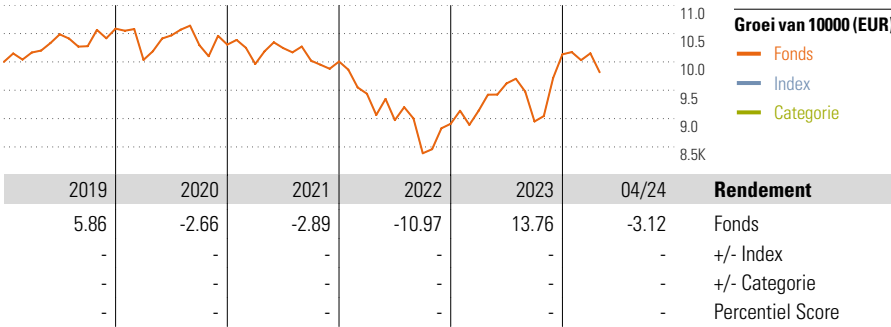


Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio A Acc PLN-Hedged

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Bloomberg US Securitised GR USD	—	Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

De Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portefeuille belegt in Amerikaanse door hypothecaire schuldvordering of activa gedekte vorderingen.



Risicomaatstaven		
Alpha	- Sharpe Ratio	-0.20
Beta	- Std Deviatie	10.29
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-
Tracking Error	- 10-jr Risico	-

Rendementen (31 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	0.87	-	-	2024	0.17	-	-	-
6 Maanden	4.14	-	-	2023	2.59	5.27	-6.98	13.24
1 jaar	7.37	-	-	2022	-5.68	-4.93	-6.52	6.20
3 jr gean.	-0.74	-	-	2021	-3.31	2.82	-2.18	-0.14
5 jr gean.	-0.42	-	-	2020	-5.21	4.31	-1.65	0.09

Portefeuille 30 apr 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	140.40	43.12	97.28
Kas/ geldmarkt	3.44	0.72	2.72
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™		
	Tijdsduur	6.01
	Effectieve Looptijd	-
	Gem Krediet	AA
	Kwaliteit	

Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
AAA	95.71	BBB 1.77
AA	1.93	BB 0.00
A	0.46	B 0.00
		Below B 0.13
		Geen Rating 0.00

Data per 31 mrt 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Government National Mortgage Association.	6.07
Federal National Mortgage Association...	4.85
Government National Mortgage Association.	3.45
Government National Mortgage Association.	2.89
Federal National Mortgage Association...	2.73
Federal National Mortgage Association...	2.55
Government National Mortgage Association.	2.53
Federal National Mortgage Association...	2.49
GS USD Treasury Liq Res X Acc	2.48
Federal National Mortgage Association...	2.37
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	775
% Van Vermogen In Top 10 Posities	32.40

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	2.31
3 tot 5 jaar	5.39
5 tot 7 jaar	2.82
7 tot 10 jaar	4.75
10 tot 15 jaar	11.97
15 tot 20 jaar	4.31
20 tot 30 jaar	42.84
Meer dan 30 jaar	21.80

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	5.59
0% tot 4%	51.05
4% tot 6%	29.60
6% tot 8%	13.27
8% tot 10%	0.48
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,500
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	PLN	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	26 mei 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Not Disclosed	ISIN	LU1396260017		
Aanvangsdatum	30 sep 2002				
Koers (31 mei 2024)	PLN 10.08				
Fondsvermogen (mln)	PLN 2.10				