	First Industrial Realty Trust, Inc.	9,203,448	0.24
2,557,677	Ford Motor Co.	37,955,927	1.00
524,683	Gentex Corp.	18,552,791	0.49
190,293	Gilead Sciences, Inc.	12,605,008	0.33
220,515	HCA Healthcare, Inc.	47,051,286	1.24
87,529	Herbalife Nutrition Ltd.	4,649,540	0.12
258,275	Hess Corp.	21,976,620	0.58
327,914	Hologic, Inc.	20,793,027	0.55
114,796	International Business Machines Corp.	16,512,257	0.44
802,918	Invitation Homes, Inc.	28,921,106	0.76
127,652	IQVIA Holdings, Inc.	30,590,525	0.81
877,582	Jefferies Financial Group, Inc.	27,819,349	0.73
358,325	Johnson & Johnson	60,929,583	1.61
51,788	KeyCorp	1,183,615	0.03
8,414	KLA Corp.	2,680,869	0.07
86,431	Kohl's Corp.	4,853,101	0.13
449,849	L Brands, Inc.	31,066,572	0.82
78,496	LKQ Corp.	3,970,328	0.10
28,850	Marriott International, Inc. "A"	4,169,690	0.11
140,777	MDU Resources Group, Inc.	4,730,107	0.12
26,194	Mettler-Toledo International, Inc.	34,257,299	0.90
427,859	Micron Technology, Inc.	35,974,385	0.95
638,622	Microsoft Corp.	160,428,233	4.23
543,782	News Corp. "A"	14,676,676	0.39

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
普通株式			
米国			
9,429	Nexstar Media Group, Inc. "A"	1,440,280	0.04
139,469	NortonLifeLock, Inc.	3,902,343	0.10
158,863	Old Dominion Freight Line, Inc.	41,842,926	1.10
16,043	Omnicom Group, Inc.	1,316,649	0.04
49,720	Otis Worldwide Corp.	3,901,031	0.10
115,738	Parker-Hannifin Corp.	35,680,868	0.94
181,854	PayPal Holdings, Inc.	47,502,083	1.25
397,845	Philip Morris International, Inc.	38,499,461	1.01
244,463	Pinterest, Inc. "A"	16,014,771	0.42
338,199	Prologis, Inc.	39,910,864	1.05
5,005	Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	2,500,048	0.07
66,693	Skechers USA, Inc. "A"	3,144,575	0.08
177,973	State Street Corp.	15,433,819	0.41
928,359	Synchrony Financial	43,837,112	1.16
88,045	Take-Two Interactive Software, Inc.	16,464,415	0.43
69,836	Teledyne Technologies, Inc.	29,014,065	0.76
104,382	TJX Cos., Inc.	7,055,179	0.19
12,930	Toll Brothers, Inc.	835,666	0.02
58,561	Torchmark Corp.	6,156,518	0.16
69,356	Union Pacific Corp.	15,622,439	0.41
179,143	United Parcel Service, Inc. "B"	38,435,131	1.01
220,563	Universal Health Services, Inc. "B"	34,959,235	0.92
80,650	Vail Resorts, Inc.	26,373,356	0.70
193,635	VeriSign, Inc.	42,853,362	1.13
119,300	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	25,111,457	0.66
138,953	Visa, Inc. "A"	31,607,639	0.83
621,419	Voya Financial, Inc.	40,591,089	1.07
207,457	W R Berkley Corp.	16,096,589	0.42
327,060	Walmart, Inc.	46,442,520	1.22
117,018	Walt Disney Co.	20,926,329	0.55
59,921	Wayfair, Inc. "A"	19,133,974	0.50
95,463	West Pharmaceutical Services, Inc.	33,101,795	0.87
393,608	Western Digital Corp.	29,831,550	0.79
1,191,482	Western Union Co.	29,262,798	0.77
211,706	Zoetis, Inc.	37,541,825	0.99
		2,646,646,360	69.75
普通株式合計 (取得原価 米ドル 3,008,086,923)		3,733,224,296	98.38
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 3,008,086,923)		3,733,224,296	98.38
デリバティブ取引を除く評価額 (取得原価 米ドル 3,008,086,923)		3,733,224,296	98.38

外国為替予約取引-0.00%

通貨	元本(買)	通貨	元本(売)	償還年月日/満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合 (%)
USD	643,939	EUR	528,000	02/06/2021	1,601	0.00
外国為替予約取引未実現利益					1,601	0.00

特定クラス投資信託証券の外国為替予約取引-0.00%

通貨	元本(買)	通貨	元本(売)	償還年月日/満期日	未実現利益 (米ドル)	投資主資本割合(%)
AUD	180,379	JPY	15,186,283	23/06/2021	950	0.00
CHF	3,650	AUD	5,260	23/06/2021	1	0.00
CHF	12,061	JPY	1,463,518	23/06/2021	90	0.00
EUR	906,197	AUD	1,428,524	23/06/2021	1,876	0.00
EUR	1,195,789	CHF	1,308,285	23/06/2021	2,174	0.00
EUR	2,994,857	JPY	397,487,009	23/06/2021	30,917	0.00
SGD	63,452	AUD	61,641	23/06/2021	424	0.00
SGD	100,579	CAD	91,201	23/06/2021	491	0.00
SGD	83,682	CHF	56,419	23/06/2021	549	0.00
SGD	320,484	EUR	197,503	23/06/2021	1,729	0.00
SGD	131,841	GBP	69,919	23/06/2021	621	0.00
SGD	2,966	ILS	7,247	23/06/2021	11	0.00
SGD	209,697	JPY	17,150,887	23/06/2021	2,472	0.00
SGD	32,530	SEK	203,440	23/06/2021	98	0.00
SGD	2,017,555	USD	1,514,867	23/06/2021	9,221	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益					51,624	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(%)
AUD	86,495	CAD	80,754	23/06/2021	(178)	(0.00)
AUD	71,990	CHF	49,956	23/06/2021	(3)	(0.00)
AUD	275,612	EUR	174,879	23/06/2021	(413)	(0.00)
AUD	113,415	GBP	61,910	23/06/2021	(223)	(0.00)
AUD	2,551	ILS	6,417	23/06/2021	(8)	(0.00)
AUD	4,758	NOK	30,898	23/06/2021	(36)	(0.00)
AUD	1,883	NZD	2,032	23/06/2021	(22)	(0.00)
AUD	27,981	SEK	180,137	23/06/2021	(105)	(0.00)
AUD	8,082	SGD	8,318	23/06/2021	(55)	(0.00)
AUD	1,717,024	USD	1,327,029	23/06/2021	(3,676)	(0.00)
CHF	5,786	CAD	7,782	23/06/2021	(15)	(0.00)
CHF	18,435	EUR	16,853	23/06/2021	(34)	(0.00)
CHF	7,584	GBP	5,966	23/06/2021	(21)	(0.00)
CHF	171	ILS	618	23/06/2021	(1)	(0.00)
CHF	318	NOK	2,978	23/06/2021	(3)	(0.00)
CHF	126	NZD	196	23/06/2021	(2)	(0.00)
CHF	1,872	SEK	17,360	23/06/2021	(10)	(0.00)
CHF	540	SGD	802	23/06/2021	(6)	(0.00)
CHF	114,792	USD	127,887	23/06/2021	(384)	(0.00)
EUR	1,419,360	CAD	2,088,208	23/06/2021	(1,021)	(0.00)
EUR	1,856,841	GBP	1,598,483	23/06/2021	(2,862)	(0.00)
EUR	40,852	ILS	162,058	23/06/2021	(131)	(0.00)
EUR	79,039	NOK	809,274	23/06/2021	(806)	(0.00)
EUR	30,161	NZD	51,309	23/06/2021	(479)	(0.00)
EUR	458,190	SEK	4,648,197	23/06/2021	(1,582)	(0.00)
EUR	132,577	SGD	215,124	23/06/2021	(1,156)	(0.00)
EUR	28,357,007	USD	34,531,251	23/06/2021	(19,693)	(0.00)
SGD	5,531	NOK	34,896	23/06/2021	(5)	(0.00)
SGD	2,188	NZD	2,294	23/06/2021	(10)	(0.00)
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失					(32,940)	(0.00)
投資評価額(取得原価)	米ドル	3,008,086,923)			3,733,244,581	98.38
その他資産・負債					61,470,157	1.62
投資主資本					3,794,714,738	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 3,008,086,923）		3,733,224,296	98.38
外国為替予約取引未実現利益		1,601	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現利益		51,624	0.00
ヘッジ目的の外国為替予約取引未実現損失		(32,940)	(0.00)
その他資産・負債		61,470,157	1.62
投資主資本		3,794,714,738	100.00

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

ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー—ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド（アイルランド籍）は、GSグローバル・ビッグデータ投資戦略 Aコース（為替ヘッジあり）／Bコース（為替ヘッジなし）が投資対象とする外国投資信託証券です。2022年3月10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（2021年6月30日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
投資顧問報酬	21,506,387
管理会社報酬	1,727,090
管理事務代行報酬	562,796
保管費用	1,146,080
名義書換事務代行報酬	505,637
監査報酬	8,626
取締役報酬	20,340
弁護士報酬	9,454
保険費用	313,241
印刷費用	20,324
その他費用	115,088
費用合計	25,935,063
投資顧問報酬調整額	(4,329,086)
運用費用合計	21,605,977

■保有有価証券明細（2021年6月30日現在）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券				
	国債				
700,000,000	United States Cash Management Bill	0.030%	12/10/2021	699,909,875	1.93
690,000,000	United States Cash Management Bill	0.035%	19/10/2021	689,884,039	1.91
227,200,000	United States Treasury Bill	0.041%	06/07/2021	227,199,693	0.63
1,795,400,000	United States Treasury Bill	0.085%	08/07/2021	1,795,393,608	4.96
472,590,000	United States Treasury Bill	0.025%	13/07/2021	472,588,615	1.31
35,500,000	United States Treasury Bill	0.005%	15/07/2021	35,499,927	0.10
13,800,000	United States Treasury Bill	0.015%	20/07/2021	13,799,902	0.04
234,700,000	United States Treasury Bill	0.015%	22/07/2021	234,697,857	0.65
1,200,000,000	United States Treasury Bill	0.045%	27/07/2021	1,199,965,632	3.32
1,376,200,000	United States Treasury Bill	0.015%	29/07/2021	1,376,184,174	3.80
1,400,000,000	United States Treasury Bill	0.040%	05/08/2021	1,399,946,534	3.87
354,000,000	United States Treasury Bill	0.020%	10/08/2021	353,995,285	0.98
554,000,000	United States Treasury Bill	0.015%	12/08/2021	553,989,624	1.53
78,300,000	United States Treasury Bill	0.025%	17/08/2021	78,299,079	0.22
491,000,000	United States Treasury Bill	0.040%	24/08/2021	490,969,985	1.36
297,500,000	United States Treasury Bill	0.022%	26/08/2021	297,490,929	0.82
468,713,500	United States Treasury Bill	0.055%	02/09/2021	468,677,292	1.30
475,000,000	United States Treasury Bill	0.025%	09/09/2021	474,956,134	1.31
537,850,000	United States Treasury Bill	0.025%	16/09/2021	537,798,232	1.49
705,000,000	United States Treasury Bill	0.045%	23/09/2021	704,917,748	1.95

GS グローバル・ビッグデータ投資戦略

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
国債					
1,600,000	United States Treasury Bill	0.050%	02/12/2021	1,599,646	0.00
250,000,000	United States Treasury Bill	0.040%	09/12/2021	249,942,235	0.69
960,000,000	United States Treasury Bill	0.039%	16/12/2021	959,764,800	2.65
521,500,000	United States Treasury Bill	0.055%	23/12/2021	521,362,262	1.44
8,500,000	United States Treasury Bill	0.058%	30/12/2021	8,497,314	0.02
96,740,000	United States Treasury Note/Bond	0.121%	15/07/2021	96,839,117	0.27
152,200,000	United States Treasury Note/Bond	0.069%	31/07/2021	152,486,795	0.42
45,400,000	United States Treasury Note/Bond	0.110%	15/08/2021	45,519,654	0.13
42,400,000	United States Treasury Note/Bond	0.122%	31/08/2021	42,477,324	0.12
11,200,000	United States Treasury Note/Bond	0.128%	31/08/2021	11,227,406	0.03
23,639,100	United States Treasury Note/Bond	0.100%	30/06/2022	23,644,641	0.06
68,400,000	United States Treasury Note/Bond	0.123%	15/07/2022	69,567,609	0.19
国債合計				14,289,092,967	39.50
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券合計				14,289,092,967	39.50
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている以外の譲渡性有価証券					
譲渡性預金証書					
200,000,000	ABN AMRO Bank NV	0.000%	01/07/2021	199,999,664	0.55
314,742,000	ABN AMRO Bank NV	0.170%	05/08/2021	314,694,468	0.87
200,000,000	Bank of Montreal	0.085%	30/07/2021	199,987,280	0.55
100,000,000	FUJIFILM Holdings Corp	0.150%	14/09/2021	99,963,491	0.28
150,000,000	FUJIFILM Holdings Corp	0.150%	15/09/2021	149,944,196	0.41
79,000,000	Industrial & Commercial Bank of China Ltd	0.250%	12/07/2021	79,000,868	0.22
190,000,000	KBC Bank NV	0.070%	01/07/2021	190,000,000	0.53
288,000,000	KBC Bank NV	0.140%	07/09/2021	287,923,841	0.79
192,500,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	0.150%	16/07/2021	192,500,785	0.53
187,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	0.195%	03/08/2021	186,976,507	0.52
100,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	0.135%	17/09/2021	99,969,068	0.28
130,000,000	National Bank of Kuwait	0.300%	08/07/2021	130,001,097	0.36
136,685,000	National Bank of Kuwait	0.200%	26/07/2021	136,685,000	0.38
72,000,000	National Bank of Kuwait	0.290%	20/08/2021	72,006,407	0.20
86,000,000	National Bank of Kuwait	0.250%	13/09/2021	86,007,875	0.24
88,095,000	National Bank of Kuwait	0.230%	16/09/2021	88,099,193	0.24
167,000,000	Norinchukin Bank	0.170%	06/07/2021	167,000,386	0.46
190,750,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	0.070%	01/07/2021	190,750,000	0.53
243,750,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	0.070%	02/07/2021	243,750,000	0.67
339,400,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	0.150%	16/07/2021	339,402,905	0.94
譲渡性預金証書合計				3,454,663,031	9.55
コマーシャル・ペーパー					
200,000,000	Agence Centrale Des Organismes De Securite Sociale	0.000%	01/07/2021	199,999,494	0.55
272,246,000	Agence Centrale Des Organismes De Securite Sociale	0.150%	06/07/2021	272,240,046	0.75
93,000,000	Agence Centrale Des Organismes De Securite Sociale	0.090%	12/07/2021	92,997,372	0.26
87,000,000	Agence Centrale Des Organismes De Securite Sociale	0.086%	15/07/2021	86,997,253	0.24
163,157,000	Agence Centrale Des Organismes De Securite Sociale	0.195%	15/07/2021	163,145,510	0.45
65,099,000	Agricultural Bank of China Ltd	0.205%	24/08/2021	65,081,594	0.18
45,000,000	Albion Capital LLC	0.100%	02/07/2021	44,999,750	0.12
43,008,000	Albion Capital LLC	0.180%	27/07/2021	43,002,838	0.12
13,103,000	Albion Capital LLC	0.130%	23/09/2021	13,098,669	0.04
73,590,000	Antalis	0.170%	09/07/2021	73,586,625	0.20
76,000,000	Antalis	0.130%	15/07/2021	75,996,357	0.21
30,280,000	Antalis	0.180%	15/07/2021	30,277,718	0.08
75,000,000	Antalis	0.150%	28/07/2021	74,992,283	0.21

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	コマーシャル・ペーパー				
31,450,000	Antalis	0.170%	04/08/2021	31,444,771	0.09
21,110,000	Antalis	0.170%	05/08/2021	21,106,390	0.06
19,575,000	Antalis	0.170%	11/08/2021	19,571,666	0.05
27,000,000	Antalis	0.190%	12/08/2021	26,995,037	0.07
37,041,000	Antalis	0.170%	12/08/2021	37,034,986	0.10
200,000,000	Barclays Bank Plc	0.190%	08/07/2021	199,991,512	0.55
40,041,000	Barclays Bank Plc	0.170%	03/08/2021	40,033,778	0.11
119,841,000	Barclays Bank Plc	0.170%	04/08/2021	119,818,749	0.33
165,000,000	Barclays Bank Plc	0.155%	13/08/2021	164,967,099	0.46
58,000,000	Barclays Bank UK Plc	0.150%	26/07/2021	57,994,096	0.16
79,250,000	Bedford Row Funding Corp	0.130%	04/08/2021	79,240,674	0.22
58,000,000	BNG Bank NV	0.000%	01/07/2021	57,999,936	0.16
290,000,000	BNG Bank NV	0.055%	06/07/2021	289,997,347	0.80
176,261,000	BNG Bank NV	0.050%	15/07/2021	176,257,330	0.49
100,000,000	BNP Paribas	0.000%	01/07/2021	99,999,833	0.28
426,000,000	BNP Paribas	0.090%	06/07/2021	425,993,610	1.18
170,000,000	BNP Paribas	0.150%	12/07/2021	169,993,135	0.47
165,000,000	BNP Paribas	0.150%	13/07/2021	164,992,783	0.46
50,000,000	BNZ International Funding Ltd	0.140%	27/07/2021	49,996,440	0.14
127,000,000	Caisse D'Amortissement De La Dette Sociale	0.090%	10/09/2021	126,975,295	0.35
197,042,000	Caisse Des Depots ET Consignations	0.050%	16/07/2021	197,038,043	0.54
40,000,000	Cancara Asset Securitisation LLC	0.120%	06/07/2021	39,999,200	0.11
14,800,000	Cancara Asset Securitisation LLC	0.145%	14/07/2021	14,799,108	0.04
340,000,000	Chesham Finance Ltd - Series II	0.000%	01/07/2021	339,998,773	0.94
220,000,000	Chesham Finance Ltd - Series III	0.000%	01/07/2021	219,999,512	0.61
68,000,000	Chesham Finance Ltd - Series V	0.000%	01/07/2021	67,999,849	0.19
50,500,000	China Construction Bank Corp	0.250%	09/07/2021	50,497,044	0.14
234,356,000	Citigroup Global Markets Inc	0.130%	02/08/2021	234,331,292	0.65
224,004,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	0.150%	16/07/2021	223,989,072	0.62
61,300,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	0.090%	21/07/2021	61,296,891	0.17
44,500,000	Columbia Funding Co LLC	0.160%	07/07/2021	44,498,226	0.12
133,188,000	DBS Bank Ltd	0.000%	01/07/2021	133,187,515	0.37
127,701,000	DBS Bank Ltd	0.145%	09/07/2021	127,696,765	0.35
95,000,000	Dexia Credit Local	0.080%	14/09/2021	94,977,739	0.26
330,000,000	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0.000%	01/07/2021	329,999,634	0.91
20,000,000	Fairway Finance Company LLC	0.121%	02/07/2021	19,999,965	0.06
40,000,000	Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec	0.145%	02/07/2021	39,999,739	0.11
170,000,000	Federation Des Caisses Desjardins Du Quebec	0.100%	12/07/2021	169,994,339	0.47
215,000,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	0.160%	09/07/2021	214,993,683	0.59
197,916,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	0.160%	02/08/2021	197,895,132	0.55
194,350,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	0.150%	19/08/2021	194,329,739	0.54
83,247,000	Fms Wertmanagement	0.145%	08/07/2021	83,244,669	0.23
180,000,000	Fms Wertmanagement	0.060%	14/07/2021	179,995,948	0.50
94,000,000	ING (U.S.) Funding LLC	0.120%	18/08/2021	93,990,397	0.26
195,000,000	Ionic Capital II Trust	0.000%	01/07/2021	194,999,052	0.54
57,000,000	Ionic Capital II Trust	0.180%	08/07/2021	56,997,750	0.16
195,000,000	Ionic Capital II Trust	0.110%	29/07/2021	194,983,872	0.54
200,000,000	La Banque Postale SA	0.200%	26/07/2021	199,980,942	0.55
30,000,000	Liberty Street Funding LLC	0.130%	05/08/2021	29,995,653	0.08
31,969,000	Lime Funding LLC	0.140%	13/07/2021	31,967,410	0.09
20,000,000	Lime Funding LLC	0.110%	06/08/2021	19,997,867	0.06

GS グローバル・ビッグデータ投資戦略

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	コマーシャル・ペーパー				
25,000,000	Lime Funding LLC	0.150%	13/08/2021	24,996,287	0.07
80,750,000	Macquarie Bank Ltd	0.150%	15/07/2021	80,744,919	0.22
97,500,000	Macquarie Bank Ltd	0.150%	16/07/2021	97,493,373	0.27
63,000,000	Macquarie Bank Ltd	0.140%	18/08/2021	62,990,477	0.17
50,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	0.000%	01/07/2021	49,999,860	0.14
50,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	0.130%	08/07/2021	49,998,877	0.14
45,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	0.150%	02/08/2021	44,994,186	0.12
132,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	0.093%	19/08/2021	131,983,681	0.37
20,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	0.150%	03/09/2021	19,995,720	0.05
75,000,000	Matchpoint Finance Plc	0.000%	01/07/2021	74,999,780	0.21
28,839,000	Matchpoint Finance Plc	0.150%	06/07/2021	28,838,255	0.08
20,000,000	Matchpoint Finance Plc	0.150%	12/07/2021	19,998,967	0.06
65,000,000	Matchpoint Finance Plc	0.130%	02/08/2021	64,992,711	0.18
130,000,000	Matchpoint Finance Plc	0.160%	20/08/2021	129,983,393	0.36
33,700,000	Maybank Singapore Ltd	0.170%	02/08/2021	33,696,136	0.09
88,000,000	Mizuho Bank Ltd	0.155%	26/07/2021	87,989,761	0.24
200,000,000	Mizuho Bank Ltd	0.145%	31/08/2021	199,943,182	0.55
225,000,000	Nationwide Building Society	0.060%	08/07/2021	224,997,039	0.62
51,771,000	Nationwide Building Society	0.055%	09/07/2021	51,770,289	0.14
79,350,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp	0.150%	22/07/2021	79,342,974	0.22
65,000,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp	0.130%	02/08/2021	64,991,956	0.18
100,000,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp	0.140%	16/08/2021	99,988,126	0.28
34,050,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp	0.110%	02/09/2021	34,043,645	0.09
147,500,000	NRW Bank	0.040%	06/07/2021	147,499,168	0.41
136,400,000	NRW Bank	0.080%	13/07/2021	136,396,418	0.38
54,400,000	NRW Bank	0.070%	29/07/2021	54,396,979	0.15
88,315,000	Regency Markets No. 1 LLC	0.070%	16/07/2021	88,312,339	0.24
119,082,000	Regency Markets No. 1 LLC	0.100%	20/07/2021	119,075,386	0.33
57,000,000	Ridgefield Funding Co LLC	0.150%	16/08/2021	56,994,343	0.16
100,000,000	Salisbury Receivables Company LLC	0.160%	06/07/2021	99,995,581	0.28
133,653,000	Salisbury Receivables Company LLC	0.090%	10/09/2021	133,586,375	0.37
10,000,000	Satellite	0.190%	26/07/2021	9,998,691	0.03
35,000,000	Sheffield Receivables Co LLC	0.140%	02/08/2021	34,995,351	0.10
135,000,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	0.090%	31/08/2021	134,988,148	0.37
25,000,000	Verizon Communications Inc	0.150%	06/07/2021	24,999,354	0.07
50,500,000	Verizon Communications Inc	0.090%	13/09/2021	50,487,901	0.14
10,000,000	Victory Receivables Corp	1.337%	07/07/2021	9,999,728	0.03
70,000,000	Victory Receivables Corp	0.140%	27/07/2021	69,993,172	0.19
85,000,000	Victory Receivables Corp	0.140%	03/08/2021	84,989,560	0.23
	コマーシャル・ペーパー合計			10,715,976,884	29.62
	現先取引				
300,000,000	BNP Paribas Repo	0.050%	01/07/2021	300,000,000	0.83
	現先取引合計			300,000,000	0.83
	公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている以外の譲渡性有価証券合計			14,470,639,915	40.00
	預金				
	定期預金				
300,000,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	0.080%	01/07/2021	300,000,000	0.83
1,150,000,000	Canadian Imperial Bank of Commerce	0.050%	01/07/2021	1,150,000,000	3.18
650,000,000	Credit Industriel et Commercial	0.080%	01/07/2021	650,000,000	1.80
900,000,000	DNB Bank ASA	0.030%	01/07/2021	900,000,000	2.49
500,000,000	National Bank of Canada	0.030%	01/07/2021	500,000,000	1.38

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	定期預金				
1,222,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB	0.040%	01/07/2021	1,222,000,000	3.38
1,000,000,000	Societe Generale	0.200%	01/07/2021	1,000,000,000	2.76
1,000,000,000	Societe Generale	0.200%	02/07/2021	1,000,000,000	2.76
500,000,000	Svenska Handelsbanken AB	0.030%	01/07/2021	500,000,000	1.38
1,200,000,000	Swedbank AB	0.030%	01/07/2021	1,200,000,000	3.32
300,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	0.070%	01/07/2021	300,000,000	0.83
定期預金合計				8,722,000,000	24.11
預金合計				8,722,000,000	24.11
投資資産合計				37,481,732,882	103.61
投資合計					
				評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
国債合計				14,289,092,967	39.50
譲渡性預金証書合計				3,454,663,031	9.55
コマーシャル・ペーパー合計				10,715,976,884	29.62
現先取引合計				300,000,000	0.83
定期預金合計				8,722,000,000	24.11
その他資産・負債				(1,307,677,372)	(3.61)
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産				36,174,055,510	100.00