

ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）

◆ファンドの特色

元本確保型の商品ではありません

- ・ 主な投資対象 ……主として日本を含む世界各国の投資適格債券に投資します。
- ・ ベンチマーク ……JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル) (円ヘッジ・ベース)
- ・ 目標とする運用成果 …… 信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
- ・ 為替リスク …… 外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行います。

◆基準価額、純資産総額

基準価額	11,716円
純資産総額	30億円

◆資産構成*

債券	95.7%
債券先物	32.7%
債券実質	128.4%
現金等	4.3%

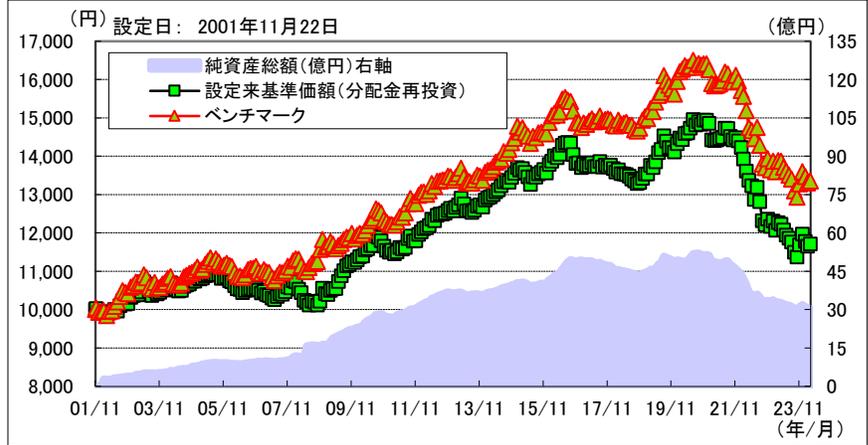
◆為替ヘッジ*

為替ヘッジ比率	99.9%
---------	-------

◆ポートフォリオプロフィール*

	ファンド	ベンチマーク
残存年数	8.18年	8.66年
デュレーション	6.25年	6.95年
複利回り	-0.60%	3.26%

◆基準価額の推移グラフ



◆ファンド(分配金再投資)の収益率とリスク(標準偏差)

	3ヶ月間	6ヶ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	-2.11%	1.89%	-4.48%	-6.67%	-3.16%	-0.99%	0.71%
ベンチマーク収益率	-1.77%	1.97%	-3.84%	-5.51%	-2.60%	-0.21%	1.30%
差異	-0.35%	-0.08%	-0.64%	-1.16%	-0.56%	-0.78%	-0.59%
ファンドリスク(分配金再投資)			5.09%	5.34%	5.01%	4.09%	3.53%
ベンチマークリスク			4.92%	5.39%	4.96%	4.17%	3.63%

※ファンド(分配金再投資)の収益率とは、本ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で本ファンドを購入(再投資)した場合の収益率です。
 ※収益率・リスクともに月次収益率より算出。なお、設定日が月中の場合、設定日が属する月の月次収益率は含んでいません。
 ※収益率は期間が1年以上の場合は年率、期間が1年未満のものについては年率換算していません。
 ※本ファンドの騰落率をベンチマークと比較して評価することは、特に1年未満程度の短期間については資産の評価時点や評価為替レート等の差異の影響が相対的に大きく、必ずしも適切でない場合があります。
 ※また、ベンチマークに直接投資することはできず、費用や流動性等の市場要因なども考慮されておりません。

◆公社債通貨別構成比*

通貨	構成比
米ドル	70.3%
スウェーデン・クローナ	20.3%
ノルウェー・クローネ	15.9%
イギリスポンド	10.6%
オーストラリアドル	6.1%

(注)債券現物と債券先物の合計値です。

◆公社債残存別構成比*

残存年数	構成比
1年未満	11.1%
1～3年	47.4%
3～7年	6.9%
7～10年	4.9%
10年以上	25.3%

(注)債券現物のみの数値です。

◆過去1カ月間のパフォーマンス分析

当月のポートフォリオのパフォーマンスは、ベンチマークを上回る結果となりました。
 戦略別では、デュレーション戦略、個別銘柄選択がマイナス寄与となった一方で、国別配分戦略、通貨配分戦略、セクター配分戦略がプラス寄与となりました。

◆公社債上位銘柄*

(組み入れ銘柄数 146 銘柄)

銘柄名	構成比	通貨	残存年数
ノルウェー国債 1.5% 2026年2月19日	15.9%	NOK	1.9年
スウェーデン国債 2.5% 2025年5月12日	11.4%	SEK	1.1年
スウェーデン国債 1% 2026年11月12日	8.6%	SEK	2.6年
アメリカ国債 0% 2024年6月27日	5.5%	USD	0.2年
第182回利付国債(20年) 1.1% 2042年9月20日	3.9%	JPY	18.5年
カナダ国債 2.25% 2029年6月1日	3.3%	CAD	5.2年
フランス国債 0% 2027年2月25日	2.0%	EUR	2.9年
国際開発協会 0.75% 2024年12月12日	1.8%	GBP	0.7年
イギリス国債 4.25% 2046年12月7日	1.7%	GBP	22.7年
デクシア 0.25% 2026年12月10日	1.6%	GBP	2.7年

(注)債券現物のみの数値です。

* マザーファンドのデータを使用しています。

■ 「ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法第25号）第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■ 当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■ 投資信託は、債券など値動きのある証券等（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■ 当資料は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証するものではありません。■ J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル）は、J Pモルガンが発表している、世界主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）

＜リターン実績表＞

単位%

設定日2001年11月22日

リターン	リターン	リターン	リターン
2024年3月 0.55	2021年3月 -0.06	2018年3月 0.43	2015年3月 0.31
2024年2月 -1.10	2021年2月 -2.92	2018年2月 -0.67	2015年2月 -0.49
2024年1月 -1.56	2021年1月 -0.58	2018年1月 -0.69	2015年1月 1.10
2023年12月 2.40	2020年12月 0.00	2017年12月 0.41	2014年12月 0.80
2023年11月 2.79	2020年11月 0.76	2017年11月 -0.38	2014年11月 0.98
2023年10月 -1.10	2020年10月 -0.45	2017年10月 0.36	2014年10月 -0.42
2023年9月 -2.21	2020年9月 0.57	2017年9月 -1.03	2014年9月 0.32
2023年8月 -0.87	2020年8月 -0.98	2017年8月 0.92	2014年8月 0.79
2023年7月 -0.70	2020年7月 1.51	2017年7月 0.04	2014年7月 0.81
2023年6月 -1.08	2020年6月 0.85	2017年6月 -0.70	2014年6月 0.36
2023年5月 -1.20	2020年5月 0.14	2017年5月 0.55	2014年5月 0.58
2023年4月 -0.34	2020年4月 1.11	2017年4月 0.09	2014年4月 0.42
2023年3月 1.61	2020年3月 -0.28	2017年3月 -0.38	
2023年2月 -1.94	2020年2月 0.99	2017年2月 0.66	
2023年1月 1.20	2020年1月 1.54	2017年1月 -0.93	
2022年12月 -1.55	2019年12月 -0.75	2016年12月 0.12	
2022年11月 1.18	2019年11月 -0.04	2016年11月 -1.66	
2022年10月 -0.83	2019年10月 -1.19	2016年10月 -2.06	
2022年9月 -3.90	2019年9月 -0.93	2016年9月 -0.15	
2022年8月 -2.81	2019年8月 2.53	2016年8月 0.15	
2022年7月 2.39	2019年7月 0.55	2016年7月 0.42	
2022年6月 -2.69	2019年6月 1.72	2016年6月 1.62	
2022年5月 -1.03	2019年5月 1.15	2016年5月 0.65	
2022年4月 -1.78	2019年4月 -0.42	2016年4月 -0.36	
2022年3月 -2.27	2019年3月 1.63	2016年3月 1.02	
2022年2月 -2.07	2019年2月 -0.02	2016年2月 0.64	
2022年1月 -1.24	2019年1月 0.86	2016年1月 1.62	
2021年12月 -0.56	2018年12月 0.84	2015年12月 -0.67	
2021年11月 0.42	2018年11月 0.17	2015年11月 0.59	
2021年10月 -0.62	2018年10月 -0.47	2015年10月 0.30	
2021年9月 -1.45	2018年9月 -0.39	2015年9月 0.58	
2021年8月 -0.02	2018年8月 -0.57	2015年8月 -0.04	
2021年7月 1.65	2018年7月 -0.32	2015年7月 1.52	
2021年6月 0.23	2018年6月 -0.08	2015年6月 -1.49	
2021年5月 0.20	2018年5月 -0.07	2015年5月 -0.84	
2021年4月 0.11	2018年4月 -0.75	2015年4月 -0.77	

※月末の基準価額にて算出

※リターンは月次の騰落率を掲載

※基準価額は、分配金を再投資して算出

■「ゴールドマン・サックス・世界債券オープン A 限定為替ヘッジ（確定拠出年金向け）」の受益権の募集については、委託会社は、金融商品取引法（昭和23年法第25号）第5条の規定により有価証券届出書を関東財務局長に提出し、その届出の効力は発生しております。■当資料は、確定拠出年金法第24条および関連政省令に規定されている「運用の方法に係る情報の提供」に基づき当商品の内容をご説明するために作成されたものであり、当該投資信託の勧誘を目的とするものではありません。■投資信託は、債券など値動きのある証券等（外貨建資産に投資する場合には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、元金および運用成果が保証されているものではありません。投資信託の運用による損益は、投資信託をご購入のお客様に帰属します。■当資料は、ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社が信頼できると判断した諸データに基づいて作成しましたが、その正確性、完全性を保証するものではありません。また、上記の実績・データ等は過去のものであり、今後の成果を保証するものではありません。■J Pモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル）は、J Pモルガンが発表している、世界主要国の国債市場の合成パフォーマンスを表す指数です。