

モナリザ ゴールドマン・サックス世界債券ファンド

元本確保型の商品ではありません

◆ファンドの特色

- ・ 主な投資対象 日本を含む世界各国の投資適格債券
- ・ ベンチマーク ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス(円ヘッジベース)
- ・ 目標とする運用成果 長期的にベンチマークを上回る運用成果を目指します
- ・ 為替変動リスク 外貨建資産については、対円で為替ヘッジを行うことにより、為替変動リスクの低減を図ります

◆基準価額、純資産総額

基準価額	8,665円
純資産総額	45億円

◆資産構成*

債券	91.1%
債券先物	23.7%
債券実質	114.8%
現金等	8.9%

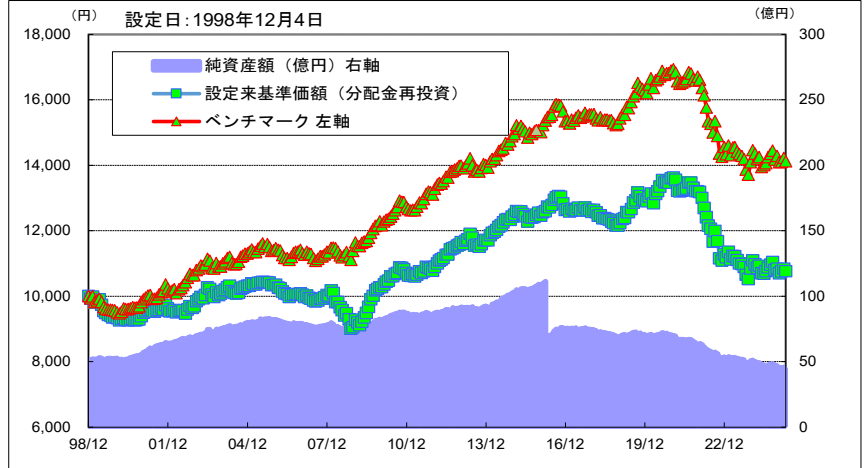
◆為替ヘッジ*

為替ヘッジ比率	99.5%
---------	-------

◆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	11.16年	8.41年
デュレーション	5.86年	6.51年
複利回り	0.64%	3.62%

◆基準価額の推移グラフ



※ベンチマーク：ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックス(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か月間	6か月間	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)	0.64%	-2.52%	-1.50%	-4.62%	-3.46%	-1.55%	0.28%
ベンチマーク収益率	0.15%	-2.25%	-0.95%	-3.59%	-2.91%	-0.74%	1.32%
差異	0.48%	-0.27%	-0.55%	-1.02%	-0.55%	-0.82%	-1.04%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	3.92%	5.73%	5.14%	4.17%	3.55%
ベンチマークリスク	-----	-----	3.88%	5.54%	4.75%	3.93%	3.29%

*ファンド(分配金再投資)の収益率とは、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	59.6%
ユーロ	34.1%
中国・人民元	10.1%
英ポンド	7.7%
カナダ・ドル	3.4%

(注)債券現物と債券先物の合計値です。

◆公社債上位銘柄*

(組み入れ銘柄数 308銘柄)

銘柄名	構成比	通貨	残存年数
中国国債 4.15% 2031年12月12日	2.8%	CNH	6.7年
第191回利付国債(20年) 2.00% 2044年12月20日	2.5%	JPY	19.7年
中国国債 3.85% 2026年12月12日	2.1%	CNH	1.7年
中国国債 3.48% 2027年6月29日	1.6%	CNH	2.2年
ジニーメイ 3.00% 2051年8月20日	1.6%	USD	26.4年
ファミリー 3.50% 2052年9月1日	1.6%	USD	27.4年
中国国債 2.54% 2030年12月25日	1.4%	CNH	5.7年
中国国債 2.71% 2033年6月16日	1.4%	CNH	8.2年
オントリオ州・カナダ 2.60% 2025年6月2日	1.3%	CAD	0.2年
クウェート国債 3.50% 2027年3月20日	1.3%	USD	2.0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か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。セクター配分戦略等がマイナスに寄与したものの、国債/金利スワップ戦略やエマージング市場債券戦略等がプラス寄与となりました。

■「モナリザ ゴールドマン・サックス世界債券ファンド」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。■ブルームバーグ・グローバル・アグリゲート・インデックスはブルームバーグが公表している指数です。