

ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（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、為替ヘッジを行いません。

◆基準価額、純資産総額

基準価額	20,463円
純資産総額	47億円

◆資産構成*

債券	96.7%
債券先物	29.4%
債券実質	126.1%
現金等	3.3%

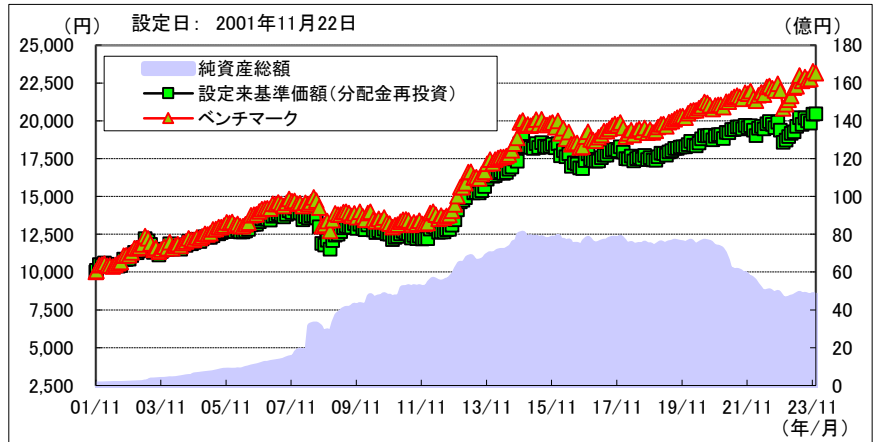
◆為替ヘッジ*

為替ヘッジ比率	0.0%
---------	------

◆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	7.69年	8.74年
デュレーション	5.82年	7.07年
複利回り	2.92%	3.02%

◆基準価額の推移グラフ



※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)(円ベース)
 (設定日を10,000として指数化)

◆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)	2.36%	1.32%	10.20%	2.35%	3.28%	2.19%	3.29%
ベンチマーク収益率	1.84%	0.65%	11.14%	3.21%	3.76%	2.87%	3.87%
差異	0.51%	0.66%	-0.94%	-0.86%	-0.48%	-0.68%	-0.58%
ファンドリスク(分配金再投資)			5.18%	5.52%	4.62%	5.42%	6.31%
ベンチマークリスク			4.62%	5.48%	4.51%	5.35%	6.10%

※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おりません。

※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が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す。

◆公社債通貨別構成比*

通貨	構成比
米ドル	75.7%
日本円	10.9%
スウェーデン・クローナ	9.8%
ノルウェー・クローネ	8.9%
イギリスポンド	8.6%

(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	14.2%
1~3年	36.7%
3~7年	17.8%
7~10年	4.5%
10年以上	23.5%

(注)債券現物のみの数値です。

◆公社債上位銘柄*

(組み入れ銘柄数 153銘柄)

銘柄名	構成比	通貨	残存年数
スウェーデン国債 2.5% 2025年5月12日	9.5%	SEK	1.4年
ノルウェー国債 1.5% 2026年2月19日	8.9%	NOK	2.1年
第1187回国庫短期証券 0% 2024年1月15日	7.0%	JPY	0.0年
第444回利付国債(2年) 0.005% 2025年1月1日	3.6%	JPY	1.0年
第182回利付国債(20年) 1.1% 2042年9月20日	3.4%	JPY	18.7年
アメリカ国債 0.625% 2026年7月31日	3.1%	USD	2.6年
アメリカ国債 1.875% 2041年2月15日	3.1%	USD	17.1年
第1194回国庫短期証券 0% 2024年2月19日	2.9%	JPY	0.1年
アメリカ国債 2.375% 2029年3月31日	2.8%	USD	5.3年
アメリカ国債 0.875% 2026年6月30日	2.4%	USD	2.5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。

◆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、個別銘柄選択がプラス寄与となりました。

■「ゴールドマン・サックス・世界債券オープン B 為替ヘッジなし（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。■JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス（グローバル）は、JP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 B 為替ヘッジなし（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	
2023年12月	0.11	2020年12月	0.58	2017年12月	1.46	2014年12月	1.51
2023年11月	2.94	2020年11月	1.21	2017年11月	-0.51	2014年11月	6.67
2023年10月	-0.68	2020年10月	-1.48	2017年10月	0.23	2014年10月	-0.76
2023年9月	-0.97	2020年9月	0.17	2017年9月	0.72	2014年9月	3.09
2023年8月	2.19	2020年8月	-0.12	2017年8月	1.24	2014年8月	0.82
2023年7月	-2.18	2020年7月	1.15	2017年7月	-0.07	2014年7月	1.31
2023年6月	2.83	2020年6月	1.44	2017年6月	1.00	2014年6月	0.37
2023年5月	1.88	2020年5月	1.10	2017年5月	1.20	2014年5月	-0.57
2023年4月	0.60	2020年4月	-0.29	2017年4月	0.14	2014年4月	0.41
2023年3月	1.12	2020年3月	-1.29	2017年3月	-0.21	2014年3月	1.11
2023年2月	1.23	2020年2月	1.09	2017年2月	-0.58	2014年2月	0.19
2023年1月	0.81	2020年1月	0.85	2017年1月	-1.98	2014年1月	-0.86
2022年12月	-4.19	2019年12月	-0.05	2016年12月	2.54		
2022年11月	-2.70	2019年11月	0.14	2016年11月	3.18		
2022年10月	1.84	2019年10月	0.47	2016年10月	-0.22		
2022年9月	-1.01	2019年9月	0.02	2016年9月	-1.52		
2022年8月	-0.98	2019年8月	0.77	2016年8月	-0.55		
2022年7月	0.79	2019年7月	0.45	2016年7月	1.42		
2022年6月	1.64	2019年6月	1.31	2016年6月	-4.67		
2022年5月	-0.81	2019年5月	-0.62	2016年5月	1.08		
2022年4月	0.67	2019年4月	-0.11	2016年4月	-2.23		
2022年3月	2.54	2019年3月	1.29	2016年3月	1.96		
2022年2月	-1.85	2019年2月	1.28	2016年2月	-4.31		
2022年1月	-1.52	2019年1月	-0.05	2016年1月	1.48		
2021年12月	0.65	2018年12月	-0.84	2015年12月	-1.25		
2021年11月	-0.72	2018年11月	0.64	2015年11月	0.64		
2021年10月	1.19	2018年10月	-1.55	2015年10月	0.42		
2021年9月	-0.67	2018年9月	1.41	2015年9月	-0.33		
2021年8月	0.00	2018年8月	-0.62	2015年8月	-1.31		
2021年7月	0.84	2018年7月	0.51	2015年7月	1.75		
2021年6月	0.00	2018年6月	0.87	2015年6月	-1.37		
2021年5月	1.13	2018年5月	-1.85	2015年5月	1.72		
2021年4月	-0.11	2018年4月	1.08	2015年4月	-0.32		
2021年3月	2.13	2018年3月	-0.12	2015年3月	-0.36		
2021年2月	-1.29	2018年2月	-2.40	2015年2月	0.14		
2021年1月	-0.05	2018年1月	-1.95	2015年1月	-2.63		

※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 B 為替ヘッジなし（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。