

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	22,134円
純資産総額	49億円

◆資産構成*

債券	96.4%
債券先物	63.2%
債券実質	159.6%
現金等	3.6%

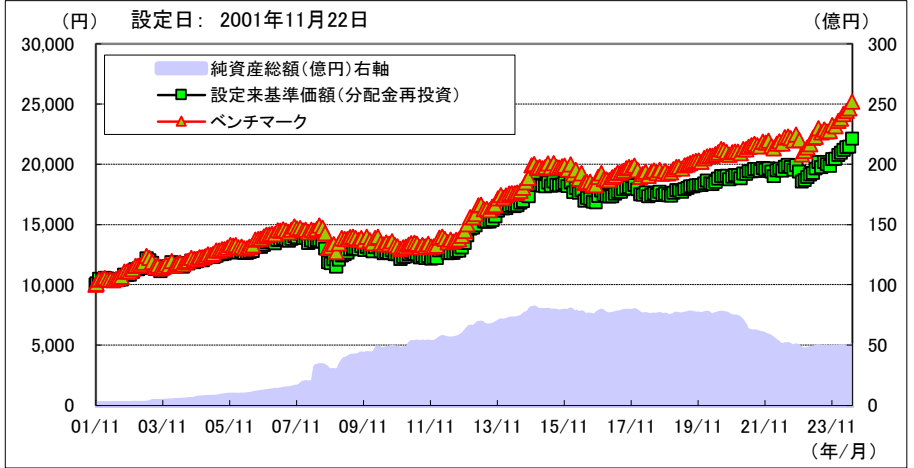
◆為替ヘッジ*

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	5.48年	8.51年
デュレーション	5.76年	6.74年
複利利回り	3.33%	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)	4.39%	8.17%	9.59%	4.44%	4.27%	2.92%	3.58%
ベンチマーク収益率	4.23%	8.88%	9.60%	5.30%	4.82%	3.62%	4.17%
差異	0.17%	-0.72%	-0.01%	-0.86%	-0.55%	-0.69%	-0.60%
ファンドリスク(分配金再投資)			5.25%	5.64%	4.77%	5.51%	6.28%
ベンチマークリスク			4.02%	5.64%	4.63%	5.41%	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いません。

◆公社債通貨別構成比*

通貨	構成比
米ドル	74.8%
ユーロ	40.9%
ノルウェー・クローネ	17.1%
イギリスポンド	9.4%
日本円	8.5%

(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	39.9%
1~3年	26.0%
3~7年	8.7%
7~10年	4.4%
10年以上	17.4%

(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 142 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	17.1%	NOK	1.6年
アメリカ国債 0% 2024年7月5日	7.8%	USD	0.0年
第1228回国庫短期証券 0% 2024年8月5日	7.0%	JPY	0.1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	5.1%	USD	0.2年
第444回利付国債(2年) 0.005% 2025年1月1日	3.4%	JPY	0.5年
第182回利付国債(20年) 1.1% 2042年9月20日	3.0%	JPY	18.2年
スウェーデン国債 2.5% 2025年5月12日	2.4%	SEK	0.9年
第443回利付国債(2年) 0.005% 2024年12月1日	2.1%	JPY	0.4年
米州開発銀行 7% 2025年6月15日	2.1%	USD	1.0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、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、通貨配分戦略、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
2024年6月 3.11	2021年6月 0.00	2018年6月 0.87	2015年6月 -1.37
2024年5月 0.24	2021年5月 1.13	2018年5月 -1.85	2015年5月 1.72
2024年4月 1.00	2021年4月 -0.11	2018年4月 1.08	2015年4月 -0.32
2024年3月 1.21	2021年3月 2.13	2018年3月 -0.12	2015年3月 -0.36
2024年2月 0.89	2021年2月 -1.29	2018年2月 -2.40	2015年2月 0.14
2024年1月 1.48	2021年1月 -0.05	2018年1月 -1.95	2015年1月 -2.63
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	
2023年5月 1.88	2020年5月 1.10	2017年5月 1.20	
2023年4月 0.60	2020年4月 -0.29	2017年4月 0.14	
2023年3月 1.12	2020年3月 -1.29	2017年3月 -0.21	
2023年2月 1.23	2020年2月 1.09	2017年2月 -0.58	
2023年1月 0.81	2020年1月 0.85	2017年1月 -1.98	
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	

※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。