

Goldman Sachs Euro Long Duration Bond - I Cap EUR

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
Morningstar Eurozone 10+ Yr
Core Bond GR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

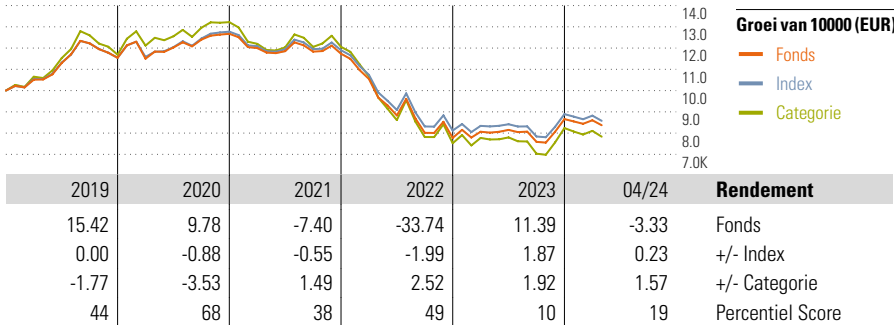
Benchmark van het fonds
Bloomberg Euro Agg 10+ Yr TR
EUR

Morningstar Rating™
★★★

Morningstar Categorie™
Obligaties Euro Lang

Beleggingsdoelstelling

Dit Compartiment streeft ernaar rendement te genereren door actief beheer van een portefeuille die hoofdzakelijk (minimum 2/3) belegd is in langlopende obligaties in euro en die de prestatie van de Benchmark, de Barclays Euro Aggregate (10+ jaar), over een periode van meerdere jaren moet overtreffen.



Risicomaatstaven

Alpha	0.02	Sharpe Ratio	-0.74
Beta	1.05	Std Deviatie	15.71
R-kwadraat	99.68	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.50	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	1.14	10-jr Risico	Gem

Berekeningen met Morningstar EZN 10+Y Core Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.68	0.21	0.77
6 Maanden	6.82	0.66	1.35
1 jaar	6.27	1.10	2.83
3 jr gean.	-9.88	-0.54	0.47
5 jr gean.	-4.42	-0.38	0.62

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-0.64	-	-	-
2023	3.72	1.07	-6.89	14.12
2022	-10.12	-16.26	-9.27	-2.97
2021	-5.29	-1.21	-0.19	-0.84
2020	-0.37	4.57	3.08	2.21

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	132.82	53.88	78.94
Kas/ geldmarkt	50.86	29.80	21.06
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Tijdsduur			
Effectieve Looptijd			
Gem Krediet			
Kwaliteit			
Rentegevoeligheid			

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	3.29
Long-Term Euro BTP Future Mar 242024-03-C	3.28
France (Republic Of) 3%2054-05-25	3.05
Euro Buxl Future Mar 242024-03-07	2.98
GS European ABS-Z Cap EUR	2.82
Germany (Federal Republic Of) 4%2037-01-0	2.30
European Financial Stability Facility...	2.12
Germany (Federal Republic Of)...	2.11
France (Republic Of) 4.5%2041-04-25	1.86
France (Republic Of) 4%2055-04-25	1.78
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	219
% Van Vermogen In Top 10 Posities	25.60

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	0.00
3 tot 5 jaar	0.01
5 tot 7 jaar	0.14
7 tot 10 jaar	3.23
10 tot 15 jaar	38.44
15 tot 20 jaar	19.16
20 tot 30 jaar	25.33
Meer dan 30 jaar	8.97

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	2.02
0% tot 4%	73.70
4% tot 6%	22.80
6% tot 8%	1.06
8% tot 10%	0.35
10% tot 12%	0.07
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	250,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	250,000
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	9 jan 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Hans van Zwol	ISIN	LU0555025526		
Aanvangsdatum	29 apr 2011				
Koers (17 mei 2024)	EUR 7,003.34				
Fondsvermogen (mln)	EUR 199.02				