

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	11,503円
純資産総額	30億円

◆資産構成*

債券	100.3%
債券先物	52.7%
債券実質	153.0%
現金等	-0.3%

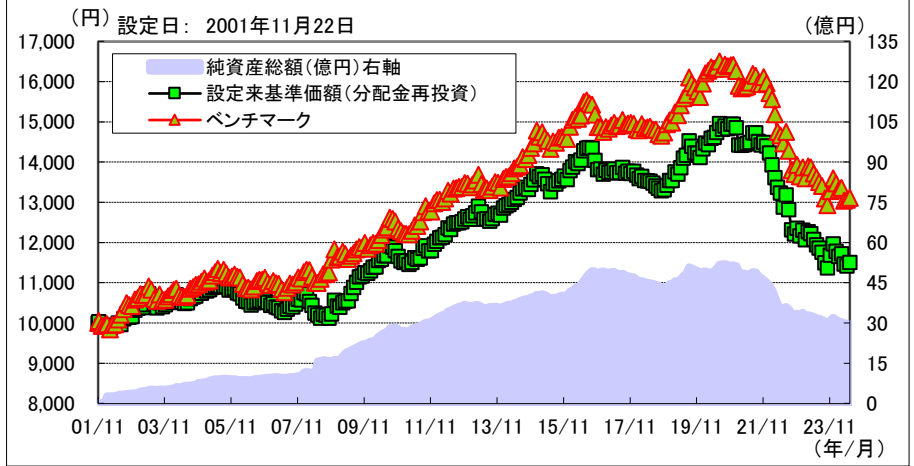
◆為替ヘッジ*

為替ヘッジ比率	100.1%
---------	--------

◆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	6.72年	8.51年
デュレーション	5.45年	6.74年
複利回り	-0.76%	3.55%

◆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)(円ヘッジ・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)	-1.82%	-3.89%	-3.71%	-7.40%	-3.98%	-1.31%	0.62%
ベンチマーク収益率	-1.86%	-3.59%	-3.68%	-6.37%	-3.40%	-0.57%	1.20%
差異	0.04%	-0.30%	-0.03%	-1.04%	-0.58%	-0.74%	-0.58%
ファンドリスク(分配金再投資)			5.41%	5.42%	4.98%	4.14%	3.55%
ベンチマークリスク			5.31%	5.47%	4.95%	4.23%	3.64%

※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られません。

◆公社債通貨別構成比*

通貨	構成比
米ドル	79.1%
ユーロ	41.1%
ノルウェー・クローネ	18.7%
イギリスポンド	10.6%
カナダ・ドル	5.4%

(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	31.8%
1~3年	30.8%
3~7年	9.0%
7~10年	5.3%
10年以上	23.4%

(注)債券現物のみの数値です。

◆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、セクター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、個別銘柄選択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 134 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	18.7%	NOK	1.6年
アメリカ国債 0% 2024年7月5日	12.0%	USD	0.0年
フランス国債 0% 2024年9月25日	6.0%	EUR	0.2年
アメリカ国債 0% 2024年9月12日	5.2%	USD	0.2年
第182回利付国債(20年) 1.1% 2042年9月20日	4.0%	JPY	18.2年
カナダ国債 2.25% 2029年6月1日	3.8%	CAD	4.9年
フランス国債 0% 2027年2月25日	2.2%	EUR	2.7年
国際開発協会 0.75% 2024年12月12日	2.1%	GBP	0.5年
デクシア 0.25% 2026年12月10日	1.9%	GBP	2.5年
イギリス国債 4.25% 2046年12月7日	1.9%	GBP	22.5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。

■「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。■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 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6月	0.78	2021年6月	0.23	2018年6月	-0.08	2015年6月	-1.49
2024年5月	-0.41	2021年5月	0.20	2018年5月	-0.07	2015年5月	-0.84
2024年4月	-2.18	2021年4月	0.11	2018年4月	-0.75	2015年4月	-0.77
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		
2023年5月	-1.20	2020年5月	0.14	2017年5月	0.55		
2023年4月	-0.34	2020年4月	1.11	2017年4月	0.09		
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		

※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。