

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	19,505円
純資産総額	51億円

◆資産構成*

債券	96.1%
債券先物	0.0%
債券実質	96.1%
現金等	3.9%

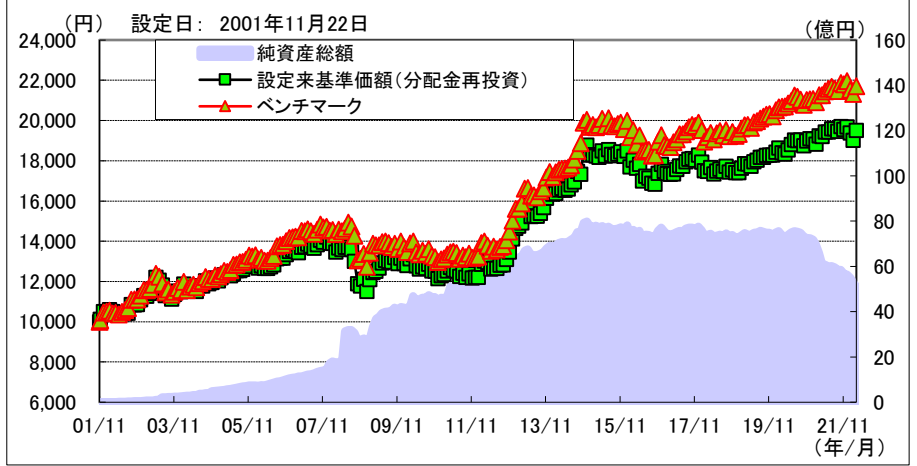
◆為替ヘッジ*

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	10.95年	9.38年
デュレーション	7.99年	7.87年
複利利回り	1.70%	1.63%

◆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)	-0.88%	0.23%	1.42%	2.99%	2.40%	4.12%	3.33%
ベンチマーク収益率	-1.17%	1.11%	2.07%	3.16%	3.04%	4.49%	3.88%
差異	0.29%	-0.88%	-0.65%	-0.17%	-0.65%	-0.37%	-0.54%
ファンドリスク(分配金再投資)			4.10%	3.48%	3.67%	5.73%	6.31%
ベンチマークリスク			3.67%	2.98%	3.53%	5.49%	6.06%

※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
ユーロ	38.3%
日本円	37.9%
米ドル	30.3%
カナダ・ドル	8.6%
イギリスポンド	7.0%

(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	21.9%
1~3年	9.4%
3~7年	21.8%
7~10年	8.1%
10年以上	34.9%

(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 220 銘柄)

銘柄名	構成比	通貨	残存年数
第1028回国庫短期証券 0% 2022年4月11日	12.3%	JPY	0.0年
アメリカ国債 2.25% 2041年5月15日	5.4%	USD	19.1年
第434回利付国債(2年) 0.005% 2024年3月1日	4.6%	JPY	1.9年
アメリカ国債 1.625% 2026年5月15日	4.2%	USD	4.1年
第1063回国庫短期証券 0% 2022年6月13日	4.0%	JPY	0.2年
第1058回国庫短期証券 0% 2022年5月23日	3.0%	JPY	0.1年
第328回利付国債(10年) 0.6% 2023年3月20日	2.6%	JPY	1.0年
第150回利付国債(5年) 0.005% 2026年12月20日	2.6%	JPY	4.7年
アメリカ国債 0.375% 2023年10月31日	2.1%	USD	1.6年
フランス国債 2.75% 2027年10月25日	1.9%	EUR	5.6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ヵ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、国別配分戦略、通貨配分戦略がマイナス寄与となった一方で、デュレーション戦略、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	
2022年3月	2.54	2019年3月	1.29	2016年3月	1.96	2013年3月	1.15
2022年2月	-1.85	2019年2月	1.28	2016年2月	-4.31	2013年2月	0.68
2022年1月	-1.52	2019年1月	-0.05	2016年1月	1.48	2013年1月	3.81
2021年12月	0.65	2018年12月	-0.84	2015年12月	-1.25	2012年12月	4.86
2021年11月	-0.72	2018年11月	0.64	2015年11月	0.64	2012年11月	2.78
2021年10月	1.19	2018年10月	-1.55	2015年10月	0.42	2012年10月	2.05
2021年9月	-0.67	2018年9月	1.41	2015年9月	-0.33	2012年9月	0.17
2021年8月	0.00	2018年8月	-0.62	2015年8月	-1.31	2012年8月	1.20
2021年7月	0.84	2018年7月	0.51	2015年7月	1.75	2012年7月	0.02
2021年6月	0.00	2018年6月	0.87	2015年6月	-1.37	2012年6月	0.24
2021年5月	1.13	2018年5月	-1.85	2015年5月	1.72	2012年5月	-2.53
2021年4月	-0.11	2018年4月	1.08	2015年4月	-0.32	2012年4月	-0.55
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		
2020年12月	0.58	2017年12月	1.46	2014年12月	1.51		
2020年11月	1.21	2017年11月	-0.51	2014年11月	6.67		
2020年10月	-1.48	2017年10月	0.23	2014年10月	-0.76		
2020年9月	0.17	2017年9月	0.72	2014年9月	3.09		
2020年8月	-0.12	2017年8月	1.24	2014年8月	0.82		
2020年7月	1.15	2017年7月	-0.07	2014年7月	1.31		
2020年6月	1.44	2017年6月	1.00	2014年6月	0.37		
2020年5月	1.10	2017年5月	1.20	2014年5月	-0.57		
2020年4月	-0.29	2017年4月	0.14	2014年4月	0.41		
2020年3月	-1.29	2017年3月	-0.21	2014年3月	1.11		
2020年2月	1.09	2017年2月	-0.58	2014年2月	0.19		
2020年1月	0.85	2017年1月	-1.98	2014年1月	-0.86		
2019年12月	-0.05	2016年12月	2.54	2013年12月	2.15		
2019年11月	0.14	2016年11月	3.18	2013年11月	2.99		
2019年10月	0.47	2016年10月	-0.22	2013年10月	1.85		
2019年9月	0.02	2016年9月	-1.52	2013年9月	0.93		
2019年8月	0.77	2016年8月	-0.55	2013年8月	-0.11		
2019年7月	0.45	2016年7月	1.42	2013年7月	0.18		
2019年6月	1.31	2016年6月	-4.67	2013年6月	-3.51		
2019年5月	-0.62	2016年5月	1.08	2013年5月	1.00		
2019年4月	-0.11	2016年4月	-2.23	2013年4月	4.77		

※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 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。