

## ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント、新ファンド 「GS エマージング・資産分散ファンド」8月6日より募集開始

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社(代表取締役社長:土岐大介)は、「GS エマージング・資産分散ファンド」(追加型証券投資信託/ファンド・オブ・ファンズ/信託期間 無期限)を設定いたします。当初募集期間は2007年8月6日から8月23日まで、設定日は2007年8月24日、継続募集期間は2007年8月24日からとなります。

ゴールドマン・サックス・グループの投資調査部が2003年10月に発表しました「BRICsについての大胆な予測:2050年への道程」によって世界中で「BRICs」に対する注目度が高まりました。しかしながら、すでに2001年11月のレポートにおいて「今後の世界経済はBRICs抜きには語れない」と発表しておりました。ゴールドマン・サックス・グループでは、長きに渡り、エマージング諸国についてリサーチを継続し、「エマージング諸国の経済成長からもたらされる収益機会、株式にとどまらず、債券、通貨、コモディティと幅広く存在する」との考えを示してきました。



一般的なBRICs、エマージング市場を投資対象とした投資信託では株式投資が中心となっておりましたが、本ファンドにおいては、エマージング諸国の株式・債券、コモディティを投資対象とすることによって、エマージング諸国の拡大・発展を様々な資産から捉えることを目指します。

### <「GS エマージング・資産分散ファンド」の特色>

1. エマージング株式、エマージング債券(現地通貨建て)\*1、コモディティ\*2に投資することで、元本の成長に加え、配当・利息収益を追求します。(外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。)
  - \*1 エマージング債券市場においては、米ドル等主要通貨建てと現地通貨建ての債券が発行されていますが、本ファンドの実質的な投資対象であるエマージング債券は現地通貨建てです。
  - \*2 コモディティへの投資は、米国の取引所に上場されている米ドル建ての商品指数先物等を通じて行います。
2. 資産配分は、エマージング株式50%、エマージング債券(現地通貨建て)25%、コモディティ25%を基本とします。  
本ファンドは、MSCI エマージング・マーケット・フリー・インデックス(円換算ベース) 50% + JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース) 25% + S&P GSCI トータル・リターン・インデックス(円換算ベース) 25%を運用上の参考指標とします。
3. 3ヵ月毎の決算時(毎年1月、4月、7月、10月の各20日。ただし、休業日の場合は翌営業日。初回決算日:2007年10月22日。)に、各資産からの配当、利息収益を中心に、原則として収益分配を行います。また、基準価額水準や市況動向等によっては、各資産の値上がり利益や為替の評価益等も勘案して収益分配を行う場合があります。
4. 信託報酬は純資産総額に対して年率0.9765%(税込)。ただし、組入れる投資信託証券において、年率0.80%程度の運用報酬を別途受領しますので、受益者が実質的に負担する信託報酬は、概算で年率1.7765%(税込)程度となります。
5. 販売手数料は3.15%(税込)を上限として販売会社が定めるものとします。