

DC ガリレオ

◆ファンドの特色

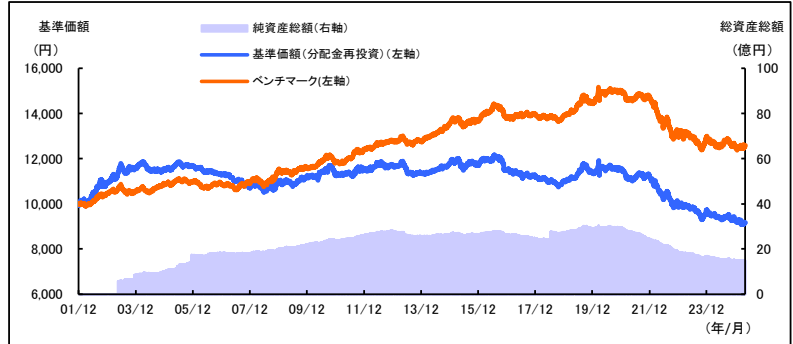
元本確保型の商品ではありません

- ・ 主な投資対象 …… 本ファンドはマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。マザーファンドは日本を含む世界各国の債券を主要投資対象とします(債券先物取引、円短期金融商品等を含みます。また、円短期運用を目的として、非円建ての短期金融商品に投資し円ヘッジすることがあります。)
- ・ 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)(100%為替円ヘッジ、円ベース)と1ヵ月円LIBORを80対20で合成した複合ベンチマーク(2022年1月以降は日本円1ヵ月TIBORを用いています。)

◆基準価額、純資産総額

基準価額	9,168円
純資産総額	15億円

◆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)(100%為替円ヘッジ、円ベース)と1ヵ月円LIBORを80対20で合成した複合ベンチマーク(2022年1月以降は日本円1ヵ月TIBOR)(設定日を10,000として指数化)

◆資産構成

	基本アセットミックス	ファンド
世界債券	80.0%	85.5%
円短期金融商品	20.0%	14.5%
合計	100.0%	100.0%

※ファンドの構成比率は、資産配分変更時のモデル・ポートフォリオの配分を示しています。以降資産配分の変更は行っておりません。実際の金額配分は上記とは異なる場合があります。

◆為替ヘッジ

為替ヘッジ比率	原則として100%為替円ヘッジ
---------	-----------------

◆ファンド(分配金再投資)とベンチマークの収益率とリスク(標準偏差)

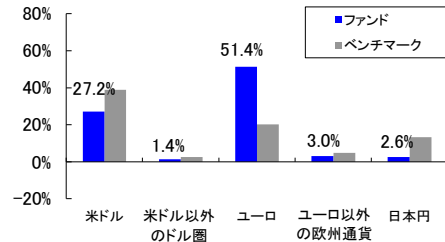
	3ヵ月間	6ヵ月間	1年間	3年間	5年間	10年間	設定来
ファンド収益率(分配金再投資)	-0.83%	-0.99%	-2.53%	-4.70%	-4.67%	-2.49%	-0.37%
ベンチマーク収益率	0.72%	-0.14%	0.63%	-2.99%	-3.42%	-0.84%	0.99%
差異	-1.55%	-0.85%	-3.16%	-1.71%	-1.25%	-1.66%	-1.36%
ファンドリスク(分配金再投資)	----	----	3.89%	4.46%	4.08%	3.71%	3.50%
ベンチマークリスク	----	----	2.82%	4.29%	3.82%	3.38%	2.92%

- * ファンド(分配金再投資)の収益率は、当ファンドの決算時に収益の分配金があった場合に、その分配金で当ファンドを購入(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。

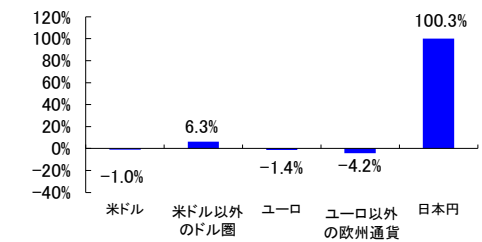
◆ポジション

* ポジションは、資産配分変更時のモデル・ポートフォリオの配分を示しています。実際の金額配分は、右記とは異なる場合があります。本資料中の資産構成、投資対象の評価等は、過去の一時点におけるものであり、以後変更される場合があります。

<債券通貨別比率>



<通貨比率>



◆市場動向

当月の債券市場は、概ね上昇(利回りは低下)する結果となりました。市場全体の動きを示す代表的な指数であるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス(グローバル)(100%為替円ヘッジ、円ベース)のリターンは、前月末比で0.7%の上昇となりました。主要債券市場の価格動向は、ドイツが前月末比1.8%程度の上昇、フランスが同1.8%程度の上昇となりました。

当月の為替市場は、主要通貨が円に対してまちまちな展開となりました。対円で上昇したのは、スイス・フランなどで前月末比2.7%程度の上昇となりました。一方、対円で下落したのは、米ドルなどで前月末比4.6%程度の上昇となりました。スイス・フランは、前月末の1スイス・フラン=169円付近から上昇した後、中旬以降はレンジ内で推移した結果173円半ばで月を終えました。米ドルは、前月末の1米ドル=149円半ばから下落した後、下旬から月末までレンジ内で推移した結果142円半ばで月を終えました。

(為替はすべてWMロイターレートを使用しています。)

■ 「DC ガリレオ」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、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、株式、公社債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。