

## 年2回決算コース

第6期末(2024年8月13日)		第6期	
基準価額	9,816円	騰落率	2.3%
純資産総額	21,584百万円	分配金合計	0円

## 毎月決算コース(分配条件提示型)

第35期末(2024年8月13日)		第30期～第35期	
基準価額	9,370円	騰落率	2.2%
純資産総額	9,186百万円	分配金合計	400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、環境問題の解決に関連する主要なテーマに沿うと考えられ、かつサステナブル投資と判断される世界の企業の株式(日本を含む)を主要な投資対象とする投資信託証券に投資し、環境へのポジティブかつ測定可能なインパクトの創出、ならびに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・グローバル・エンバイロメンタル・インパクト・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\$トレジャー・リキッド・リザーブズ・ファンド
指定投資信託証券①	日本を含む世界の株式および株式関連証券
指定投資信託証券②	主に米ドル建ての短期金融商品、決済機関への預金およびリバース・レボ取引などの金融市場証券
運用方法・組入制限	①外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。 ②投資信託証券への投資は、高位に維持することを基本とします。 ③株式への直接投資は行いません。
分配方針	原則として毎計算期末(年2回決算コースは毎年2月10日および8月10日、毎月決算コースは毎月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。なお、毎月決算コースは毎計算期末の前営業日の基準価額に応じて分配を行うことをめざします。

## GSグローバル環境リーダーズ

## 愛称: ecoWIN

年2回決算コース

毎月決算コース(分配条件提示型)

追加型投信/内外/株式

年2回決算コース

第6期(決算日2024年8月13日)

毎月決算コース(分配条件提示型)

第30期(決算日2024年3月11日)

第31期(決算日2024年4月10日)

第32期(決算日2024年5月10日)

第33期(決算日2024年6月10日)

第34期(決算日2024年7月10日)

第35期(決算日2024年8月13日)

作成対象期間: 2024年2月14日～2024年8月13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グローバル環境リーダーズ」は、このたび、年2回決算コースにつきましては、第6期の決算、毎月決算コース(分配条件提示型)につきましては、第30期～第35期の決算を行いました。本ファンドは、日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、主として環境問題の解決に関連する主要なテーマに沿うと考えられ、かつサステナブル投資と判断される企業の株式に投資することにより、環境へのポジティブかつ測定可能なインパクトの創出、ならびに信託財産の長期的な成長をめざして運用を行っております。今期の運用経過等について、以下のとおりご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント

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

お問合せ先: 03-4587-6000(代表)

受付時間: 営業日の午前9時～午後5時 | www.gsam.co.jp

## GSグローバル環境リーダーズ 年2回決算コース

(以下、「年2回決算コース」といいます。)

## ■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分 配 額)	税 引 前 金	期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産 額
2期 (2022年8月10日)	円 9,320	円 0	% 4.4	% 99.5	百万円 33,784
3期 (2023年2月10日)	9,219	0	△1.1	98.7	33,504
4期 (2023年8月10日)	9,697	0	5.2	98.6	32,566
5期 (2024年2月13日)	9,600	0	△1.0	98.8	29,235
6期 (2024年8月13日)	9,816	0	2.3	97.9	21,584

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 本ファンドには、ベンチマークは設けておりません。また、外国籍ファンドを主たる投資対象とし、当該外国籍ファンドの値動きを表す適切な参考指数は存在しないと考えております。

## ■当期中の基準価額と市況推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	投 証 資 券 信 託 比 率
(期 首) 2024年2月13日	円 9,600	% —	% 98.8
2月末	9,874	2.9	99.3
3月末	10,491	9.3	99.5
4月末	10,668	11.1	99.3
5月末	11,090	15.5	98.6
6月末	10,911	13.7	98.9
7月末	10,481	9.2	99.0
(期 末) 2024年8月13日	9,816	2.3	97.9

(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) 本ファンドには、ベンチマークは設けておりません。また、外国籍ファンドを主たる投資対象とし、当該外国籍ファンドの値動きを表す適切な参考指数は存在しないと考えております。

GSグローバル環境リーダーズ 毎月決算コース（分配条件提示型）

GSグローバル環境リーダーズ 毎月決算コース（分配条件提示型）

（以下、「毎月決算コース」といいます。）

■最近5作成期の運用実績

決 算 期		基 準 価 額 (分配落)	税 引 前 金	期 騰 落 中 率	投資信託証券 比 率	純 資 産 額
①	6期 (2022年3月10日)	8,167	0	△ 7.8	99.1	18,844
	7期 (2022年4月11日)	9,153	0	12.1	97.8	21,273
	8期 (2022年5月10日)	8,548	0	△ 6.6	98.7	19,852
	9期 (2022年6月10日)	9,288	0	8.7	99.2	21,396
	10期 (2022年7月11日)	8,566	0	△ 7.8	99.4	19,694
	11期 (2022年8月10日)	9,248	0	8.0	97.8	21,201
②	12期 (2022年9月12日)	9,537	0	3.1	97.9	21,562
	13期 (2022年10月11日)	8,524	0	△10.6	98.9	19,066
	14期 (2022年11月10日)	9,073	0	6.4	99.0	20,125
	15期 (2022年12月12日)	9,029	0	△ 0.5	99.1	19,784
	16期 (2023年1月10日)	8,786	0	△ 2.7	99.0	19,108
	17期 (2023年2月10日)	9,142	0	4.1	99.2	19,647
③	18期 (2023年3月10日)	9,173	0	0.3	98.0	19,468
	19期 (2023年4月10日)	8,757	0	△ 4.5	97.4	18,448
	20期 (2023年5月10日)	9,042	0	3.3	99.3	18,937
	21期 (2023年6月12日)	9,409	0	4.1	98.1	19,071
	22期 (2023年7月10日)	9,547	0	1.5	98.8	18,584
	23期 (2023年8月10日)	9,614	0	0.7	97.8	18,102
④	24期 (2023年9月11日)	9,159	0	△ 4.7	98.5	16,950
	25期 (2023年10月10日)	8,437	0	△ 7.9	99.1	15,340
	26期 (2023年11月10日)	8,821	0	4.6	99.5	15,882
	27期 (2023年12月11日)	9,037	0	2.4	98.8	15,464
	28期 (2024年1月10日)	9,188	0	1.7	97.8	14,976
	29期 (2024年2月13日)	9,520	0	3.6	98.3	14,817
⑤	30期 (2024年3月11日)	9,973	0	4.8	98.9	14,221
	31期 (2024年4月10日)	10,287	100	4.2	98.4	13,432
	32期 (2024年5月10日)	10,658	100	4.6	98.0	12,904
	33期 (2024年6月10日)	10,547	100	△ 0.1	98.4	11,377
	34期 (2024年7月10日)	10,501	100	0.5	98.3	10,689
	35期 (2024年8月13日)	9,370	0	△10.8	97.7	9,186

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 本ファンドには、ベンチマークは設けておりません。また、外国籍ファンドを主たる投資対象とし、当該外国籍ファンドの値動きを表す適切な参考指数は存在しないと考えております。

■過去6ヶ月間の基準価額と市況推移

決算期	年 月 日	基準価額	騰落率		投資信託証券比
第30期	(期首) 2024年2月13日	円 9,520	% —	% 98.3	
	2月末	9,791	2.8	99.8	
	(期末) 2024年3月11日	9,973	4.8	98.9	
第31期	(期首) 2024年3月11日	9,973	—	98.9	
	3月末	10,401	4.3	99.7	
	(期末) 2024年4月10日	10,387	4.2	98.4	
第32期	(期首) 2024年4月10日	10,287	—	98.4	
	4月末	10,478	1.9	99.5	
	(期末) 2024年5月10日	10,758	4.6	98.0	
第33期	(期首) 2024年5月10日	10,658	—	98.0	
	5月末	10,777	1.1	98.2	
	(期末) 2024年6月10日	10,647	△ 0.1	98.4	
第34期	(期首) 2024年6月10日	10,547	—	98.4	
	6月末	10,504	△ 0.4	98.1	
	(期末) 2024年7月10日	10,601	0.5	98.3	
第35期	(期首) 2024年7月10日	10,501	—	98.3	
	7月末	9,997	△ 4.8	98.2	
	(期末) 2024年8月13日	9,370	△10.8	97.7	

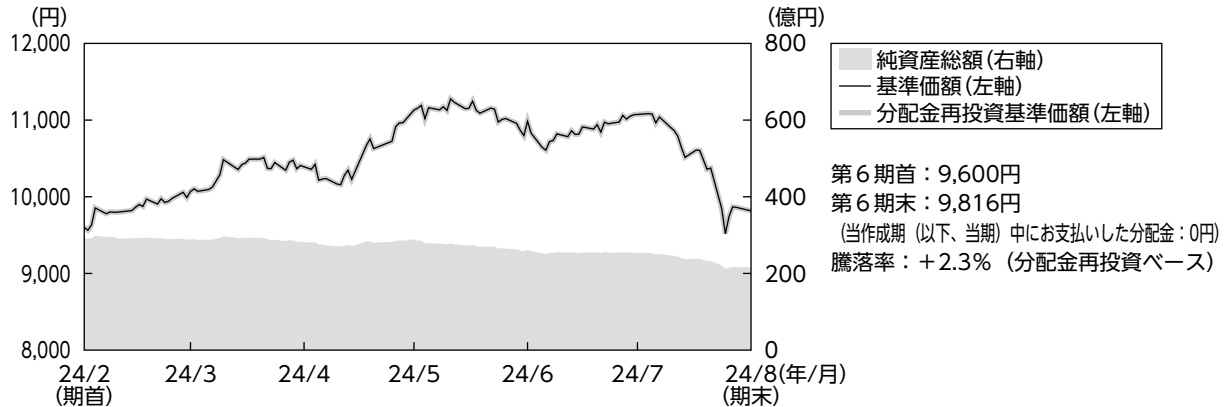
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 本ファンドには、ベンチマークは設けておりません。また、外国籍ファンドを主たる投資対象とし、当該外国籍ファンドの値動きを表す適切な参考指数は存在しないと考えております。

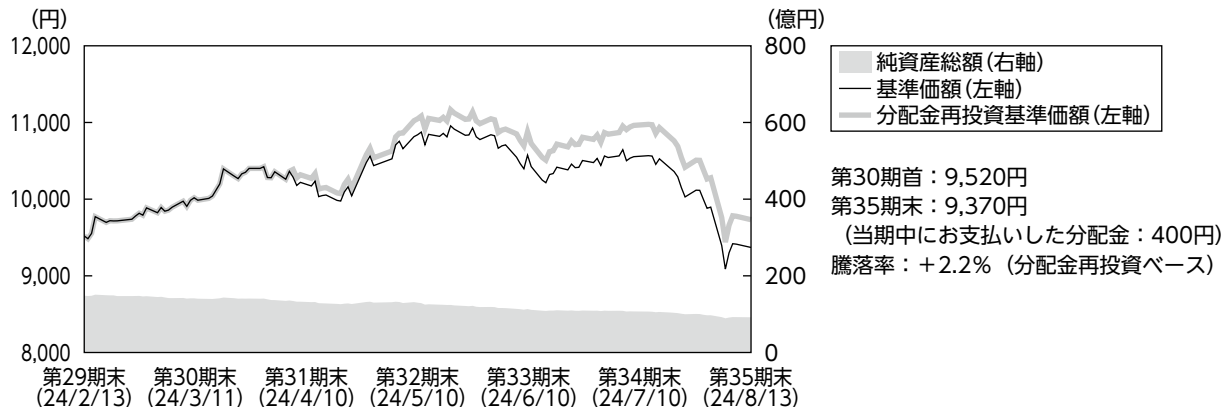
## ■運用経過

◆基準価額等の推移について（2024年2月14日～2024年8月13日）

## ○年2回決算コース



## ○毎月決算コース



(注1) 年2回決算コースおよび毎月決算コースの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定していません。

(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は、期首の基準価額の基準価額を起点として指数化しています。

(注5) 騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しています。

**◆基準価額の主な変動要因**

- 年2回決算コースの基準価額は、期首の9,600円から216円上昇し、期末には9,816円となりました。
- 毎月決算コースの基準価額は、期首の9,520円から150円下落し、期末には9,370円となりました。  
(以下、2ファンドを総称して「本ファンド」ということがあります。)

**上昇要因**

投資銘柄のうち、ネクステラ・エナジー（公益事業）、DSMフィルムニッヒ（素材）、DSスミス（素材）などの株価が保有期間中に上昇したことが、基準価額の主な上昇要因となりました。

**下落要因**

投資銘柄のうち、ソーラーエッジテクノロジーズ（情報技術）、ショールズ・テクノロジーズ・グループ（資本財・サービス）、ダッソー・システムズ（情報技術）などの株価が保有期間中に下落したことが、基準価額の主な下落要因となりました。

## ◆投資環境について

## &lt;世界株式市場&gt;

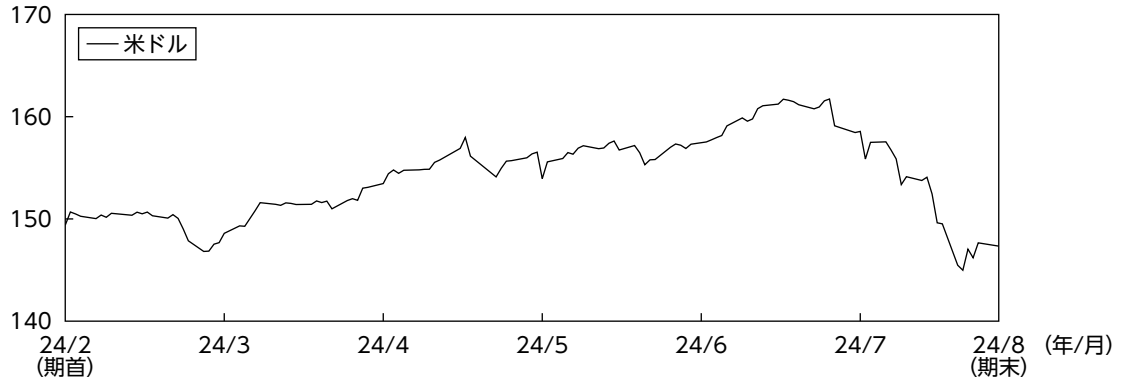
当期の世界株式市場は上昇しました。期前半には、高金利政策の継続に伴う景気抑制効果が顕在化していくことで景気が緩やかに減速すると予想されていたものの、生成AI（人工知能）をテーマに半導体関連銘柄や大型テクノロジー株が買いを集めたことで、世界株式市場は堅調に推移しました。期後半では、6月の米CPI（消費者物価指数）が4年ぶりに前月比マイナスに転じるなど、インフレが鎮静化しつつあるとの確信が強まる一方で、景気指標の悪化により景気悪化懸念が高まったことや、好調な株式市場に対する利益確定の動きなどから、期末にかけて軟調な動きとなりました。なお日本市場では、7月末に日銀が利上げを実施した結果、急激な円高に加え、米国経済への先行き不安も重なり、他国市場以上に株価が急落したことが注目されました。

## &lt;外国為替市場&gt;

当期の外国為替市場では、米ドルは円に対して下落しました。

## ○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

## &lt;短期金融市場&gt;

当期において、米国T-Bill 1ヵ月は前期末の5.3%程度から前後に推移したものの、同水準で期末を迎えました。

## ◆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・エンバイロメンタル・インパクト・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 \$トレジャリー・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・エンバイロメンタル・インパクト・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、日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、環境問題の解決に関連する主要なテーマに沿うと考えられ、かつサステナブル投資と判断される企業の株式に投資することにより、環境へのポジティブかつ測定可能なインパクトの創出、ならびに信託財産の長期的な成長をめざして運用を行いました。

## ＜ゴールドマン・サックス・グローバル・エンバイロメンタル・インパクト・エクイティ・ポートフォリオ＞

当ポートフォリオでは、ユニバース構築の過程で環境テーマとの整合性を取るとともに、ボトムアップによる調査に基づき、ファンダメンタルズとバリュエーションの観点から投資妙味が期待される銘柄への投資を行います。当期間中、個別銘柄では、BYD（一般消費財・サービス）、シグ・グループ（素材）、ヴェスタス・ウィンド・システムズ（資本財・サービス）の新規投資、ソーラーエッジテクノロジー（情報技術）、ユミコア（素材）、シンイー・ソーラー（情報技術）の全売却などのトレードを実施しました。

## ＜ゴールドマン・サックス US \$トレジャリー・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商品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**

本ファンドの値動きと比較する適切な指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定していません。

**◆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、年2回決算コースは、第6期の分配は行わないこととしました。毎月決算コース（分配条件提示型）は、第30期および第35期は0円、第31期から第34期は各100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・グローバル・エンバイロメンタル・インパクト・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 \$ トレジャリー・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・エンバイロメンタル・インパクト・エクイティ・ポートフォリオを高位に組入れることで、日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、環境問題の解決に関連する主要なテーマに沿うと考えられ、かつサステナブル投資と判断される企業の株式に投資することにより、環境へのポジティブかつ測定可能なインパクトの創出、ならびに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・グローバル・エンバイロメンタル・インパクト・エクイティ・ポートフォリオ>**

想定以上に強いインフレが続いた後、各国中央銀行による金融引き締めにより、足元ではインフレ鈍化の見方が形成されつつあり、欧米における今後の金融政策のハト派転換期待が広がっています。米国経済は底堅く推移し、懸念されたほどの景気悪化はまだ見られていませんが、今後の景気の先行き不透明感は依然として残っています。また、ウクライナ危機や中東情勢などの地政学リスクは依然として高く、選挙などの政治的なリスクも意識され、企業業績を慎重に見極めた上での銘柄選択が重要な局面が継続するものと考えます。

ファンドにとっては、長期的にはグリーン化の潮流に変化はなく、世界各地で気候変動に対する問題意識が高まり、更なるコミットメントが求められるなかでは、当戦略が投資対象とする銘柄は引き続き恩恵が期待されるものと想定します。ファンドの投資哲学は市場の短期的な変動によって変わることはなく、引き続き、環境テーマとの整合性をとりながら、ボトムアップによる調査に基づき、ファンダメンタルズとバリュエーションの観点から投資妙味が期待される銘柄への投資を行います。

**<ゴールドマン・サックス US \$ トレジャリー・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。

（上記見通しは2024年8月13日現在のものであり、今後見通しは変更されることもあります。）

## 年2回決算コース

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2024年2月14日～2024年8月13日		
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	94円 (46)	0.889% (0.438)	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)	(46)	(0.438)	
(受託会社)	(1)	(0.014)	
その他費用 (保管費用)	1 (0)	0.010 (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)	(0)	(0.003)	
(その他)	(1)	(0.007)	
合計	95	0.899	
期中の平均基準価額は10,585円です。			

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

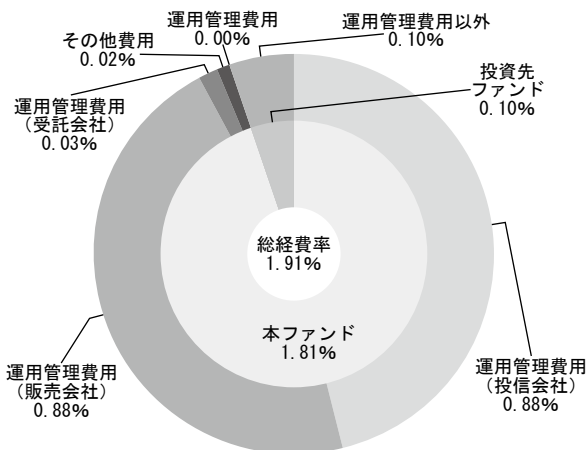
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

## ■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.91%です。



総経費率 (①+②+③)	1.91%
①本ファンドの費用の比率	1.81%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

## ■売買及び取引の状況（2024年2月14日から2024年8月13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.G.A.V.ーゴールドマン・サックス・ グローバル・エンバイロメンタル・ インパクト・エクイティ・ ポートフォリオ I Oクラス	—	—	7,014,389	59,100
国	—	—	118	1,300
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシーーゴールドマン・サックス US\$トレジャリー・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	—	—	118	1,300

(注) 金額は受渡し代金。

## ■利害関係人との取引状況等（2024年2月14日から2024年8月13日まで）

利害関係人との取引はありません。

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

## ■組入資産の明細（2024年8月13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.G.A.V.ーゴールドマン・サックス・ グローバル・エンバイロメンタル・ インパクト・エクイティ・ ポートフォリオ I Oクラス	16,908,167	139,492	20,552,807	95.2
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシーーゴールドマン・サックス US\$トレジャリー・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	359	3,972	585,289	2.7
合計	16,908,526	143,464	21,138,097	<97.9%>

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する比率。

## ■投資信託財産の構成

2024年8月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 証 券	21,138,097	96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	719,530	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	21,857,627	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(21,138,097千円)の投資信託財産総額(21,857,627千円)に対する比率は96.7%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=147.34円です。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	当 期 末
	2024年8月13日
(A) 資 産	21,857,627,739円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	719,527,033
投 資 証 券(評価額)	21,138,097,085
未 収 利 息	3,621
(B) 負 債	273,234,316
未 払 解 約 金	29,964,677
未 払 信 託 報 酬	240,600,144
そ の 他 未 払 費 用	2,669,495
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	21,584,393,423
元 本	21,988,255,361
次 期 繰 越 損 益 金	△ 403,861,938
(D) 受 益 権 総 口 数	21,988,255,361口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,816円

## ■損益の状況

項 目	当 期
	自 2024年2月14日 至 2024年8月13日
(A) 配 当 等 収 益	86,900円
受 取 利 息	112,129
支 払 利 息	△ 25,229
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	674,817,492
売 買 損 益	1,501,080,919
売 買 損 益	△ 826,263,427
(C) 信 託 報 酬 等	△ 243,337,822
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	431,566,570
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 297,876,267
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 537,552,241
(配 当 等 相 当 額)	( 35,524,083)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 573,076,324)
(G) 計 (D+E+F)	△ 403,861,938
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△ 403,861,938
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 537,552,241
(配 当 等 相 当 額)	( 35,524,083)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 573,076,324)
分 配 準 備 積 立 金	168,478,893
繰 越 損 益 金	△ 34,788,590

(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30,454,534,894円、当作成期間中において、追加設定元本額は584,367,725円、同解約元本額は9,050,647,258円です。

毎月決算コース

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第30期～第35期		項目の概要
	2024年2月14日～2024年8月13日		
	金額	比率	
信託報酬 (投信会社)	92円 (45)	0.889% (0.438)	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)	(45)	(0.438)	
(受託会社)	( 1)	(0.014)	
その他費用 (保管費用)	1 ( 0)	0.014 (0.001)	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)	( 1)	(0.008)	
合計	93	0.903	
期中の平均基準価額は10,324円です。			

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

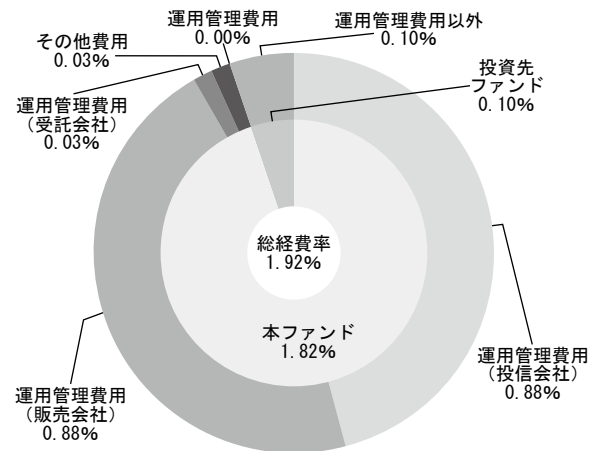
(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(参考情報)

■ 総経費率

当作成対象期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.92%です。



総経費率 (①+②+③)	1.92%
①本ファンドの費用の比率	1.82%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.10%

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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

■売買及び取引の状況（2024年2月14日から2024年8月13日まで）

投資信託証券

決 算 期 銘 柄 名		第 30 期 ~		第 35 期	
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ゴールドマン・サックス・ファンズ S.I.C.A.V.ーゴールドマン・サックス・ グローバル・エンバイロメンタル・ インパクト・エクイティ・ ポートフォリオ IOクラス	口	千米ドル	口	千米ドル
	—	—	4,844,416	40,900	
	ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシーーゴールドマン・サックス US\$トレジャリー・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	—	—	109	1,200

(注) 金額は受渡し代金。

■利害関係人との取引状況等（2024年2月14日から2024年8月13日まで）

利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細（2024年8月13日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 35 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.ーゴールドマン・サックス・ グローバル・エンバイロメンタル・ インパクト・エクイティ・ ポートフォリオ IOクラス	7,188,987	59,309	8,738,609	95.1
ゴールドマン・サックス・ファンズ・ ピーエルシーーゴールドマン・サックス US\$トレジャリー・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	146	1,623	239,142	2.6
合 計	7,189,134	60,932	8,977,751	<97.7%>

(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

2024年8月13日現在

項 目	第 35 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 8,977,751	% 97.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	231,733	2.5
投 資 信 託 財 産 総 額	9,209,484	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産（8,977,751千円）の投資信託財産総額（9,209,484千円）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=147.34円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第 30 期 末	第 31 期 末	第 32 期 末	第 33 期 末	第 34 期 末	第 35 期 末
	2024年3月11日	2024年4月10日	2024年5月10日	2024年6月10日	2024年7月10日	2024年8月13日
(A) 資 産	14,566,320,658円	13,723,751,354円	13,692,200,719円	11,601,602,325円	10,947,550,098円	9,209,484,618円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	507,058,593	503,851,411	517,696,199	408,987,368	99,352,767	231,731,705
投 資 証 券(評価額)	14,059,262,065	13,219,899,480	12,645,274,501	11,192,614,517	10,508,941,879	8,977,751,747
未 収 入 金	—	—	529,229,550	—	339,255,000	—
未 収 利 息	—	463	469	440	452	1,166
(B) 負 債	344,977,690	291,588,645	787,998,222	224,022,157	257,824,086	23,455,981
未 払 金	—	—	264,529,860	—	—	—
未 払 収 益 分 配 金	—	130,576,542	121,072,275	107,870,663	101,801,041	—
未 払 解 約 金	325,384,521	140,192,612	383,097,473	97,254,233	139,573,095	6,360,187
未 払 信 託 報 酬	19,351,588	20,563,877	19,061,670	18,610,436	16,143,411	16,707,499
未 払 利 息	1,033	—	—	—	—	—
そ の 他 未 払 費 用	240,548	255,614	236,944	286,825	306,539	388,295
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	14,221,342,968	13,432,162,709	12,904,202,497	11,377,580,168	10,689,726,012	9,186,028,637
元 本	14,260,211,268	13,057,654,275	12,107,227,577	10,787,066,350	10,180,104,136	9,804,149,557
次 期 繰 越 損 益 金	△ 38,868,300	374,508,434	796,974,920	590,513,818	509,621,876	△ 618,120,920
(D) 受 益 権 総 口 数	14,260,211,268口	13,057,654,275口	12,107,227,577口	10,787,066,350口	10,180,104,136口	9,804,149,557口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,973円	10,287円	10,658円	10,547円	10,501円	9,370円

(注) 当作成期首元本額は15,564,989,358円、当作成期間（第30期～第35期）中において、追加設定元本額は211,843,414円、同解約元本額は5,972,683,215円です。

■損益の状況

項 目	第 30 期	第 31 期	第 32 期	第 33 期	第 34 期	第 35 期
	自 2024年2月14日 至 2024年3月11日	自 2024年3月12日 至 2024年4月10日	自 2024年4月11日 至 2024年5月10日	自 2024年5月11日 至 2024年6月10日	自 2024年6月11日 至 2024年7月10日	自 2024年7月11日 至 2024年8月13日
(A) 配 当 等 収 益	△ 16,062円	2,383円	6,613円	13,008円	7,591円	20,225円
受 取 利 息	19	6,191	6,613	13,008	7,591	20,225
支 払 利 息	△ 16,081	△ 3,808	—	—	—	—
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	665,455,919	561,278,574	590,176,240	7,104,106	70,679,074	△1,091,292,257
売 買 益	924,168,500	567,570,453	616,601,210	113,039,144	320,240,560	7,786,854
売 買 損	△258,712,581	△ 6,291,879	△ 26,424,970	△105,935,038	△249,561,486	△1,099,079,111
(C) 信 託 報 酬 等	△ 19,603,492	△ 20,828,645	△ 19,305,630	△ 18,911,327	△ 16,462,145	△ 17,117,112
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	645,836,365	540,452,312	570,877,223	△ 11,794,213	54,224,520	△1,108,389,144
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△470,556,079	160,406,320	526,370,953	866,219,960	701,636,935	627,274,786
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△214,148,586	△195,773,656	△179,200,981	△156,041,266	△144,438,538	△ 137,006,562
(配 当 等 相 当 額)	( 115,384,457)	( 105,950,491)	( 100,640,770)	( 93,181,480)	( 90,895,764)	( 90,169,912)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△329,533,043)	(△301,724,147)	(△279,841,751)	(△249,222,746)	(△235,334,302)	(△ 227,176,474)
(G) 計 (D + E + F)	△ 38,868,300	505,084,976	918,047,195	698,384,481	611,422,917	△ 618,120,920
(H) 収 益 分 配 金	0	△130,576,542	△121,072,275	△107,870,663	△101,801,041	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	△ 38,868,300	374,508,434	796,974,920	590,513,818	509,621,876	△ 618,120,920
追 加 信 託 差 損 益 金	△214,148,586	△195,773,656	△179,200,981	△156,041,266	△144,438,538	△ 137,006,562
(配 当 等 相 当 額)	( 115,384,457)	( 105,950,491)	( 100,640,770)	( 93,181,480)	( 90,895,764)	( 90,169,912)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△329,533,043)	(△301,724,147)	(△279,841,751)	(△249,222,746)	(△235,334,302)	(△ 227,176,474)
分 配 準 備 積 立 金	561,377,817	570,282,090	976,175,901	758,349,297	654,060,414	627,274,786
繰 越 損 益 金	△386,097,531	—	—	△ 11,794,213	—	△1,108,389,144

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

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

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



## ■分配金のお知らせ

## 毎月決算コース

決 算 期	第 30 期	第 31 期	第 32 期	第 33 期	第 34 期	第 35 期
1 万口当たり分配金	0円	100円	100円	100円	100円	0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

## 年2回決算コース

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項 目	第 6 期
	2024年2月14日～2024年8月13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	92

## 毎月決算コース

(単位：円・%、1万口当たり・税引前)

項 目	第 30 期	第 31 期	第 32 期	第 33 期	第 34 期	第 35 期
	2024年2月14日 ～2024年3月11日	2024年3月12日 ～2024年4月10日	2024年4月11日 ～2024年5月10日	2024年5月11日 ～2024年6月10日	2024年6月11日 ～2024年7月10日	2024年7月11日 ～2024年8月13日
当期分配金	—	100	100	100	100	—
（対基準価額比率）	—	0.963	0.930	0.939	0.943	—
当期の収益	—	—	0	—	42	—
当期の収益以外	—	100	99	100	57	—
翌期繰越分配対象額	474	517	889	789	731	731

(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・エンバイロメンタル・インパクト・エクイティ・ポートフォリオ I O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・エンバイロメンタル・インパクト・エクイティ・ポートフォリオ（ルクセンブルク籍）は、GSグローバル環境リーダーズ 年2回決算コース/毎月決算コース（分配条件提示型）が投資対象とする外国投資信託証券です。2024年8月13日時点で入手可能な直近の状況をご報告申し上げます。なお、これらの内容は、当外国投資信託証券の全てのクラスを含んだ内容です。

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

費用	
当座借越支払利息	110
投資顧問報酬	4,834,286
保管費用	138,903
管理事務代行報酬	214,290
販売報酬およびサービシング報酬	527,929
名義書換事務代行報酬	81,525
年次税	184,325
専門家報酬	42,061
その他運用費用	345,928
	<u>6,369,357</u>
費用合計	<u>6,369,357</u>

■保有有価証券明細（2023年11月30日現在）

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資資本割合(%)
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-99.77%			
ベルギー			
337,508	Umicore SA	9,031,642	1.24
カナダ			
113,752	Waste Connections, Inc.	15,189,305	2.08
中国			
835,890	Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. Class A	19,483,650	2.67
11,074,976	Xinyi Solar Holdings Ltd.	6,345,636	0.87
		<u>25,829,286</u>	<u>3.54</u>
デンマーク			
221,308	Chr Hansen Holding A/S	17,346,694	2.38
309,108	Novozymes A/S Class B	15,841,833	2.17
152,838	Orsted A/S	7,123,933	0.98
		<u>40,312,460</u>	<u>5.53</u>
フランス			
371,648	Dassault Systemes SE	17,378,797	2.38
244,711	Imerys SA	7,111,690	0.98
137,495	Schneider Electric SE	25,369,874	3.48
		<u>49,860,361</u>	<u>6.84</u>
ドイツ			
707,456	Infineon Technologies AG	27,528,822	3.77
アイルランド			
146,915	Aptiv PLC	12,221,859	1.68
22,316	Carbon Revolution PLC	525,378	0.07

株数	銘柄名称	評価額 (米ドル)	投資主資本割合(%)
<b>普通株式</b>			
<b>アイルランド</b>			
199,716	Kingspan Group PLC	15,782,521	2.16
76,129	Trane Technologies PLC	16,989,709	2.33
		<u>45,519,467</u>	<u>6.24</u>
<b>イスラエル</b>			
161,583	SolarEdge Technologies, Inc.	12,668,107	1.74
<b>イタリア</b>			
4,231,906	Enel SpA	29,837,007	4.09
<b>日本</b>			
129,000	Daikin Industries Ltd.	19,244,623	2.64
320,200	Horiba Ltd.	21,550,467	2.95
43,000	Keyence Corp.	18,350,457	2.52
457,700	Kurita Water Industries Ltd.	16,212,042	2.22
213,900	NIDEC Corp.	8,102,325	1.11
		<u>83,459,914</u>	<u>11.44</u>
<b>オランダ</b>			
351,560	Aalberts NV	13,890,983	1.90
<b>ノルウェー</b>			
6,108,810	Aker Carbon Capture ASA	5,738,052	0.79
878,449	Circa Group AS	290,023	0.04
		<u>6,028,075</u>	<u>0.83</u>
<b>スペイン</b>			
2,423,396	Iberdrola SA	29,833,969	4.09
<b>スウェーデン</b>			
2,205,826	Oatly Group AB ADR	2,404,350	0.33
367,678	Re:NewCell AB	296,268	0.04
		<u>2,700,618</u>	<u>0.37</u>
<b>スイス</b>			
438,107	ABB Ltd.	17,415,185	2.39
290,044	DSM-Firmenich AG	27,489,623	3.77
55,499	Sika AG	14,942,160	2.05
		<u>59,846,968</u>	<u>8.21</u>
<b>台湾</b>			
1,513,000	Delta Electronics, Inc.	15,318,376	2.10
<b>英国</b>			
6,458,733	DS Smith PLC	23,658,004	3.24
<b>米国</b>			
54,346	Albemarle Corp.	6,535,650	0.90
435,934	Ball Corp.	23,910,980	3.28
798,582	Bloom Energy Corp. Class A	11,427,709	1.57
321,239	Danimer Scientific, Inc.	356,575	0.05
347,915	Darling Ingredients, Inc.	15,029,928	2.06
351,369	DocuSign, Inc.	15,365,366	2.11
82,998	Ecolab, Inc.	15,739,741	2.16
422,884	Energy Recovery, Inc.	8,030,567	1.10
239,228	Itron, Inc.	15,798,617	2.17
410,708	NextEra Energy, Inc.	23,944,276	3.28
656,633	Nuvve Holding Corp.	107,754	0.01
720,557	Shoals Technologies Group, Inc. Class A	9,669,875	1.33
96,292	Veralto Corp.	7,289,304	1.00
171,958	Waste Management, Inc.	29,196,749	4.00

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			
652,076	Westrock Co.	26,995,946	3.70
140,980	Wolfspeed, Inc.	5,118,984	0.70
218,609	Xylem, Inc.	22,632,590	3.10
		237,150,611	32.52
普通株式合計 (取得原価 米ドル 975,427,119)		727,663,975	99.77
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 975,427,119)		727,663,975	99.77
投資評価額 (取得原価 米ドル 975,427,119)		727,663,975	99.77
その他資産・負債		1,693,462	0.23
投資主資本		729,357,437	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 975,427,119)		727,663,975	99.77
その他資産・負債		1,693,462	0.23
投資主資本		729,357,437	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\$トレジャリー・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\$トレジャリー・リキッド・リザーブズ・ファンド（アイルランド籍）は、GSグローバル環境リーダーズ 年2回決算コース/毎月決算コース（分配条件提示型）が投資対象とする外国投資信託証券です。2024年8月13日時点で入手可能な直近の状況をご報告申し上げます。なお、これらの内容は、当外国投資信託証券の全てのクラスを含んだ内容です。

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

費用	
投資顧問報酬	115,416,817
管理事務代行報酬	1,927,052
保管費用	3,785,883
販売報酬	2,377,711
名義書換事務代行報酬	454,573
専門家報酬	86,526
その他費用	7,018,567
費用合計	131,067,129
投資顧問報酬調整額	(12,398,443)
運用費用合計	118,668,686

■保有有価証券明細（2023年12月31日現在）

額面	銘柄名称	利率	償還年月日/満期日	評価額 (米ドル)	純資産比率(%)
	公認の金融商品取引所に上場もしくは規制ある市場で取引されている譲渡性有価証券				
	国債				
50,513,700	United States Treasury Bill	5.100%	02/01/2024	50,506,544	0.08
14,143,800	United States Treasury Bill	5.150%	04/01/2024	14,137,730	0.02
2,279,735,500	United States Treasury Bill	5.264%	16/01/2024	2,274,735,494	3.42
1,443,627,500	United States Treasury Bill	5.285%	18/01/2024	1,440,024,649	2.17
4,136,338,000	United States Treasury Bill	5.285%	25/01/2024	4,121,764,310	6.20
4,790,937,900	United States Treasury Bill	5.269%	01/02/2024	4,769,201,022	7.17
61,794,600	United States Treasury Bill	5.275%	13/02/2024	61,405,251	0.09
37,476,600	United States Treasury Bill	5.270%	20/02/2024	37,202,292	0.06
130,651,500	United States Treasury Bill	5.319%	27/02/2024	129,551,172	0.19
4,997,758,100	United States Treasury Bill	5.264%	28/03/2024	4,934,184,432	7.42
325,414,900	United States Treasury Bill	5.252%	04/04/2024	320,952,372	0.48
33,415,000	United States Treasury Bill	5.238%	09/04/2024	32,933,677	0.05
107,747,700	United States Treasury Bill	5.332%	11/04/2024	106,135,917	0.16
285,183,900	United States Treasury Bill	5.210%	16/04/2024	280,808,976	0.42
2,039,564,800	United States Treasury Bill	5.218%	23/04/2024	2,006,157,387	3.02
952,011,700	United States Treasury Bill	5.321%	25/04/2024	935,829,408	1.41
2,988,195,800	United States Treasury Bill	5.166%	30/04/2024	2,936,736,746	4.42
263,406,300	United States Treasury Bill	5.337%	02/05/2024	258,641,840	0.39
282,576,400	United States Treasury Bill	5.254%	09/05/2024	277,256,230	0.42
1,300,326,600	United States Treasury Bill	5.130%	20/06/2024	1,268,640,892	1.91
2,294,870,000	United States Treasury Bill	5.080%	27/06/2024	2,237,227,970	3.37
590,282,600	United States Treasury Bill	5.083%	31/10/2024	564,946,828	0.85
1,338,401,400	United States Treasury Bill	4.900%	29/11/2024	1,277,743,639	1.92
984,840,000	United States Treasury Bill	4.595%	26/12/2024	939,586,598	1.41

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					
6,160,532,700	United States Treasury Floating Rate Note	5.291%	31/01/2024	6,160,660,568	9.27
3,194,333,100	United States Treasury Floating Rate Note	5.288%	30/04/2024	3,193,990,568	4.81
2,217,274,600	United States Treasury Floating Rate Note	5.327%	31/07/2024	2,217,810,970	3.34
53,122,200	United States Treasury Note/Bond	4.983%	15/11/2024	51,129,441	0.08
134,733,600	United States Treasury Note/Bond	5.024%	15/11/2024	131,422,224	0.20
42,406,600	United States Treasury Note/Bond	4.847%	30/11/2024	41,335,610	0.06
36,491,400	United States Treasury Note/Bond	4.913%	15/12/2024	35,107,008	0.05
145,513,100	United States Treasury Note/Bond	4.913%	31/12/2024	140,846,816	0.21
12,163,800	United States Treasury Note/Bond	4.929%	31/12/2024	11,833,465	0.02
579,570,300	United States Treasury Note/Bond	4.983%	31/12/2024	575,262,650	0.87
国債合計				43,835,710,696	65.96
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				43,835,710,696	65.96
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 現先取引					
18,772,289	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.369%	02/01/2024	18,772,289	0.03
542,054,295	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	542,054,294	0.82
152,410,353	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	152,410,353	0.23
299,234,785	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	299,234,785	0.45
55,591,832	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	55,591,832	0.08
172,063,181	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	172,063,181	0.26
21,989,837	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	21,989,837	0.03
8,193,399	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.371%	02/01/2024	8,193,399	0.01
300,456,153	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	300,456,153	0.45
72,106,804	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	72,106,804	0.11
45,786,436	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	45,786,436	0.07
1,693,068	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.365%	02/01/2024	1,693,068	0.00
169,151,828	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	169,151,828	0.25
36,342,178	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	36,342,178	0.06
314,186,374	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	314,186,374	0.47
441,576,106	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	441,576,106	0.66
29,389,025	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	29,389,025	0.04
389,798,799	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	389,798,799	0.59
25,062,149	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	25,062,149	0.04
55,646,097	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	55,646,097	0.08
292,122,976	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	292,122,976	0.44
56,372,019	Australia & New Zealand Banking Group Ltd Repo	5.370%	02/01/2024	56,372,019	0.09
100,000,000	Banco Santander SA Repo	5.300%	02/01/2024	100,000,000	0.15
500,000,000	BNP Paribas Repo	5.360%	02/01/2024	500,000,000	0.75
1,500,000,000	BNP Paribas Repo	5.360%	02/01/2024	1,500,000,000	2.26
100,000,000	BofA Securities Repo	5.310%	02/01/2024	100,000,000	0.15
2,850,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.330%	02/01/2024	2,850,000,000	4.29
1,000,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.330%	02/01/2024	1,000,000,000	1.50
500,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.330%	02/01/2024	500,000,000	0.75
1,000,000,000	Citigroup Global Markets Inc Repo	5.330%	02/01/2024	1,000,000,000	1.51
194,540,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	194,540,000	0.29
405,210,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	405,210,000	0.61
196,790,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	196,790,000	0.30
255,320,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	255,320,000	0.38
243,750,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	243,750,000	0.37
63,370,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	63,370,000	0.10
143,230,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	143,230,000	0.22

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(%)
	<b>現先取引</b>				
197,790,000	Commonwealth Bank of Australia Repo	5.420%	02/01/2024	197,790,000	0.30
2,000,000,000	Credit Agricole CIB Repo	5.400%	03/01/2024	2,000,000,000	3.01
300,000,000	Daiwa Capital Markets America Inc Repo	5.340%	02/01/2024	300,000,000	0.45
90,441,176	Daiwa Capital Markets Inc Repo	5.360%	02/01/2024	90,441,176	0.14
500,000,000	MUFG Securities (Canada) Ltd Repo	5.350%	02/01/2024	500,000,000	0.75
219,512,979	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	219,512,979	0.33
163,034,952	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	163,034,952	0.25
198,006,530	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	198,006,530	0.30
325,344,497	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	325,344,496	0.49
620,723,348	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	620,723,348	0.93
411,503,145	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	411,503,145	0.62
374,148,054	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	374,148,054	0.56
766,839,045	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	766,839,045	1.15
713,046,607	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	713,046,607	1.07
125,440,218	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	125,440,217	0.19
341,259,513	Norges Bank Repo	5.350%	02/01/2024	341,259,513	0.51
5,200,000,000	State Street Bank And Trust Co Repo	5.320%	02/01/2024	5,200,000,000	7.82
<b>現先取引合計</b>				<b>25,099,300,044</b>	<b>37.76</b>
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				25,099,300,044	37.76
<b>投資資産合計</b>				<b>68,935,010,740</b>	<b>103.72</b>
<b>投資合計</b>				<b>評価額</b>	
				<b>(米ドル)</b>	<b>純資産比率(%)</b>
国債合計				43,835,710,696	65.96
現先取引合計				25,099,300,044	37.76
その他資産・負債				(2,469,396,855)	(3.72)
<b>買戻可能参加受益証券保有者に帰属する純資産</b>				<b>66,465,613,885</b>	<b>100.00</b>