

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	8,712円
純資産総額	45億円

◆資産構成\*

債券	94.3%
債券先物	3.5%
債券実質	97.8%
現金等	5.7%

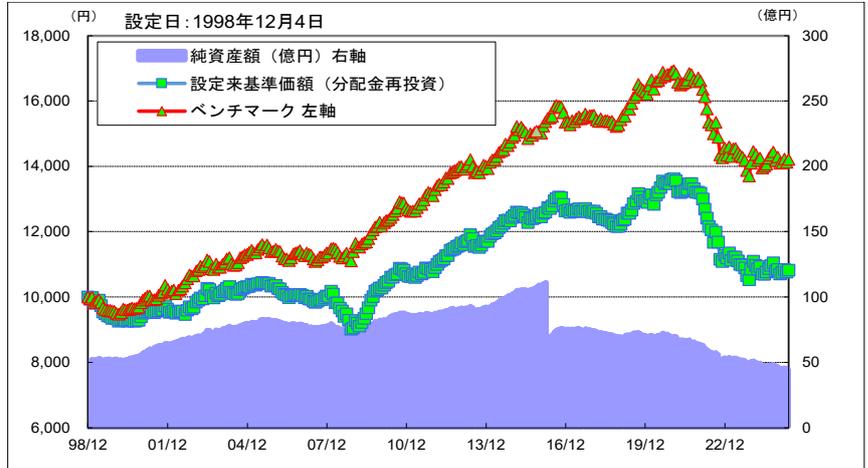
◆為替ヘッジ\*

為替ヘッジ比率	99.2%
---------	-------

◆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	10.61年	8.42年
デュレーション	5.59年	6.55年
複利回り	0.84%	3.46%

◆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)	0.68%	0.24%	1.18%	-3.78%	-3.78%	-1.44%	0.30%
ベンチマーク収益率	0.73%	0.29%	1.87%	-2.53%	-3.06%	-0.61%	1.34%
差異	-0.05%	-0.05%	-0.68%	-1.25%	-0.71%	-0.82%	-1.04%
ファンドリスク(分配金再投資)	-----	-----	3.34%	5.67%	5.02%	4.17%	3.54%
ベンチマークリスク	-----	-----	3.24%	5.39%	4.70%	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	52.5%
ユーロ	22.4%
中国・人民元	9.9%
英ポンド	9.3%
カナダ・ドル	3.6%

(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 313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	2.7%	CNH	6.6年
第191回利付国債(20年) 2.00% 2044年12月20日	2.6%	JPY	19.7年
フランス国債 0.00% 2025年7月9日	2.0%	EUR	0.2年
中国国債 3.85% 2026年12月12日	2.0%	CNH	1.6年
第1296回国庫短期証券 0.00% 2025年6月30日	2.0%	JPY	0.2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	26.3年
ファニーメイ 3.50% 2052年9月1日	1.5%	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	8.1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、ベンチマークを下回る結果となりました。  
 国債/金利スワップ戦略がマイナスに寄与したものの、デュレーション戦略や証券化商品銘柄選択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。