

GSビッグデータ・ストラテジー
(米国小型株)

Aコース(為替ヘッジあり)

第13期末(2023年8月10日)		第13期	
基準価額	9,629円	騰落率	-0.89%
純資産総額	1,775百万円	分配金合計	0円

Bコース(為替ヘッジなし)

第13期末(2023年8月10日)		第13期	
基準価額	11,063円	騰落率	11.12%
純資産総額	8,440百万円	分配金合計	990円

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

■本ファンドの仕組みは次のとおりです。

商品分類	追加型投信/海外/株式
信託期間	原則として無期限
運用方針	主として米国の小型株式を主要投資対象とし、計量分析を用いて投資対象のリターン予測を行うと同時にポートフォリオのリスク・リターン特性の最適化プロセスを経ることによりリスク管理を行う投資信託証券への投資を通じ、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	
本ファンド	以下の指定投資信託証券を主要投資対象とします。 ・ルクセンブルク籍外国投資証券 ゴールドマン・サックス・ファンズ S. I. C. A. V. ①ゴールドマン・サックスUSスモール・キャップ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	米国の小型株式
指定投資信託証券②	米ドル建ての短期の市場性を有する金融市場証券
運用方法・組入制限	①外貨建資産については、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。 ②投資信託証券への投資は、高位に維持することを基本とします。 ③株式への直接投資は行いません。
分配方針	原則として毎計算期末(毎年2月10日および8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/海外/株式

第13期(決算日2023年8月10日)

作成対象期間:2023年2月11日~2023年8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ビッグデータ・ストラテジー(米国小型株)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13期の決算を行いました。本ファンドは、米国の小型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

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）Aコース（為替ヘッジあり）

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）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 総 額
9期（2021年8月10日）	11,102	980	2.5	15,378	△1.9	98.4	3,061
10期（2022年2月10日）	10,586	180	△3.0	14,070	△8.5	99.9	2,743
11期（2022年8月10日）	9,610	0	△9.2	13,214	△6.1	97.9	2,328
12期（2023年2月10日）	9,715	0	1.1	12,609	△4.6	100.8	2,022
13期（2023年8月10日）	9,629	0	△0.9	12,344	△2.1	102.7	1,775

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。

（注2）参考指標は、2017年4月7日を10,000として指数化しております。

（注3）参考指標は、2023年5月31日まではラッセル2000インデックス（配当除く、円ヘッジ・ベース）、2023年6月1日からはラッセル2000インデックス（配当込み、円ヘッジ・ベース）です。

■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） 2023年2月10日	9,715	—	12,609	—	100.8
2月末	9,470	△2.5	12,441	△1.3	102.5
3月末	8,883	△8.6	11,778	△6.6	99.3
4月末	8,668	△10.8	11,512	△8.7	99.3
5月末	8,874	△8.7	11,328	△10.2	101.3
6月末	9,364	△3.6	12,212	△3.2	104.3
7月末	9,788	0.8	12,892	2.2	101.7
（期 末） 2023年8月10日	9,629	△0.9	12,344	△2.1	102.7

（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）参考指標は、2017年4月7日を10,000として指数化しております。

（注3）参考指標は、2023年5月31日まではラッセル2000インデックス（配当除く、円ヘッジ・ベース）、2023年6月1日からはラッセル2000インデックス（配当込み、円ヘッジ・ベース）です。

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）Bコース（為替ヘッジなし）

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）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 金 分 配	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
9期（2021年8月10日）	11,406	1,250	7.9	16,383	3.6	98.4	10,938
10期（2022年2月10日）	11,024	550	1.5	15,740	△ 3.9	99.9	10,081
11期（2022年8月10日）	11,116	720	7.4	17,219	9.4	99.7	9,670
12期（2023年2月10日）	10,847	340	0.6	16,674	△ 3.2	99.8	8,848
13期（2023年8月10日）	11,063	990	11.1	18,408	10.4	98.4	8,440

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。

（注2）参考指標は、2017年4月7日を10,000として指数化しております。

（注3）参考指標は、2023年5月31日まではラッセル2000インデックス（配当除く、円ベース）、2023年6月1日からはラッセル2000インデックス（配当込み、円ベース）です。

■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） 2023年2月10日	10,847	—	16,674	—	99.8
2月末	10,968	1.1	17,101	2.6	99.1
3月末	10,145	△ 6.5	15,876	△ 4.8	99.0
4月末	9,982	△ 8.0	15,941	△ 4.4	99.1
5月末	10,692	△ 1.4	16,178	△ 3.0	99.3
6月末	11,736	8.2	18,088	8.5	100.2
7月末	11,979	10.4	18,865	13.1	99.8
（期 末） 2023年8月10日	12,053	11.1	18,408	10.4	98.4

（注1）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

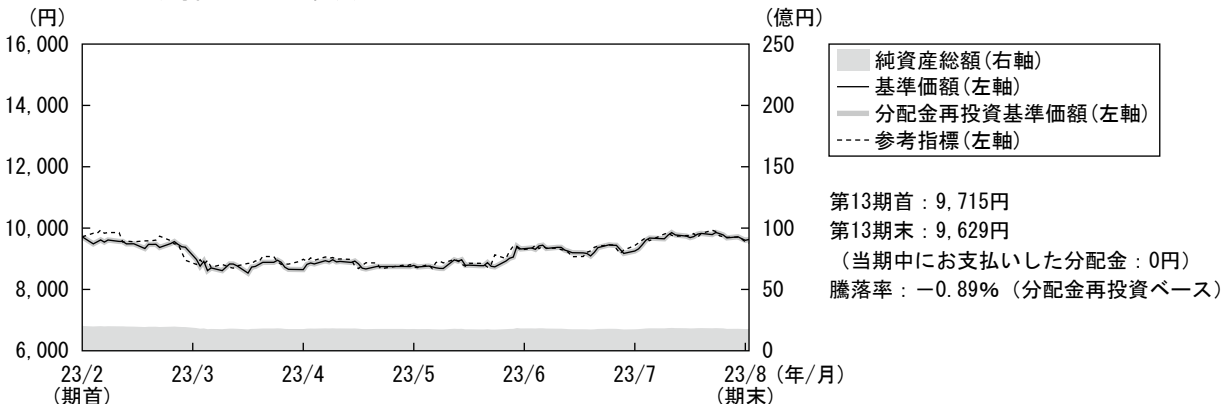
（注2）参考指標は、2017年4月7日を10,000として指数化しております。

（注3）参考指標は、2023年5月31日まではラッセル2000インデックス（配当除く、円ベース）、2023年6月1日からはラッセル2000インデックス（配当込み、円ベース）です。

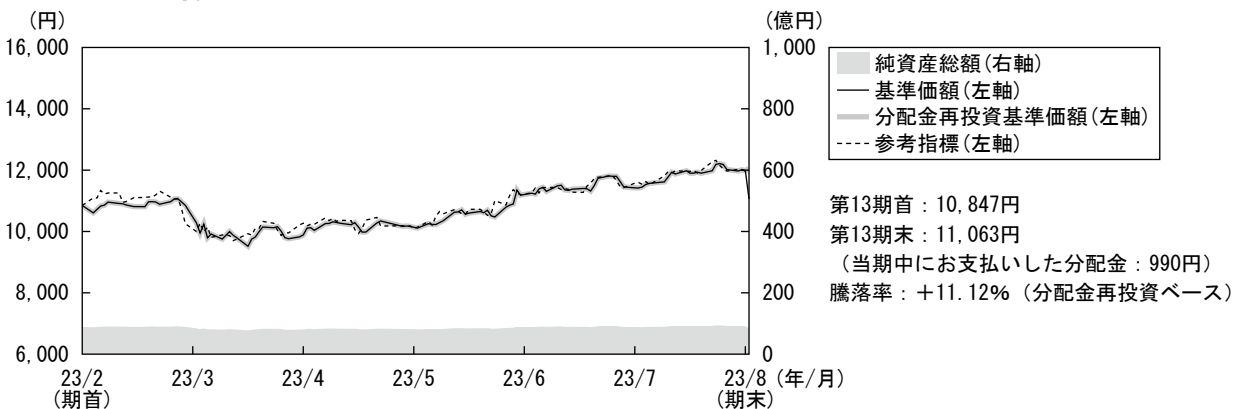
■運用経過

◆基準価額等の推移について（2023年2月11日～2023年8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）はラッセル2000インデックス（配当込み、円ヘッジ・ベース）、Bコース（為替ヘッジなし）はラッセル2000インデックス（配当込み、円ベース）であり*、投資対象資産の市場動向を説明する代表的な指数として記載しています。

* 2023年5月31日までは、配当を含まない参考指標です（Aコースはラッセル2000インデックス（配当除く、円ヘッジ・ベース）、Bコースはラッセル2000インデックス（配当除く、円ベース））。

(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9,715円から86円下落し、期末には9,629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10,847円から216円上昇し、期末には11,063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

投資テーマである「モメンタム」、「バリュー」、「収益性」のいずれも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。Bコース（為替ヘッジなし）においては、米ドル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

Bコース（為替ヘッジなし）においては、日本円と米ドルの金利差に由来する外国為替リスクのヘッジコスト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USスモール・キャップ COREエクイティ・ポートフォリオ* ¹	2.54%	12.08%
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	2.59%	12.13%

（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USスモール・キャップ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

＜米国株式市場＞

当期の米国株式市場は、大型株で構成されるS & P 500種株価指数は期初に一時調整したものの期を通じて上昇しましたが、小型株で構成されるラッセル2000指数は期初から大きく下落し、その後後半に回復したもののほぼ横ばいとなりました。

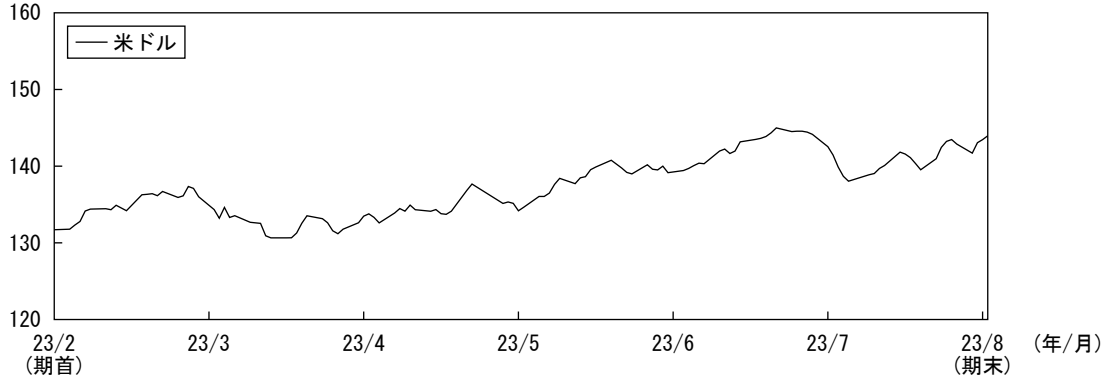
1月の米雇用統計やインフレ指標の伸び率が市場予想を上回ったことを背景に米長期金利が上昇したことを受け、米国株式市場は期初から下落基調で推移しました。3月上旬には、米国大手地銀の破綻や欧州大手銀行の救済合併を受けてリスクオフのムードが広がり、米国株式市場は一時急落しました。その後金融システム不安に対する様々な手当が講じられたことで懸念が後退し、大型株は上昇したものの、米国の景気後退懸念が高まったことを背景に小型株は5月末まで横ばいで推移しました。6月になると、米雇用統計の強弱入り交じる結果を背景に、FRB（米連邦準備制度理事会）による利上げ見送りや米債務上限問題の決着などが支えとなり、米国株式市場は上昇しました。7月中旬は、米CPI（消費者物価指数）の伸び率が鈍化したことにより、利上げの停止が近づいているとの見方が強まったことで投資家心理が改善し、米国株式市場は期初の下落幅を期末にかけて上回る、もしくは戻す形で期を終えました。

＜外国為替市場＞

外国為替市場では、米ドルは円に対して上昇しました。

○為替レート（対円）の推移

（円／ドル）



出所：一般社団法人投資信託協会

＜短期金融市場＞

当期において、米国T-Bill 1 ヶ月は前期末の4.04%程度から5.26%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USスモール・キャップ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USスモール・キャップ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、米国の小型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USスモール・キャップCOREエクイティ・ポートフォリオ＞

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

当運用では、最新のビッグデータや伝統的な市場・業績データ等をもとに、モメンタム（Momentum）・バリュー（Value）・収益性（Profitability）の投資テーマを通じた評価基準（MVPモデル）に基づき、投資魅力度を総合的に評価していますが、当期は、投資テーマでは、モメンタム、バリュー、収益性がすべてプラス寄与となりました。銘柄選択では、金融、情報技術などのセクターにおいてプラス寄与となった一方、不動産、エネルギーなどのセクターにおいてマイナス寄与となりました。

＜ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド＞

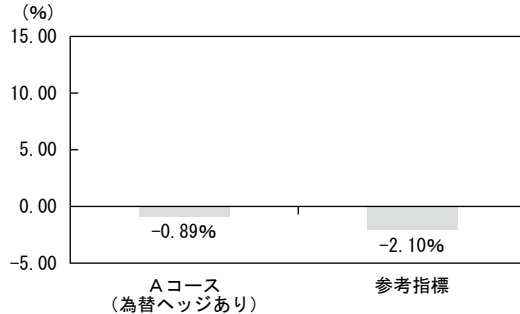
主として米ドル建ての短期金融市場証券に分散投資することにより、元本と流動性を確保しつつ、米ドルベースでの最大限の収益を得ることを目標として運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

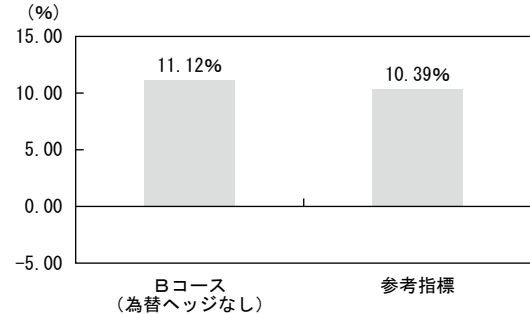
本ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。以下のグラフは、本ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。

<当期の基準価額と参考指標の対比（騰落率）>

○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-0.89%となった一方、参考指標のパフォーマンスは-2.10%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+11.12%となった一方、参考指標のパフォーマンスは+10.39%となりました。

◆分配金について

収益分配金（1万口当たり、税引前）については、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）の分配は行わないこととしました。Bコース（為替ヘッジなし）は990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、ゴールドマン・サックスUSスモール・キャップ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USスモール・キャップCOREエクイティ・ポートフォリオを高位に組入れ、米国の小型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USスモール・キャップCOREエクイティ・ポートフォリオ>

米国の小型株式を主要投資対象とし、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（2023年8月10日現在）

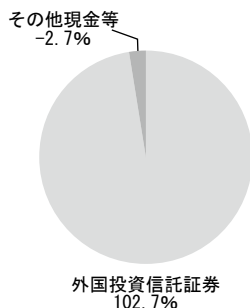
< Aコース（為替ヘッジあり） >

○組入れファンド

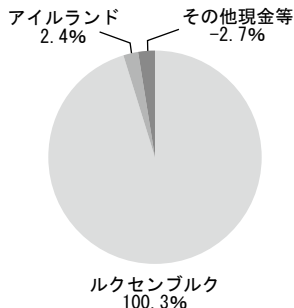
（組入銘柄数：2銘柄）

ファンド名	比率
ゴールドマン・サックスUSスモール・キャップ COREエクイティ・ポートフォリオ	100.3%
ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド	2.4%

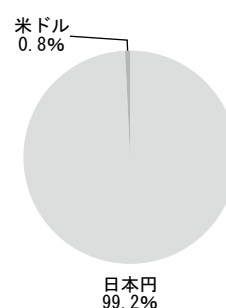
○資産別配分



○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。

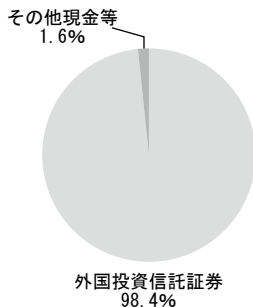
< Bコース（為替ヘッジなし） >

○組入れファンド

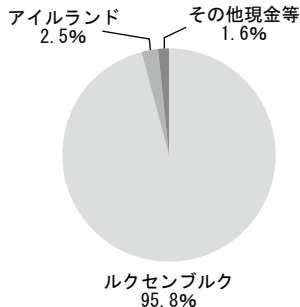
（組入銘柄数：2銘柄）

ファンド名	比率
ゴールドマン・サックスUSスモール・キャップ COREエクイティ・ポートフォリオ	95.8%
ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド	2.5%

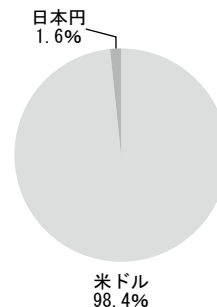
○資産別配分



○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USスモール・キャップCOREエクイティ・ポートフォリオ>（2022年11月30日現在）

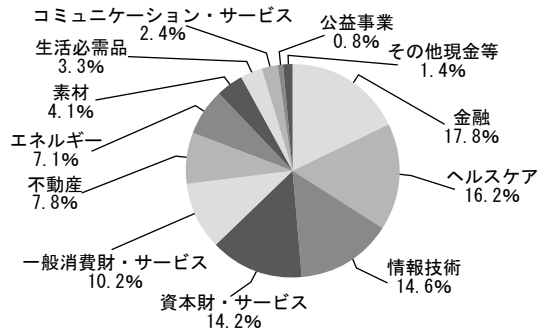
*2023年8月10日時点で入手可能な直近までの状況をご報告申し上げます。

○組入上位10銘柄

（組入銘柄数：516銘柄）

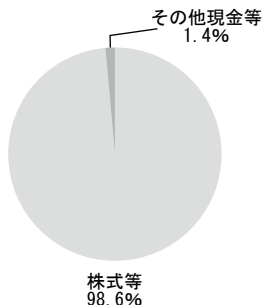
	銘柄名	業種*	比率
1	アトコア	資本財・サービス	0.8%
2	STAGインダストリアル	不動産	0.8%
3	マキシマス	情報技術	0.8%
4	ミュラー・インダストリーズ	資本財・サービス	0.8%
5	ONEガス	公益事業	0.8%
6	Magnolia Oil & Gas Corp	エネルギー	0.8%
7	EXLサービス・ホールディングス	情報技術	0.8%
8	CNOファイナンシャル・グループ	金融	0.8%
9	マーフィーUSA	一般消費財・サービス	0.7%
10	エクスポーネント	資本財・サービス	0.7%

○業種*別配分

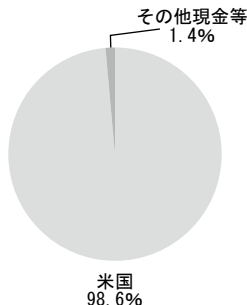


業種は、Global Industry Classification Standard (GICS)（世界産業分類基準）のセクター分類を使用しています。

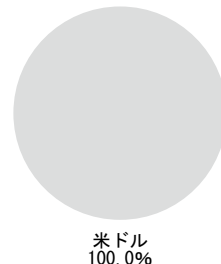
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

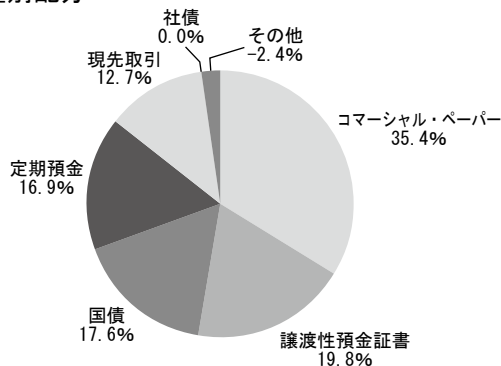


（注）上記の比率は全て組入れファンドの純資産総額に対する割合です。

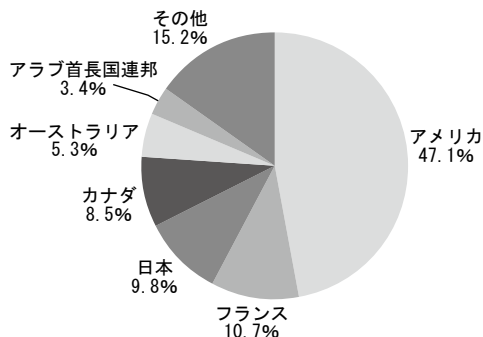
<ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド>（2022年12月31日現在）

*2023年8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。

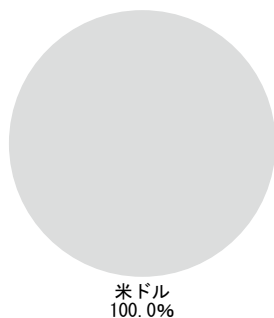
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



○組入上位10銘柄

（組入銘柄数：242銘柄）

	銘柄	種別	通貨	比率
1	State Street Bank And Trust Go Repo 4.300% 2023/1/3	現先取引	米ドル	8.4%
2	Australia & New Zealand Banking Group Ltd 4.320% 2023/1/3	定期預金	米ドル	3.2%
3	Federal Home Loan Banks 4.320% 2023/3/20	国債	米ドル	2.9%
4	Banco Santander SA 4.300% 2023/1/3	定期預金	米ドル	2.7%
5	Canadian Imperial Bank of Commerce 4.300% 2023/1/3	定期預金	米ドル	2.6%
6	Societe Generale 4.430% 2023/1/4	定期預金	米ドル	2.3%
7	Societe Generale 4.430% 2023/1/3	定期預金	米ドル	2.3%
8	Federal Farm Credit Banks Funding Corp 4.360% 2023/8/1	国債	米ドル	1.7%
9	Citigroup Global Markets Inc Repo 4.300% 2023/1/3	現先取引	米ドル	1.5%
10	Federal Home Loan Bank Discount Notes 4.434% 2023/3/22	国債	米ドル	1.5%

（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
	2023年2月11日～2023年8月10日		
	金額	比率	
信託報酬 （投信会社）	71円 (35)	0.777% (0.382)	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、運用報告書等各种種類の送付、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）	(35)	(0.382)	
（受託会社）	(1)	(0.014)	
その他費用 （保管費用）	4 (2)	0.041 (0.027)	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)	(0.005)	
（その他）	(1)	(0.009)	
合計	75	0.818	

期中の平均基準価額は9,174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。

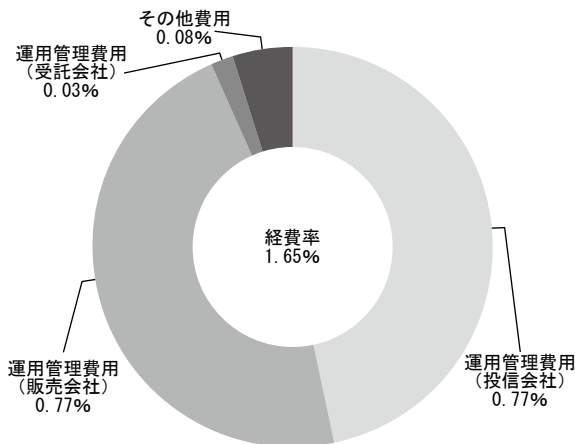
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.65%です。



経費率 (①+②)	1.65%
①このファンドの費用の比率	1.65%
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（2023年2月11日から2023年8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	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 USスモール・キャップ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	13,449	200	200,891	3,100
国	-	-	8	100
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ビーエルシー-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				

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月11日から2023年8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（2023年8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 USスモール・キャップ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	748,031	12,372	1,781,137	100.3
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ビーエルシー-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	25	292	42,071	2.4
合計	748,057	12,664	1,823,209	<102.7%>

(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

2023年8月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 1,823,209	% 97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	41,658	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	1,864,867	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（1,823,209千円）の投資信託財産総額（1,864,867千円）に対する比率は97.8%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=143.96円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2023年8月10日
(A) 資 産	3,604,003,692円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	41,658,162
投 資 証 券 (評価額)	1,823,209,050
未 収 入 金	1,739,136,480
(B) 負 債	1,828,263,129
未 払 金	1,813,464,170
未 払 解 約 金	378,723
未 払 信 託 報 酬	14,160,193
未 払 利 息	114
そ の 他 未 払 費 用	259,929
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,775,740,563
元 本	1,844,235,313
次 期 繰 越 損 益 金	△ 68,494,750
(D) 受 益 権 総 口 数	1,844,235,313口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,629円

■損益の状況

項 目	当 期
	自 2023年2月11日 至 2023年8月10日
(A) 配 当 等 収 益	△ 13,953円
受 取 利 息	2
支 払 利 息	△ 13,955
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 477,295
売 買 益	280,247,739
売 買 損	△280,725,034
(C) 信 託 報 酬 等	△ 14,909,739
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 15,400,987
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△134,927,816
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	81,834,053
(配 当 等 相 当 額)	(43,208,934)
(売 買 損 益 相 当 額)	(38,625,119)
(G) 計 (D + E + F)	△ 68,494,750
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 68,494,750
追 加 信 託 差 損 益 金	81,834,053
(配 当 等 相 当 額)	(43,208,934)
(売 買 損 益 相 当 額)	(38,625,119)
分 配 準 備 積 立 金	80,540,690
繰 越 損 益 金	△230,869,493

(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2,081,716,193円、当作成期間中において、追加設定元本額は20,140,578円、同解約元本額は257,621,458円です。

<お知らせ>

約款変更について

・2024年から実施されるNISA（少額投資非課税制度といえます。）の制度に鑑み、より多くの投資機会を提供することで投資家のニーズに応えるため、信託期間を無期限に変更しました。

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
	2023年2月11日～2023年8月10日		
	金額	比率	
信託報酬 （投信会社）	85円 (42)	0.777% (0.382)	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、運用報告書等各种種類の送付、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）	(42)	(0.382)	
（受託会社）	(1)	(0.014)	
その他費用 （保管費用）	2 (1)	0.021 (0.006)	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)	(0.001)	
（その他）	(2)	(0.014)	
合計	87	0.798	

期中の平均基準価額は10,917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。

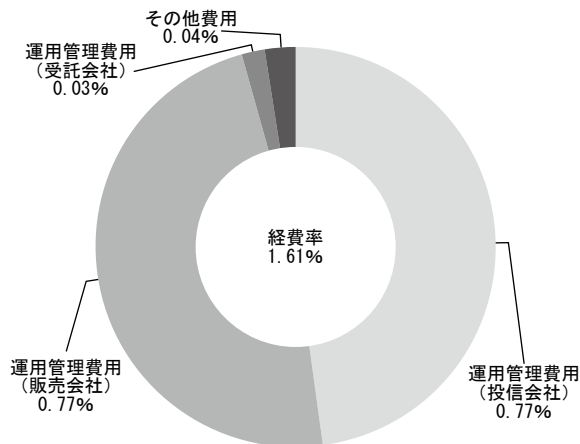
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.61%です。



経費率（①+②）	1.61%
①このファンドの費用の比率	1.61%
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（2023年2月11日から2023年8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	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 USスモール・キャップ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	—	—	640,560	10,300
国	—	—	44	500
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	—	—	44	500

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2023年2月11日から2023年8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（2023年8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 USスモール・キャップ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	3,397,314	56,191	8,089,339	95.8
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	130	1,474	212,227	2.5
合計	3,397,444	57,665	8,301,566	<98.4%>

(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

2023年8月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 8,301,566	% 89.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	996,027	10.7
投 資 信 託 財 産 総 額	9,297,593	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（8,301,566千円）の投資信託財産総額（9,297,593千円）に対する比率は89.3%です。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。なお決算日における邦貨換算レートは1米ドル=143.96円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2023年8月10日
(A) 資 産	9,297,593,745円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	996,026,898
投 資 証 券(評価額)	8,301,566,847
(B) 負 債	857,037,709
未 払 収 益 分 配 金	755,346,326
未 払 解 約 金	33,280,935
未 払 信 託 報 酬	67,087,206
未 払 利 息	2,728
そ の 他 未 払 費 用	1,320,514
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	8,440,556,036
元 本	7,629,760,874
次 期 繰 越 損 益 金	810,795,162
(D) 受 益 権 総 口 数	7,629,760,874口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,063円

■損益の状況

項 目	当 期
	自 2023年2月11日 至 2023年8月10日
(A) 配 当 等 収 益	△ 53,059円
受 取 利 息	5
支 払 利 息	△ 53,064
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	987,311,877
売 買 損 益	1,022,511,828
売 買 損 益	△ 35,199,951
(C) 信 託 報 酬 等	△ 68,897,938
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	918,360,880
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	152,309,662
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	495,470,946
(配 当 等 相 当 額)	(213,102,206)
(売 買 損 益 相 当 額)	(282,368,740)
(G) 計 (D + E + F)	1,566,141,488
(H) 収 益 分 配 金	△ 755,346,326
次 期 繰 越 損 益 金(G + H)	810,795,162
追 加 信 託 差 損 益 金	495,470,946
(配 当 等 相 当 額)	(213,102,206)
(売 買 損 益 相 当 額)	(282,368,740)
分 配 準 備 積 立 金	315,377,275
繰 越 損 益 金	△ 53,059

(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8,158,316,728円、当作成期間中において、追加設定元本額は212,380,551円、同解約元本額は740,936,405円です。

<お知らせ>

約款変更について

・2024年から実施されるNISA（少額投資非課税制度といえます。）の制度に鑑み、より多くの投資機会を提供することで投資家のニーズに応えるため、信託期間を無期限に変更しました。

■分配金のお知らせ

Bコース（為替ヘッジなし）

決 算 期	第 13 期
1 万 口 当 た り 分 配 金	990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

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 13 期
	2023年2月11日～2023年8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	671

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 13 期
	2023年2月11日～2023年8月10日
当期分配金	990
（対基準価額比率）	8.214
当期の収益	990
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,062

- (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USスモール・キャップ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USスモール・キャップCOREエクイティ・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）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。2023年8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（2022年11月30日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
有価証券貸付にかかる手数料	822
投資顧問報酬	496,552
保管費用	53,406
管理事務代行報酬	66,961
販売報酬およびサービシング報酬	43,098
名義書換事務代行報酬	40,052
年次税	33,066
監査報酬	8,246
管理会社報酬	23,930
取締役報酬	1,069
弁護士報酬	10,374
保険費用	5,803
印刷費用	13,184
出版費用	2,660
税務報告報酬	21,299
支払代理人報酬	17,904
規制報告報酬	28,662
その他費用	23,889
	890,977
投資顧問報酬調整額	(7,202)
費用合計	883,775

■保有有価証券明細（2022年11月30日現在）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
公認の金融商品取引所に上場されている譲渡性有価証券			
普通株式-90.38%			
バミューダ			
21,097	Argo Group International Holdings Ltd.	555,273	0.42
2,947	DHT Holdings, Inc.	29,234	0.02
6,161	Golar LNG Ltd.	153,656	0.12
		738,163	0.56
ブラジル			
17,242	StoneCo Ltd. Class A	191,731	0.15
カナダ			
15,774	Aurinia Pharmaceuticals, Inc.	79,974	0.06
5,510	Novagold Resources, Inc.	31,297	0.03
9,905	Teekay Tankers Ltd. Class A	332,907	0.25
428	Tucows, Inc. Class A	12,215	0.01
		456,393	0.35

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
普通株式			
フランス			
2,916	Constellium SE	34,554	0.03
アイルランド			
38,467	Alkermes PLC	929,363	0.70
イスラエル			
8,819	Sapiens International Corp. NV	170,207	0.13
モナコ			
63,237	Costamare, Inc.	602,016	0.46
136,105	Safe Bulkers, Inc.	383,816	0.29
16,685	Scorpio Tankers, Inc.	850,435	0.64
		1,836,267	1.39
ノルウェー			
22,675	Golden Ocean Group Ltd.	190,923	0.14
18,074	SFL Corp. Ltd.	177,939	0.14
		368,862	0.28
パナマ			
26,735	Banco Latinoamericano de Comercio Exterior SA Class E	432,037	0.33
プエルトリコ			
17,726	EVERTEC, Inc.	578,754	0.44
タイ			
4,897	Fabrinet	619,079	0.47
アラブ首長国連邦			
3,825	Borr Drilling Ltd.	17,442	0.01
英国			
7,002	LivaNova PLC	371,736	0.28
米国			
2,500	1st Source Corp.	138,425	0.10
7,378	2seventy bio, Inc.	115,761	0.09
18,663	A10 Networks, Inc.	336,681	0.25
4,074	Aaron's Co., Inc.	47,218	0.04
1,145	Academy Sports & Outdoors, Inc.	56,981	0.04
17,114	ACADIA Pharmaceuticals, Inc.	254,656	0.19
7,673	ACI Worldwide, Inc.	153,383	0.12
4,373	Aclaris Therapeutics, Inc.	70,405	0.05
32,745	Adaptive Biotechnologies Corp.	258,031	0.20
11,692	Adient PLC	437,632	0.33
1,120	Advanced Energy Industries, Inc.	99,747	0.08
26,177	AirSculpt Technologies, Inc.	89,264	0.07
38,358	aka Brands Holding Corp.	70,579	0.05
10,965	Alarm.com Holdings, Inc.	520,618	0.39
19,718	Alector, Inc.	157,941	0.12
1,083	Alerus Financial Corp.	25,342	0.02
2,427	Alpha Metallurgical Resources, Inc.	418,973	0.32
5,325	Altair Engineering, Inc. Class A	249,210	0.19
4,418	ALX Oncology Holdings, Inc.	48,156	0.04
8,732	Amalgamated Financial Corp.	227,381	0.17
8,038	A-Mark Precious Metals, Inc.	263,325	0.20
350	Ambarella, Inc.	24,241	0.02
22,782	American Equity Investment Life Holding Co.	890,321	0.67
19,208	American Software, Inc. Class A	270,833	0.21
15,971	AMERISAFE, Inc.	919,930	0.70
44,917	Amicus Therapeutics, Inc.	528,898	0.40
7,227	AMN Healthcare Services, Inc.	878,297	0.67
1,075	Amphastar Pharmaceuticals, Inc.	31,573	0.02

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
13,285	Amplitude, Inc. Class A	185,990	0.14
9,740	Anavex Life Sciences Corp.	86,199	0.07
7,242	Apellis Pharmaceuticals, Inc.	370,465	0.28
3,224	Applied Industrial Technologies, Inc.	416,218	0.32
737	ArcBest Corp.	59,749	0.04
3,533	Arcosa, Inc.	207,104	0.16
7,564	Arcus Biosciences, Inc.	236,299	0.18
11,919	Arko Corp.	110,132	0.08
12,715	Array Technologies, Inc.	264,218	0.20
6,315	Arrowhead Pharmaceuticals, Inc.	195,765	0.15
9,954	Artivion, Inc.	120,244	0.09
9,439	Arvinas, Inc.	369,065	0.28
15,084	Asana, Inc. Class A	259,294	0.20
1,671	Asbury Automotive Group, Inc.	301,415	0.23
8,236	Aspen Aerogels, Inc.	86,478	0.07
14,634	Associated Banc-Corp	350,045	0.27
5,808	Atara Biotherapeutics, Inc.	24,684	0.02
16,324	Athira Pharma, Inc.	47,584	0.04
2,159	ATI, Inc.	62,071	0.05
9,219	Atkore, Inc.	1,065,901	0.81
3,092	AtriCure, Inc.	133,698	0.10
1,841	Avanos Medical, Inc.	48,253	0.04
3,972	Avidity Biosciences, Inc.	46,711	0.04
11,465	Axcelis Technologies, Inc.	858,155	0.65
10,566	Axonics, Inc.	688,692	0.52
12,317	Axos Financial, Inc.	469,894	0.36
4,109	AXT, Inc.	20,668	0.02
854	B&G Foods, Inc.	11,409	0.01
384	Badger Meter, Inc.	43,165	0.03
1,765	BancFirst Corp.	178,618	0.14
1,202	Beam Therapeutics, Inc.	51,674	0.04
3,273	Beauty Health Co.	33,336	0.02
5,044	Belden, Inc.	383,748	0.29
7,547	Benchmark Electronics, Inc.	211,090	0.16
1,696	Biglari Holdings, Inc. Class B	238,475	0.18
15,508	BioCryst Pharmaceuticals, Inc.	201,759	0.15
3,535	Blackbaud, Inc.	204,641	0.15
34,610	Bloomin' Brands, Inc.	744,115	0.56
3,420	Blue Ridge Bankshares, Inc.	43,537	0.03
2,458	Boot Barn Holdings, Inc.	158,467	0.12
3,297	Brady Corp. Class A	153,970	0.12
1,713	Bread Financial Holdings, Inc.	66,824	0.05
8,928	Bridgebio Pharma, Inc.	80,977	0.06
20,802	BrightView Holdings, Inc.	139,165	0.11
19,680	Brookdale Senior Living, Inc.	57,072	0.04
9,122	Buckle, Inc.	396,168	0.30
6,367	Bumble, Inc. Class A	144,467	0.11
6,984	Business First Bancshares, Inc.	159,654	0.12
3,514	Cactus, Inc. Class A	187,507	0.14
11,307	Cadence Bank	313,543	0.24
7,307	Callon Petroleum Co.	302,218	0.23
9,018	Cal-Maine Foods, Inc.	516,371	0.39
41,837	Cano Health, Inc.	75,307	0.06
9,692	Capital Bancorp, Inc.	233,577	0.18

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
51,220	Capitol Federal Financial, Inc.	414,370	0.31
1,688	Cardiovascular Systems, Inc.	22,577	0.02
6,923	Cardlytics, Inc.	27,138	0.02
2,300	Cargurus, Inc.	28,037	0.02
27,074	CarParts.com, Inc.	142,409	0.11
10,653	Cass Information Systems, Inc.	450,515	0.34
3,709	Castle Biosciences, Inc.	82,154	0.06
16,840	Catalyst Pharmaceuticals, Inc.	279,376	0.21
1,368	Cavco Industries, Inc.	298,484	0.23
9,001	CBIZ, Inc.	436,278	0.33
957	Celldex Therapeutics, Inc.	33,782	0.03
2,001	Celsius Holdings, Inc.	213,187	0.16
23,578	Central Pacific Financial Corp.	481,463	0.36
7,353	Century Aluminum Co.	61,912	0.05
27,603	Gerus Corp.	101,027	0.08
2,012	Chart Industries, Inc.	279,547	0.21
10,941	Chefs' Warehouse, Inc.	414,664	0.31
2,833	Children's Place, Inc.	100,373	0.08
3,825	Chord Energy Corp.	580,214	0.44
16,287	Chuy's Holdings, Inc.	496,102	0.38
13,930	Civitas Resources, Inc.	935,957	0.71
59,618	Cleanspark, Inc.	126,688	0.10
24,440	Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.	25,540	0.02
16,446	Clear Secure, Inc. Class A	514,760	0.39
3,201	Clearfield, Inc.	403,006	0.31
56,955	Clover Health Investments Corp.	70,339	0.05
44,206	CNO Financial Group, Inc.	1,007,013	0.76
1,565	Coca-Cola Consolidated, Inc.	753,767	0.57
33,465	Codexis, Inc.	167,994	0.13
39,937	Coeur Mining, Inc.	135,586	0.10
890	Cohu, Inc.	30,313	0.02
861	Columbia Banking System, Inc.	28,361	0.02
16,023	Columbus McKinnon Corp.	493,669	0.37
2,877	Comfort Systems USA, Inc.	358,388	0.27
7,928	Community Bank System, Inc.	501,446	0.38
44,210	Community Health Systems, Inc.	135,725	0.10
12,155	CommVault Systems, Inc.	794,208	0.60
30,501	Comstock Resources, Inc.	556,643	0.42
4,979	Consensus Cloud Solutions, Inc.	281,562	0.21
1,439	Corsair Gaming, Inc.	23,110	0.02
1,007	CorVel Corp.	148,638	0.11
18,903	Crawford & Co. Class A	120,034	0.09
4,440	Crocs, Inc.	433,943	0.33
2,909	Cross Country Healthcare, Inc.	101,204	0.08
1,169	CrossFirst Bankshares, Inc.	15,700	0.01
1,475	CryoPort, Inc.	27,214	0.02
3,849	Cullinan Oncology, Inc.	47,189	0.04
4,103	Cyxtera Technologies, Inc.	7,632	0.01
354	Daily Journal Corp.	93,902	0.07
1,204	Dana, Inc.	20,480	0.02
14,986	Dave & Buster's Entertainment, Inc.	586,702	0.44
867	Day One Biopharmaceuticals, Inc.	17,904	0.01
862	Deciphera Pharmaceuticals, Inc.	13,663	0.01
10,760	Denali Therapeutics, Inc.	333,560	0.25

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
17,830	Denny's Corp.	224,569	0.17
5,094	Design Therapeutics, Inc.	76,410	0.06
5,257	Designer Brands, Inc. Class A	79,854	0.06
8,837	DHI Group, Inc.	48,427	0.04
1,260	DICE Therapeutics, Inc.	44,100	0.03
42	Dillard's, Inc. Class A	15,484	0.01
6,329	Diodes, Inc.	554,990	0.42
30,612	Diversey Holdings Ltd.	150,305	0.11
1,100	DMC Global, Inc.	19,976	0.01
2,587	Douglas Dynamics, Inc.	96,754	0.07
18,547	Dream Finders Homes, Inc. Class A	176,196	0.13
985	Dril-Quip, Inc.	22,635	0.02
27,420	Duck Creek Technologies, Inc.	293,120	0.22
350	Ducommun, Inc.	17,150	0.01
3,316	Duolingo, Inc.	222,902	0.17
2,828	Dycom Industries, Inc.	251,947	0.19
1,571	Dynavax Technologies Corp.	18,899	0.01
8,756	E2open Parent Holdings, Inc.	49,384	0.04
3,011	Eagle Bulk Shipping, Inc.	152,868	0.12
1,423	Eagle Pharmaceuticals, Inc.	50,246	0.04
3,413	Earthstone Energy, Inc. Class A	53,960	0.04
3,758	Ebix, Inc.	67,832	0.05
2,184	Edgewise Therapeutics, Inc.	19,853	0.01
6,364	Editas Medicine, Inc.	62,431	0.05
20,443	Employers Holdings, Inc.	916,869	0.69
4,271	Enanta Pharmaceuticals, Inc.	182,500	0.14
6,800	Encore Wire Corp.	969,408	0.73
2,941	EngageSmart, Inc.	48,997	0.04
27,318	Ennis, Inc.	619,026	0.47
3,225	Envestnet, Inc.	182,890	0.14
9,534	ePlus, Inc.	464,401	0.35
4,654	Erasca, Inc.	33,509	0.03
11,575	Esperion Therapeutics, Inc.	78,247	0.06
3,011	Evolv Technologies Holdings, Inc.	10,027	0.01
1,167	Evoqua Water Technologies Corp.	49,364	0.04
27,877	EW Scripps Co. Class A	399,756	0.30
5,683	ExlService Holdings, Inc.	1,033,738	0.78
9,747	Exponent, Inc.	977,234	0.74
37,114	EZCORP, Inc. Class A	374,480	0.28
5,465	Fate Therapeutics, Inc.	109,027	0.08
29,561	Figs, Inc. Class A	211,952	0.16
9,964	First Bancorp, Inc.	299,418	0.23
14,183	First Financial Bankshares, Inc.	502,787	0.38
25,887	First Watch Restaurant Group, Inc.	404,096	0.31
10,523	FirstCash Holdings, Inc.	965,906	0.73
16,811	Fluor Corp.	549,720	0.42
3,759	Flywire Corp.	77,435	0.06
9,779	Focus Financial Partners, Inc. Class A	356,640	0.27
512	Foot Locker, Inc.	20,076	0.01
6,788	FormFactor, Inc.	147,978	0.11
8,461	Fossil Group, Inc.	40,444	0.03
3,559	Franklin Covey Co.	182,363	0.14
5,990	Franklin Electric Co., Inc.	487,526	0.37
2,393	Fresh Del Monte Produce, Inc.	64,037	0.05

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
6,946	Frontier Group Holdings, Inc.	87,797	0.07
27,741	FTC Solar, Inc.	55,898	0.04
11,802	Generation Bio Co.	61,488	0.05
29,024	Genworth Financial, Inc. Class A	140,186	0.11
91,846	Globalstar, Inc.	172,670	0.13
3,365	Goodyear Tire & Rubber Co.	36,106	0.03
17,837	Goosehead Insurance, Inc. Class A	682,622	0.52
20,316	Gossamer Bio, Inc.	173,499	0.13
25,230	GrafTech International Ltd.	127,411	0.10
18	Graham Holdings Co. Class B	11,663	0.01
20,090	Gray Television, Inc.	224,003	0.17
317	Great Southern Bancorp, Inc.	19,445	0.01
337	Group 1 Automotive, Inc.	64,134	0.05
10,702	Guaranty Bancshares, Inc.	370,503	0.28
258	Gulfport Energy Corp.	20,596	0.02
22,281	H&E Equipment Services, Inc.	876,757	0.66
633	Hamilton Lane, Inc. Class A	45,690	0.03
16,552	Hancock Whitney Corp.	871,959	0.66
29,324	Hanmi Financial Corp.	776,206	0.59
1,265	Harmony Biosciences Holdings, Inc.	73,598	0.06
11,389	Health Catalyst, Inc.	112,182	0.08
675	HealthEquity, Inc.	43,281	0.03
2,165	HealthStream, Inc.	53,627	0.04
14,964	Herbalife Nutrition Ltd.	261,571	0.20
1,901	Herc Holdings, Inc.	240,172	0.18
16,921	Heritage-Crystal Clean, Inc.	518,121	0.39
13,014	Heron Therapeutics, Inc.	34,162	0.03
1,728	Hilton Grand Vacations, Inc.	74,356	0.06
24,663	Hims & Hers Health, Inc.	141,936	0.11
13,813	Holley, Inc.	36,604	0.03
5,610	Home Bancorp, Inc.	237,303	0.18
3,186	HomeTrust Bancshares, Inc.	80,447	0.06
45,842	Hope Bancorp, Inc.	602,364	0.46
5,024	Hudson Technologies, Inc.	55,565	0.04
12,327	I3 Verticals, Inc. Class A	306,942	0.23
2,778	Identiv, Inc.	22,641	0.02
6,828	IGM Biosciences, Inc.	145,710	0.11
20,785	ImmunoGen, Inc.	105,276	0.08
7,389	Independent Bank Corp.	177,188	0.13
3,219	Information Services Group, Inc.	16,610	0.01
626	Ingles Markets, Inc. Class A	62,550	0.05
860	Inhibrx, Inc.	24,914	0.02
6,635	Innospec, Inc.	720,959	0.55
12,217	Insmed, Inc.	223,571	0.17
3,380	Inspire Medical Systems, Inc.	790,041	0.60
8,632	Installed Building Products, Inc.	693,754	0.53
15,073	Instructure Holdings, Inc.	363,259	0.28
7,280	Intercept Pharmaceuticals, Inc.	106,288	0.08
11,450	International Bancshares Corp.	580,400	0.44
2,759	International Game Technology PLC	65,692	0.05
3,912	Intra-Cellular Therapies, Inc.	208,236	0.16
3,408	Intrepid Potash, Inc.	117,303	0.09
475	Investors Title Co.	72,172	0.05

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
21,330	Iovance Biotherapeutics, Inc.	131,286	0.10
1,674	iRadimed Corp.	47,709	0.04
4,237	Iridium Communications, Inc.	218,205	0.17
217	iRobot Corp.	11,134	0.01
3,997	iTeos Therapeutics, Inc.	77,142	0.06
724	IVERIC bio, Inc.	16,963	0.01
9,881	John B Sanfilippo & Son, Inc.	813,503	0.62
1,069	John Wiley & Sons, Inc. Class A	49,078	0.04
1,921	Joint Corp.	28,796	0.02
12,725	KalVista Pharmaceuticals, Inc.	66,297	0.05
1,036	Karuna Therapeutics, Inc.	238,280	0.18
20,870	Kennametal, Inc.	529,263	0.40
5,312	Keros Therapeutics, Inc.	254,498	0.19
3,193	Kezar Life Sciences, Inc.	24,682	0.02
8,977	Kiniksa Pharmaceuticals Ltd. Class A	145,876	0.11
457	Kinsale Capital Group, Inc.	136,803	0.10
17,667	Kodiak Sciences, Inc.	128,174	0.10
26,149	Kosmos Energy Ltd.	171,537	0.13
12,776	Kratos Defense & Security Solutions, Inc.	117,028	0.09
1,800	Kura Oncology, Inc.	27,504	0.02
2,262	Kura Sushi USA, Inc. Class A	145,401	0.11
1,036	Lantheus Holdings, Inc.	63,766	0.05
5,681	Laredo Petroleum, Inc.	355,858	0.27
8,991	Laureate Education, Inc.	91,978	0.07
1,773	LCI Industries	171,148	0.13
817	Legacy Housing Corp.	14,052	0.01
1,003	LendingTree, Inc.	22,748	0.02
3,290	LGI Homes, Inc.	306,496	0.23
17,562	Liberty Oilfield Services, Inc. Class A	286,963	0.22
548	Lindsay Corp.	95,610	0.07
14,347	LSB Industries, Inc.	213,196	0.16
4,663	Luminar Technologies, Inc.	34,320	0.03
19,830	Luther Burbank Corp.	227,847	0.17
9,027	M/I Homes, Inc.	386,626	0.29
25,145	Macatowa Bank Corp.	272,069	0.21
584	Madrigal Pharmaceuticals, Inc.	41,464	0.03
1,755	Magnite, Inc.	18,515	0.01
41,321	Magnolia Oil & Gas Corp. Class A	1,074,346	0.81
9,008	Malibu Boats, Inc. Class A	514,627	0.39
2,381	MarineMax, Inc.	77,049	0.06
34,035	Marten Transport Ltd.	705,886	0.53
1,409	MasterCraft Boat Holdings, Inc.	35,986	0.03
4,406	Matador Resources Co.	292,955	0.22
15,436	Maximus, Inc.	1,047,796	0.79
16,202	MaxLinear, Inc.	549,734	0.42
4,603	Medpace Holdings, Inc.	925,019	0.70
9,008	MeiraGTx Holdings PLC	55,850	0.04
19,621	Merchants Bancorp	485,031	0.37
686	Meritage Homes Corp.	57,679	0.04
10,924	Metrocity Bankshares, Inc.	237,269	0.18
118	MicroStrategy, Inc. Class A	21,763	0.02
5,780	Miller Industries, Inc.	157,678	0.12
14,700	Minerals Technologies, Inc.	855,687	0.65
2,338	Mirum Pharmaceuticals, Inc.	43,908	0.03

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
3,993	Model N, Inc.	149,737	0.11
697	Modine Manufacturing Co.	14,135	0.01
3,510	Montauk Renewables, Inc.	39,523	0.03
344	Moog, Inc. Class A	29,440	0.02
1,082	Morphic Holding, Inc.	29,052	0.02
27,867	MRC Global, Inc.	319,077	0.24
15,735	Mueller Industries, Inc.	1,047,322	0.79
2,666	Murphy Oil Corp.	124,635	0.09
3,448	Murphy USA, Inc.	1,012,609	0.77
1,691	Nabors Industries Ltd.	257,624	0.20
6,507	NanoString Technologies, Inc.	40,148	0.03
2,659	National HealthCare Corp.	161,401	0.12
748	National Western Life Group, Inc. Class A	141,581	0.11
2,176	Natural Grocers by Vitamin Cottage, Inc.	21,673	0.02
150	Nelnet, Inc. Class A	14,685	0.01
8,288	NetScout Systems, Inc.	302,678	0.23
9,523	Nevro Corp.	429,011	0.33
34,784	NexTier Oilfield Solutions, Inc.	348,188	0.26
4,696	Noodles & Co.	25,640	0.02
5,699	Northeast Bank	238,104	0.18
3,426	Northwest Pipe Co.	126,762	0.10
25,437	NOW, Inc.	307,279	0.23
11,345	Nurix Therapeutics, Inc.	136,480	0.10
9,442	NuVasive, Inc.	351,620	0.27
5,650	Oceaneering International, Inc.	82,999	0.06
19,536	Oil States International, Inc.	129,719	0.10
2,349	Olympic Steel, Inc.	80,571	0.06
12,323	ONE Gas, Inc.	1,048,934	0.80
60,227	OPKO Health, Inc.	86,426	0.07
5,572	Oppenheimer Holdings, Inc. Class A	227,672	0.17
6,168	Option Care Health, Inc.	180,537	0.14
29,905	Organogenesis Holdings, Inc.	80,295	0.06
1,209	Owens & Minor, Inc.	23,817	0.02
836	Oxford Industries, Inc.	91,283	0.07
8,408	PagerDuty, Inc.	175,475	0.13
2,502	Pain Therapeutics, Inc.	86,344	0.07
2,450	Palomar Holdings, Inc.	150,062	0.11
2,182	PAM Transportation Services, Inc.	60,703	0.05
10,097	Parsons Corp.	490,209	0.37
4,709	Patterson-UTI Energy, Inc.	82,737	0.06
6,784	PBF Energy, Inc. Class A	271,835	0.21
4,340	PC Connection, Inc.	236,704	0.18
8,661	PCB Bancorp	157,544	0.12
5,904	Perficient, Inc.	407,140	0.31
8,313	PetIQ, Inc.	93,604	0.07
4,090	PetMed Express, Inc.	78,528	0.06
25,090	Phibro Animal Health Corp. Class A	298,822	0.23
1,887	Phreesia, Inc.	48,515	0.04
5,086	Piedmont Lithium, Inc.	278,357	0.21
4,554	PJT Partners, Inc. Class A	341,277	0.26
11,626	PMV Pharmaceuticals, Inc.	114,400	0.09
6,519	Portillo's, Inc. Class A	125,752	0.10
12,838	Powell Industries, Inc.	323,903	0.25
195	Power Integrations, Inc.	14,964	0.01

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
55,803	Praxis Precision Medicines, Inc.	117,186	0.09
61,525	Primo Water Corp.	932,104	0.71
19,045	Primoris Services Corp.	388,328	0.29
13,315	ProAssurance Corp.	258,577	0.20
3,718	Project Roadrunner Parent, Inc.	31,101	0.02
1,262	Prometheus Biosciences, Inc.	53,111	0.04
5,870	PROS Holdings, Inc.	136,771	0.10
8,176	Provident Bancorp, Inc.	56,987	0.04
10,501	PTC Therapeutics, Inc.	429,911	0.33
13,401	Q2 Holdings, Inc.	344,540	0.26
437	Qualys, Inc.	51,181	0.04
3,903	RadNet, Inc.	75,367	0.06
4,120	Rallybio Corp.	22,660	0.02
9,310	Rapid7, Inc.	249,601	0.19
3,015	RAPT Therapeutics, Inc.	52,190	0.04
94,990	RealReal, Inc.	142,960	0.11
22,551	Red Rock Resorts, Inc. Class A	1,008,368	0.76
3,126	Red Violet, Inc.	68,272	0.05
7,777	Regional Management Corp.	221,644	0.17
10,623	Rent the Runway, Inc. Class A	13,332	0.01
4,295	Revolve Group, Inc.	107,676	0.08
37,921	RPC, Inc.	344,702	0.26
9,210	Sabre Corp.	53,326	0.04
4,840	Sage Therapeutics, Inc.	191,035	0.14
6,682	Sally Beauty Holdings, Inc.	76,843	0.06
21,186	Sana Biotechnology, Inc.	100,845	0.08
12,434	Scholastic Corp.	499,847	0.38
11,811	Schrodinger, Inc.	208,346	0.16
3,532	Select Energy Services, Inc. Class A	28,927	0.02
15,618	Select Medical Holdings Corp.	367,023	0.28
10,716	Semtech Corp.	312,800	0.24
674	Shake Shack, Inc. Class A	33,997	0.03
9,406	Shoals Technologies Group, Inc. Class A	268,165	0.20
3,072	Shockwave Medical, Inc.	772,070	0.59
11,638	SIGA Technologies, Inc.	106,022	0.08
606	Silvergate Capital Corp. Class A	15,283	0.01
4,666	Sinclair Broadcast Group, Inc. Class A	83,195	0.06
365	SiTime Corp.	35,244	0.03
7,368	Skyline Champion Corp.	360,737	0.27
14,334	SM Energy Co.	610,342	0.46
4,569	Sonic Automotive, Inc. Class A	237,634	0.18
5,036	Southern First Bancshares, Inc.	244,095	0.18
2,912	SouthState Corp.	246,239	0.19
2,755	SpringWorks Therapeutics, Inc.	67,360	0.05
4,006	SPS Commerce, Inc.	541,050	0.41
18,205	St Joe Co.	680,503	0.52
12,516	Stem, Inc.	159,078	0.12
16,502	Stewart Information Services Corp.	704,800	0.53
9,602	Stride, Inc.	339,431	0.26
30,104	Summit Materials, Inc. Class A	886,262	0.67
5,141	SunCoke Energy, Inc.	42,722	0.03
9,534	Super Micro Computer, Inc.	859,776	0.65
9,825	Surgery Partners, Inc.	267,338	0.20
9,475	Surmodics, Inc.	327,077	0.25

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
52,160	Sutro Biopharma, Inc.	378,160	0.29
4,628	Sylvamo Corp.	238,897	0.18
2,618	Synaptics, Inc.	257,847	0.20
2,085	Tactile Systems Technology, Inc.	17,577	0.01
17,267	Talos Energy, Inc.	337,052	0.26
4,046	Target Hospitality Corp.	57,494	0.04
8,523	TechTarget, Inc.	379,529	0.29
11,436	Tenable Holdings, Inc.	410,552	0.31
12,597	TETRA Technologies, Inc.	46,672	0.04
5,621	Texas Roadhouse, Inc.	549,565	0.42
1,466	Textainer Group Holdings Ltd.	44,097	0.03
6,632	Thermon Group Holdings, Inc.	128,462	0.10
4,456	Thryv Holdings, Inc.	83,015	0.06
11,727	TimkenSteel Corp.	216,129	0.16
26,887	Titan International, Inc.	371,578	0.28
12,686	Titan Machinery, Inc.	510,611	0.39
2,626	Tootsie Roll Industries, Inc.	114,520	0.09
4,225	TransMedics Group, Inc.	255,274	0.19
497	Tri Pointe Homes, Inc.	8,752	0.01
2,499	Triumph Group, Inc.	28,289	0.02
14,611	Tronox Holdings PLC	193,596	0.15
23,439	TrustCo Bank Corp. NY	884,822	0.67
12,683	Trustmark Corp.	446,188	0.34
5,121	TTM Technologies, Inc.	76,917	0.06
11,330	Tutor Perini Corp.	78,177	0.06
1,872	Twist Bioscience Corp.	47,530	0.04
3,700	Ultra Clean Holdings, Inc.	122,322	0.09
18,590	Unisys Corp.	73,988	0.06
354	United States Lime & Minerals, Inc.	48,257	0.04
1,022	Universal Logistics Holdings, Inc.	37,722	0.03
12,439	US Silica Holdings, Inc.	157,913	0.12
3,209	USCB Financial Holdings, Inc.	42,808	0.03
4,210	Utah Medical Products, Inc.	372,795	0.28
55,692	Vanda Pharmaceuticals, Inc.	587,551	0.45
1,344	Varex Imaging Corp.	27,310	0.02
2,666	Varonis Systems, Inc.	54,466	0.04
961	Vaxcyte, Inc.	44,485	0.03
2,371	Verint Systems, Inc.	90,217	0.07
6,268	Veritex Holdings, Inc.	197,254	0.15
323	Veritiv Corp.	41,887	0.03
17,999	Victory Capital Holdings, Inc. Class A	509,012	0.39
41,422	ViewRay, Inc.	197,169	0.15
31,988	Vimeo, Inc.	123,794	0.09
5,239	Vir Biotechnology, Inc.	144,020	0.11
17,934	Vishay Intertechnology, Inc.	392,755	0.30
7,444	Vishay Precision Group, Inc.	290,837	0.22
15,020	Volta, Inc.	7,360	0.01
31,795	W&T Offshore, Inc.	217,160	0.16
13,052	Wabash National Corp.	322,776	0.24
23,091	Warrior Met Coal, Inc.	837,741	0.63
1,206	WD-40 Co.	200,775	0.15
217	Wingstop, Inc.	34,377	0.03
640	Winmark Corp.	155,232	0.12
3,204	Winnebago Industries, Inc.	180,065	0.14

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

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			
441	World Acceptance Corp.	30,142	0.02
4,276	Xometry, Inc. Class A	177,582	0.13
14,339	Yext, Inc.	74,706	0.06
28,542	ZipRecruiter, Inc. Class A	444,399	0.34
25,491	Zuora, Inc. Class A	188,633	0.14
15,843	Zurn Elkay Water Solutions Corp.	371,360	0.28
		112,424,430	85.26
普通株式合計（取得原価 米ドル 120,566,963）		119,169,018	90.38
不動産投資信託—8.24%			
米国			
7,035	Braemar Hotels & Resorts, Inc.	24,904	0.02
30,370	Brandywine Realty Trust	201,961	0.15
36,020	BrightSpire Capital, Inc.	247,457	0.19
951	Centerspace	60,103	0.05
64,417	Chatham Lodging Trust	831,623	0.63
69,186	Chimera Investment Corp.	458,703	0.35
17,865	Community Healthcare Trust, Inc.	607,053	0.46
76,998	DiamondRock Hospitality Co.	700,682	0.53
31,409	Equity Commonwealth	833,281	0.63
4,076	Essential Properties Realty Trust, Inc.	91,017	0.07
43,664	Global Medical, Inc.	426,161	0.32
3,419	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital, Inc.	105,408	0.08
9,030	Hersha Hospitality Trust	84,611	0.06
30,290	Hospitality Properties Trust	228,084	0.17
36,281	Independence Realty Trust, Inc.	629,475	0.48
24,970	LXP Industrial Trust	255,693	0.19
6,490	Macerich Co.	82,293	0.06
17,040	Nexpoint Real Estate Finance, Inc.	306,379	0.23
16,434	NexPoint Residential Trust, Inc.	757,114	0.58
53,502	Outfront Media, Inc.	956,616	0.73
66,290	RLJ Lodging Trust	778,245	0.59
3,611	Ryman Hospitality Properties, Inc.	322,498	0.25
33,340	STAG Industrial, Inc.	1,054,878	0.80
1,993	Tanger Factory Outlet Centers, Inc.	38,365	0.03
2,671	Terreno Realty Corp.	152,701	0.12
24,593	TPG RE Finance Trust, Inc.	171,905	0.13
58,154	Uniti Group, Inc.	420,163	0.32
584	Universal Health Realty Income Trust	30,099	0.02
		10,857,472	8.24
不動産投資信託合計（取得原価 米ドル 11,770,130）		10,857,472	8.24
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 132,337,093）		130,026,490	98.62
投資評価額（取得原価 米ドル 132,337,093）		130,026,490	98.62
その他資産・負債		1,827,295	1.38
投資主資本		131,853,785	100.00
投資合計			
		評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
投資合計（取得原価 米ドル 132,337,093）		130,026,490	98.62
その他資産・負債		1,827,295	1.38
投資主資本		131,853,785	100.00

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

ゴールドマン・サックス・ファンズ・ピーエルシー—ゴールドマン・サックスUS\$リキッド・リザーブズ・ファンド（アイルランド籍）は、GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）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。2023年8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（2022年12月31日に終了した期間）（単位：米ドル）

費用	
投資顧問報酬	69,081,454
管理会社報酬	3,682,413
管理事務代行報酬	1,194,381
保管費用	1,607,581
販売報酬	3,489,257
名義書換事務代行報酬	464,601
監査報酬	15,188
取締役報酬	14,475
弁護士報酬	39,338
保険費用	204,761
印刷費用	24,047
その他費用	585,112
費用合計	80,402,608
投資顧問報酬調整額	(7,685,797)
運用費用合計	72,716,811

■保有有価証券明細（2022年12月31日現在）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券				
10,340,000	社債 BPCE SA	4.770%	11/01/2023	10,331,456	0.03
社債合計				10,331,456	0.03
	国債				
25,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.340%	02/02/2023	25,004,170	0.06
100,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.349%	03/05/2023	100,040,699	0.23
747,903,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.360%	01/08/2023	747,978,239	1.70
285,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.591%	19/10/2023	284,563,893	0.65
500,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.380%	25/10/2023	500,025,585	1.13
240,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.677%	03/11/2023	239,773,646	0.54
176,000,000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp	4.410%	22/12/2023	176,008,392	0.40
18,300,000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	3.070%	21/02/2023	18,185,756	0.04
650,000,000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	4.434%	22/03/2023	643,857,123	1.46
348,900,000	Federal Home Loan Bank Discount Notes	4.560%	21/06/2023	341,488,481	0.78
550,000,000	Federal Home Loan Banks	4.335%	06/01/2023	550,004,345	1.25
500,000,000	Federal Home Loan Banks	4.320%	09/01/2023	500,001,195	1.13
500,000,000	Federal Home Loan Banks	4.320%	10/01/2023	500,001,370	1.13
435,200,000	Federal Home Loan Banks	4.320%	13/03/2023	435,200,883	0.99
362,500,000	Federal Home Loan Banks	4.320%	14/03/2023	362,531,512	0.82
1,267,200,000	Federal Home Loan Banks	4.320%	20/03/2023	1,267,200,748	2.88

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	国債				
163,000,000	Federal Home Loan Banks	4.330%	14/04/2023	163,002,626	0.37
48,115,000	Federal Home Loan Banks	4.740%	24/11/2023	48,005,089	0.11
52,900,000	Federal Home Loan Banks	4.690%	29/11/2023	52,794,587	0.12
175,000,000	Federal National Mortgage Association	4.410%	10/07/2023	170,896,177	0.39
366,900,000	United States Treasury Bill	4.490%	11/05/2023	360,976,550	0.82
161,600,000	United States Treasury Bill	4.440%	18/05/2023	158,864,288	0.36
102,000,000	United States Treasury Floating Rate Note	(0.165)%	30/04/2023	102,071,338	0.23
国債合計				7,748,476,692	17.59
公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券合計				7,758,808,148	17.62
	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				
95,000,000	ABN AMRO Bank NV	4.657%	17/03/2023	94,089,001	0.21
406,500,000	ABN AMRO Bank NV	4.832%	03/04/2023	401,567,952	0.91
114,458,000	Bank of Montreal	4.452%	13/01/2023	114,464,122	0.26
80,000,000	Bank of Nova Scotia	4.800%	17/02/2023	80,016,607	0.18
85,748,000	Bank of Nova Scotia	4.800%	21/02/2023	85,769,489	0.20
99,535,000	Bank of Nova Scotia	4.756%	28/07/2023	99,677,120	0.23
145,000,000	Commonwealth Bank of Australia	4.810%	28/02/2023	145,043,352	0.33
150,301,000	Cooperatieve Rabobank UA	4.960%	03/05/2023	150,457,484	0.34
99,089,000	Cooperatieve Rabobank UA	4.930%	24/05/2023	99,189,404	0.23
75,434,000	Cooperatieve Rabobank UA	4.830%	07/07/2023	75,464,156	0.17
42,000,000	Credit Agricole CIB	4.107%	01/02/2023	41,833,512	0.10
160,000,000	Credit Agricole CIB	4.692%	22/03/2023	158,393,746	0.36
127,500,000	Credit Agricole SA/London	3.828%	01/03/2023	126,554,021	0.29
204,427,000	Credit Industriel et Commercial	4.710%	09/01/2023	204,426,953	0.46
153,492,000	FUJIFILM Holdings Corp	4.674%	18/01/2023	153,134,307	0.35
139,000,000	FUJIFILM Holdings Corp	4.695%	06/02/2023	138,347,173	0.31
75,000,000	KBC Bank NV	4.310%	04/01/2023	75,000,000	0.17
265,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	4.300%	03/01/2023	265,000,000	0.60
80,000,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	4.835%	20/01/2023	79,805,960	0.18
34,000,000	Mizuho Bank Ltd	4.531%	09/01/2023	34,002,456	0.08
5,000,000	Mizuho Bank Ltd	4.445%	20/01/2023	5,001,207	0.01
204,000,000	Mizuho Bank Ltd	4.703%	27/01/2023	203,257,165	0.46
27,661,000	Mizuho Bank Ltd	4.580%	01/02/2023	27,662,968	0.06
177,200,000	Mizuho Bank Ltd	4.880%	01/03/2023	177,294,678	0.40
330,000,000	MUFG Bank Ltd	4.300%	03/01/2023	330,000,000	0.75
200,000,000	MUFG Bank Ltd	4.600%	04/01/2023	199,997,908	0.45
9,400,000	MUFG Bank Ltd	4.462%	04/01/2023	9,400,394	0.02
200,000,000	MUFG Bank Ltd	4.566%	10/02/2023	199,026,092	0.45
281,778,000	MUFG Bank Ltd	4.910%	15/03/2023	281,919,044	0.64
460,000,000	National Bank of Kuwait	4.330%	03/01/2023	460,000,382	1.05
200,000,000	National Bank of Kuwait	4.330%	04/01/2023	200,000,220	0.45
205,000,000	National Bank of Kuwait	4.330%	05/01/2023	205,000,283	0.47
130,328,000	National Bank of Kuwait	4.590%	17/01/2023	130,329,761	0.30
225,307,800	National Bank of Kuwait	4.520%	30/01/2023	225,309,668	0.51
40,000,000	National Bank of Kuwait	5.020%	17/02/2023	40,006,258	0.09
17,183,000	National Westminster Bank Plc	4.111%	17/01/2023	17,133,682	0.04
168,500,000	National Westminster Bank Plc	4.682%	15/03/2023	166,877,586	0.38
314,094,000	Natixis SA	4.450%	31/01/2023	314,104,271	0.71
80,000,000	Natixis SA	4.900%	05/05/2023	80,102,402	0.18
94,324,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.540%	06/01/2023	94,321,869	0.21
72,369,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.585%	24/01/2023	72,376,816	0.17

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
譲渡性預金証書					
191,037,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.800%	17/02/2023	191,085,829	0.43
52,705,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.710%	20/06/2023	52,708,003	0.12
44,252,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB	4.820%	14/04/2023	44,272,933	0.10
273,716,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	4.750%	09/02/2023	273,733,104	0.62
100,000,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	4.780%	03/03/2023	100,026,412	0.23
305,665,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	4.850%	09/03/2023	305,766,160	0.69
199,782,000	Sumitomo Mitsui Banking Corp	4.700%	06/07/2023	199,807,173	0.45
279,885,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	4.800%	14/02/2023	279,940,112	0.64
88,610,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	4.810%	21/02/2023	88,634,354	0.20
272,247,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	4.740%	16/03/2023	272,314,082	0.62
4,240,000	Svenska Handelsbanken AB	4.402%	23/01/2023	4,241,214	0.01
269,586,000	Svenska Handelsbanken AB	4.980%	02/05/2023	269,849,588	0.61
50,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.557%	03/02/2023	50,012,890	0.11
117,329,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.626%	30/03/2023	117,404,408	0.27
400,000,000	Truist Financial Corp	4.450%	31/01/2023	400,000,000	0.91
2,679,000	Westpac Banking Corp	4.795%	12/01/2023	2,678,743	0.01
譲渡性預金証書合計				8,713,834,474	19.78
コマーシャル・ペーパー					
378,105,000	Albion Capital LLC	4.380%	03/01/2023	377,966,995	0.86
110,410,000	Albion Capital LLC	4.750%	03/03/2023	109,530,740	0.25
93,626,000	Albion Capital LLC	4.720%	20/03/2023	92,662,692	0.21
89,314,000	Antalis	4.100%	09/01/2023	89,218,903	0.20
39,525,000	Antalis	4.510%	18/01/2023	39,437,766	0.09
62,523,000	Antalis	4.510%	19/01/2023	62,376,722	0.14
112,492,000	ASB Finance Ltd	4.540%	13/03/2023	112,488,701	0.26
32,945,000	Atlantic Asset Securitisation LLC	4.600%	12/01/2023	32,943,349	0.07
32,877,000	Atlantic Asset Securitisation LLC	4.600%	13/01/2023	32,875,135	0.07
70,379,000	Atlantic Asset Securitisation LLC	4.820%	02/03/2023	69,838,545	0.16
22,444,000	Atlantic Asset Securitisation LLC	5.180%	25/04/2023	22,100,193	0.05
52,000,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	4.820%	23/02/2023	52,015,908	0.12
262,176,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	4.970%	02/05/2023	262,427,553	0.60
40,000,000	Banco Santander SA	4.798%	17/02/2023	40,009,397	0.09
50,000,000	Bank of Montreal	4.591%	13/01/2023	49,998,415	0.11
204,803,000	Bank of Montreal	5.000%	02/05/2023	205,020,261	0.47
77,646,000	Bank of Nova Scotia	4.630%	06/02/2023	77,658,493	0.18
16,599,000	Bank of Nova Scotia	4.628%	24/03/2023	16,609,740	0.04
145,834,000	Bank of Nova Scotia	4.830%	06/06/2023	145,948,073	0.33
100,000,000	Banque Federative Du Credit Mutuel	3.846%	09/02/2023	99,521,980	0.23
73,719,000	Barclays Bank Plc	4.840%	06/04/2023	73,751,105	0.17
87,806,000	Bedford Row Funding Corp	4.270%	24/01/2023	87,556,044	0.20
174,635,000	Bedford Row Funding Corp	4.270%	26/01/2023	174,096,441	0.40
87,805,000	Bedford Row Funding Corp	4.300%	31/01/2023	87,479,877	0.20
30,000,000	Bedford Row Funding Corp	4.550%	06/02/2023	29,861,345	0.07
85,000,000	Bedford Row Funding Corp	4.950%	27/04/2023	85,091,504	0.19
168,700,000	BofA Securities	5.020%	05/06/2023	168,917,792	0.38
228,820,000	BPCE SA	4.750%	10/07/2023	228,822,073	0.52
84,568,000	BrightHouse Financial Short Term Funding LLC	4.720%	20/03/2023	83,687,177	0.19
170,000,000	Caisse Des Depots ET Consignations	4.300%	31/01/2023	169,395,716	0.38
349,000,000	Chesham Finance Ltd - Series III	4.310%	03/01/2023	348,874,650	0.79
178,524,000	Citigroup Global Markets Inc	4.700%	05/04/2023	178,523,600	0.41
22,000,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	4.370%	24/01/2023	21,935,907	0.05
109,408,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	4.850%	26/01/2023	109,417,040	0.25

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	コマーシャル・ペーパー				
68,384,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	4.370%	03/02/2023	68,101,766	0.15
66,000,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	4.780%	03/04/2023	65,191,412	0.15
52,873,000	Collateralized Commercial Paper II Co LLC	4.780%	04/04/2023	52,217,926	0.12
14,300,000	Columbia Funding Co LLC	4.250%	06/01/2023	14,289,871	0.03
65,000,000	Columbia Funding Co LLC	4.280%	20/01/2023	64,845,448	0.15
32,715,000	Commonwealth Bank of Australia	4.810%	07/06/2023	32,733,028	0.07
46,000,000	Credit Suisse AG	4.810%	06/06/2023	46,030,790	0.10
68,436,000	DBS Bank Ltd	4.600%	01/03/2023	67,918,850	0.15
38,020,000	DBS Bank Ltd	5.030%	16/06/2023	37,146,706	0.08
38,438,000	DBS Bank Ltd	5.000%	30/06/2023	37,473,368	0.09
160,734,000	DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	4.740%	23/03/2023	159,010,798	0.36
69,253,000	Eli Lilly and Company	4.220%	12/01/2023	69,158,725	0.16
45,127,000	Fairway Finance Company LLC	5.000%	08/05/2023	45,168,933	0.10
75,000,000	Federal Realty Investment Trust	4.330%	24/01/2023	74,783,501	0.17
585,000,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	4.330%	03/01/2023	584,788,920	1.33
262,000,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	4.300%	04/01/2023	261,874,822	0.59
278,194,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	4.350%	27/01/2023	277,286,378	0.63
100,000,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	4.350%	30/01/2023	99,637,499	0.23
292,683,000	First Abu Dhabi Bank PJSC	4.750%	06/03/2023	290,286,971	0.66
130,292,000	Gotham Funding Corporation	4.040%	17/01/2023	130,014,455	0.30
44,595,000	Gotham Funding Corporation	4.700%	07/02/2023	44,375,878	0.10
104,278,000	Gotham Funding Corporation	4.700%	08/02/2023	103,743,610	0.24
110,755,000	Gotham Funding Corporation	4.830%	01/03/2023	109,897,197	0.25
119,595,000	Gotham Funding Corporation	4.725%	02/03/2023	118,653,293	0.27
69,941,000	Gotham Funding Corporation	4.800%	03/03/2023	69,372,912	0.16
55,787,000	Gotham Funding Corporation	4.710%	06/04/2023	55,064,286	0.13
80,000,000	GTA Funding LLC	4.160%	03/01/2023	79,972,267	0.18
80,000,000	GTA Funding LLC	3.240%	09/01/2023	79,914,720	0.18
110,000,000	GTA Funding LLC	4.000%	10/01/2023	109,869,711	0.25
127,987,000	GTA Funding LLC	4.200%	12/01/2023	127,802,230	0.29
111,983,000	GTA Funding LLC	4.300%	23/01/2023	111,663,843	0.25
105,194,000	GTA Funding LLC	4.200%	25/01/2023	104,869,279	0.24
100,000,000	GTA Funding LLC	4.570%	03/03/2023	99,224,869	0.23
328,739,000	ING (U.S.) Funding LLC	4.820%	24/02/2023	328,795,678	0.75
289,500,000	Jyske Bank A/S	4.442%	02/02/2023	288,321,089	0.65
40,000,000	LA Fayette Asset Securitisation LLC	4.740%	02/02/2023	39,998,417	0.09
43,000,000	Liberty Street Funding LLC	4.600%	03/02/2023	42,810,357	0.10
20,000,000	Liberty Street Funding LLC	4.750%	06/02/2023	19,906,862	0.05
40,367,000	Liberty Street Funding LLC	4.850%	20/04/2023	39,777,285	0.09
35,183,000	Liberty Street Funding LLC	5.050%	27/06/2023	34,307,262	0.08
80,798,000	Lime Funding LLC	4.120%	05/01/2023	80,751,216	0.18
140,000,000	Lime Funding LLC	4.360%	12/01/2023	139,796,532	0.32
173,708,000	Lime Funding LLC	4.345%	13/01/2023	173,447,280	0.39
45,929,000	LMA SA	4.100%	09/01/2023	45,879,077	0.10
24,900,000	LMA SA	4.270%	10/01/2023	24,870,465	0.06
31,822,000	LMA SA	3.880%	17/01/2023	31,754,467	0.07
40,104,000	LMA SA	3.480%	18/01/2023	40,013,705	0.09
45,146,000	LMA SA	4.700%	03/02/2023	44,949,184	0.10
32,000,000	LMA SA	3.630%	24/02/2023	31,775,468	0.07
45,460,000	LMA SA	4.850%	01/03/2023	45,115,715	0.10
68,102,000	LMA SA	4.854%	04/04/2023	67,259,143	0.15
34,425,000	LMA SA	4.760%	13/04/2023	33,949,728	0.08

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	コマーシャル・ペーパー				
24,000,000	LMA SA	5.180%	27/04/2023	23,613,196	0.05
200,000,000	Longship Funding LLC	4.380%	09/02/2023	199,026,680	0.45
65,000,000	Macquarie Bank Ltd	4.700%	08/02/2023	65,000,319	0.15
88,000,000	Macquarie Bank Ltd	4.550%	27/03/2023	87,995,871	0.20
67,900,000	Macquarie Bank Ltd	4.590%	05/04/2023	67,902,535	0.15
80,000,000	Managed And Enhanced Tap (Magenta) Funding SAT	4.515%	02/02/2023	79,685,296	0.18
20,000,000	Manhattan Asset Funding Company LLC	4.480%	09/01/2023	20,000,500	0.05
50,000,000	Matchpoint Finance Plc	4.495%	02/02/2023	49,800,425	0.11
18,000,000	Matchpoint Finance Plc	4.810%	05/04/2023	17,772,624	0.04
155,560,000	Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp	4.130%	06/01/2023	155,452,407	0.35
162,486,000	Mizuho Bank Ltd	4.630%	17/01/2023	162,482,037	0.37
316,611,000	Mizuho Bank Ltd	4.330%	27/01/2023	315,582,809	0.72
122,766,000	National Australia Bank Ltd	4.725%	03/01/2023	122,766,702	0.28
72,889,000	National Bank of Canada	4.700%	13/02/2023	72,895,817	0.17
76,065,000	National Bank of Canada	4.800%	13/02/2023	76,080,780	0.17
90,000,000	National Bank of Canada	4.750%	17/02/2023	90,017,830	0.20
37,100,000	National Bank of Canada	4.700%	16/03/2023	37,110,607	0.08
256,715,000	National Bank of Canada	4.720%	03/04/2023	256,825,521	0.58
75,000,000	National Securities Clearing Corp	4.300%	10/01/2023	74,916,814	0.17
122,811,000	Nieuw Amsterdam Receivables Corp	4.050%	09/01/2023	122,680,049	0.28
129,581,000	Nordea Bank AB	4.950%	27/04/2023	129,711,234	0.29
215,275,000	Nordea Bank AB	4.760%	09/06/2023	215,356,987	0.49
206,000,000	NRW Bank	4.170%	03/01/2023	205,928,415	0.47
8,350,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.603%	28/02/2023	8,350,647	0.02
157,851,000	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	4.680%	10/04/2023	157,824,424	0.36
63,000,000	Regency Markets No. 1 LLC	4.310%	12/01/2023	62,917,478	0.14
131,106,000	Regency Markets No. 1 LLC	4.390%	20/01/2023	130,786,246	0.30
85,000,000	Ridgefield Funding Co LLC	4.800%	10/02/2023	85,009,898	0.19
200,000,000	Ridgefield Funding Co LLC	4.710%	07/03/2023	200,029,590	0.45
28,460,000	Ridgefield Funding Co LLC	4.710%	05/04/2023	28,464,742	0.06
170,823,000	Ridgefield Funding Co LLC	4.680%	11/04/2023	170,832,224	0.39
25,000,000	Ridgefield Funding Co LLC	4.880%	18/05/2023	24,530,682	0.06
287,443,000	Salisbury Receivables Company LLC	4.830%	08/05/2023	287,524,602	0.65
33,953,000	Sheffield Receivables Company LLC	4.800%	25/01/2023	33,953,225	0.08
314,274,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB	4.780%	03/02/2023	314,299,271	0.71
65,000,000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd	4.320%	25/01/2023	64,805,000	0.15
201,114,000	The State of the Netherlands	4.330%	26/01/2023	200,559,068	0.46
55,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.557%	03/02/2023	55,014,180	0.12
150,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.910%	24/04/2023	150,111,600	0.34
219,938,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.960%	01/05/2023	220,222,963	0.50
181,750,000	UBS AG	4.720%	20/04/2023	181,762,543	0.41
152,700,000	UBS AG	5.020%	26/04/2023	152,735,139	0.35
90,247,000	UBS AG	5.020%	02/05/2023	90,270,758	0.20
58,802,000	United Overseas Bank Ltd	4.708%	20/06/2023	58,793,533	0.13
125,000,000	Verizon Communications Inc	4.750%	03/02/2023	124,991,139	0.28
36,652,000	Verizon Communications Inc	4.750%	13/02/2023	36,448,132	0.08
78,228,000	Verizon Communications Inc	4.830%	03/03/2023	77,600,791	0.18
34,468,000	Verizon Communications Inc	4.720%	09/03/2023	34,168,448	0.08
65,418,000	Verizon Communications Inc	4.870%	05/04/2023	64,593,733	0.15
110,851,000	Verizon Communications Inc	4.880%	10/04/2023	109,382,465	0.25
48,450,000	Verizon Communications Inc	4.830%	14/04/2023	47,783,146	0.11
100,000,000	Verizon Communications Inc	5.040%	01/06/2023	97,928,550	0.22

GSビッグデータ・ストラテジー（米国小型株）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
コマーシャル・ペーパー					
131,755,000	Victory Receivables Corp	4.000%	06/01/2023	131,659,848	0.30
106,474,000	Victory Receivables Corp	4.650%	10/01/2023	106,345,108	0.24
150,000,000	Victory Receivables Corp	4.600%	01/02/2023	149,385,720	0.34
101,661,000	Victory Receivables Corp	4.710%	05/04/2023	100,391,457	0.23
20,000,000	Westpac Banking Corp	4.537%	23/03/2023	20,010,084	0.05
75,605,000	Westpac Banking Corp	5.160%	23/06/2023	73,795,678	0.17
コマーシャル・ペーパー合計				15,585,810,591	35.39
現先取引					
260,300,000	BNP Paribas Repo	4.300%	03/01/2023	260,300,000	0.59
500,000,000	BofA Securities Repo	4.100%	03/01/2023	500,000,000	1.13
391,000,000	BofA Securities Repo	4.300%	03/01/2023	391,000,000	0.89
650,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	4.300%	03/01/2023	650,000,000	1.48
100,000,000	State Street Bank And Trust Co Repo	4.050%	03/01/2023	100,000,000	0.23
680,000,000	State Street Bank And Trust Co Repo	4.300%	03/01/2023	680,000,000	1.54
3,000,000,000	State Street Bank And Trust Co Repo	4.300%	03/01/2023	3,000,000,000	6.81
現先取引合計				5,581,300,000	12.67
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				29,880,945,065	67.84
預金					
定期預金					
1,400,000,000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd	4.320%	03/01/2023	1,400,000,000	3.17
1,175,000,000	Banco Santander SA	4.300%	03/01/2023	1,175,000,000	2.67
1,150,000,000	Canadian Imperial Bank of Commerce	4.300%	03/01/2023	1,150,000,000	2.61
100,000,000	Credit Agricole CIB	4.290%	03/01/2023	100,000,000	0.23
630,000,000	Credit Industriel et Commercial	4.320%	03/01/2023	630,000,000	1.43
100,000,000	Nordea Bank AB	4.290%	03/01/2023	100,000,000	0.23
300,000,000	Skandinaviska Enskilda Banken AB	4.300%	03/01/2023	300,000,000	0.68
1,000,000,000	Societe Generale	4.430%	03/01/2023	1,000,000,000	2.27
1,000,000,000	Societe Generale	4.430%	04/01/2023	1,000,000,000	2.27
500,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.300%	03/01/2023	500,000,000	1.14
100,000,000	Toronto-Dominion Bank/The	4.310%	03/01/2023	100,000,000	0.23
定期預金合計				7,455,000,000	16.93
預金合計				7,455,000,000	16.93
投資資産合計				45,094,753,213	102.39
投資合計					
				10,331,456	0.03
社債合計					
国債合計				7,748,476,692	17.59
譲渡性預金証書合計				8,713,834,474	19.78
コマーシャル・ペーパー合計				15,585,810,591	35.39
現先取引合計				5,581,300,000	12.67
定期預金合計				7,455,000,000	16.93
その他資産・負債				(1,051,132,282)	(2.39)
買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産				44,043,620,931	100.00