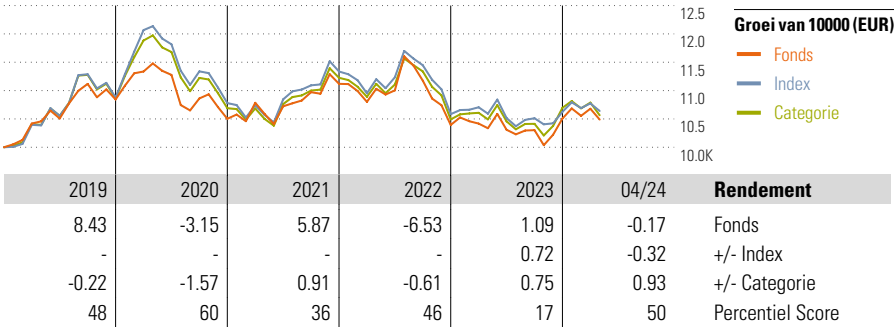


Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio R Acc USD

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar US Government Bond TR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg US Securitised GR USD	Morningstar Rating™ ★★★★	Morningstar Categorie™ Obligaties USD Overheid
---	--	--	------------------------------------	--

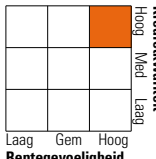
Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven				Rendementen (3 mei 2024)				Kwartaalrendementen				
Alpha	0.61	Sharpe Ratio	-0.20	3 Maanden	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	2024	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Beta	1.16	Std Deviatie	6.85	6 Maanden	4.20	1.89	1.44	2023	0.24	-1.05	-0.06	1.99
R-kwadraat	90.95	3-jr Risico	Gem	1 jaar	2.01	1.61	1.69	2022	-2.86	1.88	1.57	-7.00
Informatie Ratio	-0.21	5-jr Risico	Gem	3 jr gean.	0.07	-0.32	0.09	2021	2.69	-0.57	2.33	1.34
Tracking Error	2.45	10-jr Risico	- gem	5 jr gean.	0.20	-0.34	0.08	2020	4.55	-0.53	-3.68	-3.31

Berekeningen met Morningstar US Govt Bd TR USD (waar van toepassing)

Portefeuille 31 mrt 2024										
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™			Kredietkwaliteit	% Oblg		% Oblg
Aandelen	0.00	0.00	0.00		Tijdsduur	6.01	it			
Obligaties	162.23	32.63	129.60		Effectieve Looptijd	-	AAA	95.71	BBB	1.77
Kas/ geldmarkt	16.69	46.29	-29.60		Gem Krediet	AA	AA	1.93	BB	0.00
Overig	0.00	0.00	0.00		Kwaliteit		A	0.46	B	0.00
				Laag	Gem	Hoog			Below B	0.13
				Rentegevoeligheid					Geen Rating	0.00
Data per31 mrt 2024										

Top 10 Onderliggende posities		% Port	Maturity-verdeling		% Oblg	Couponverdeling		% Oblg
Federal National Mortgage Association...		6.58	1 tot 3 jaar		0.83	0% PIK		3.23
Government National Mortgage Association.		5.45	3 tot 5 jaar		0.40	0% tot 4%		51.06
Government National Mortgage Association.		4.57	5 tot 7 jaar		1.46	4% tot 6%		29.82
10 Year Treasury Note Future June...		4.55	7 tot 10 jaar		7.35	6% tot 8%		15.27
Government National Mortgage Association.		4.08	10 tot 15 jaar		13.65	8% tot 10%		0.61
Government National Mortgage Association.		3.89	15 tot 20 jaar		3.59	10% tot 12%		0.00
Government National Mortgage Association.		3.40	20 tot 30 jaar		40.78	Meer dan 12%		0.00
Federal National Mortgage Association...		3.35	Meer dan 30 jaar		27.71			
Federal National Mortgage Association...		3.23						
Federal National Mortgage Association...		3.09						
Totaal Aantal Aandelen		0						
Totaal Aantal Obligaties		775						
% Van Vermogen In Top 10 Posities		42.18						

Fondsinformatie					
Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	3 dec 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Not Disclosed	ISIN	LU0830686043		
Aanvangsdatum	30 sep 2002				
Koers (3 mei 2024)	USD 11.08				
Fondsvermogen (mln)	USD 1.18				