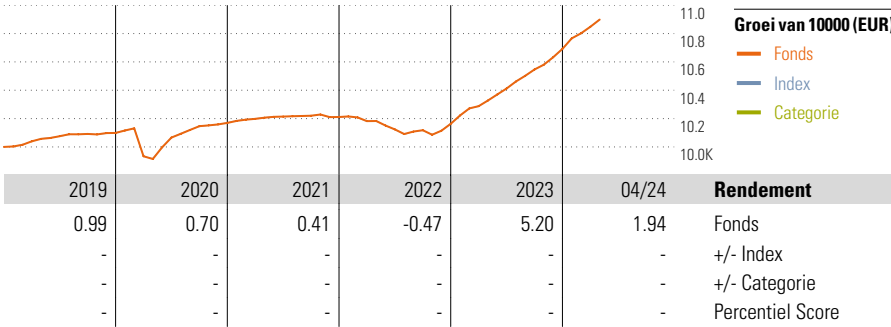


Goldman Sachs AAA ABS - Z Cap EUR

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Bloomberg Euro Floating AAA ABS TR EUR	—	Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

"Dit Compartment streeft ernaar hoofdzakelijk te beleggen in door activa gedekte effecten (ABS) met een rating AAA/Aaa/AAA (bij resp. Standard & Poors, Moody's en Fitch). Het Compartment heeft tot doel, gemeten over een periode van meerdere jaren, de prestatie van de Benchmark, de Barclays Euro Floating Rate AAAABS, te overtreffen. Een ABS is vastrentend effect waarbij het recht op interest en het onderpand gedekt worden door de onderliggende zekerheid of de opbrengsten daarvan. Via een effectiveringsprogramma...



Risicomaatstaven				Rendementen (16 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	1.44	3 Maanden	1.33	-	-	2024	1.46	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	1.00	6 Maanden	3.02	-	-	2023	1.23	1.21	1.29	1.38
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	5.57	-	-	2022	-0.28	-0.57	-0.06	0.45
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	2.29	-	-	2021	0.28	0.16	0.06	-0.09
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	1.67	-	-	2020	-1.63	1.33	0.80	0.23

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™	Kredietkwaliteit
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Tijdsduur	-
Obligaties	97.45	0.00	97.45	Effectieve Looptijd	-
Kas/ geldmarkt	33.09	30.54	2.55	Gem Krediet	-
Overig	0.00	0.00	0.00	Kwaliteit	
				Laag Gem Hoog	
				Rentegevoeligheid	

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	6.49	1 tot 3 jaar	0.00	0% PIK	4.03
VCL Multi-Compartment S.A....	2.95	3 tot 5 jaar	0.65	0% tot 4%	0.00
Red & Black Auto Germany 10 UG...	2.33	5 tot 7 jaar	9.57	4% tot 6%	80.85
Auto ABS French Leases 2023...	2.03	7 tot 10 jaar	21.79	6% tot 8%	13.49
Elstree Funding No.4 PLC 0%2055-10-21	1.79	10 tot 15 jaar	25.99	8% tot 10%	0.00
RRE 1 Loan Management DAC 4.762%2035-1	1.60	15 tot 20 jaar	5.90	10% tot 12%	1.63
BPCE Home Loans FCT 2023 4.612%2057-10	1.59	20 tot 30 jaar	4.46	Meer dan 12%	0.00
Fortuna Consumer Loan ABS 2023-1 DAC...	1.56	Meer dan 30 jaar	31.64		
FCT CA Leasing 2023-1 4.722%2042-02-26	1.48				
Atlas Funding 2022-1 PLC 6.2385%2060-02-2	1.46				
Totaal Aantal Aandelen	0				
Totaal Aantal Obligaties	117				
% Van Vermogen In Top 10 Posities	23.26				

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	7 okt 2013	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Wouter Van Der Grinten	ISIN	LU0939624606		
Aanvangsdatum	1 aug 2014				
Koers (16 mei 2024)	EUR 5,568.64				
Fondsvermogen (mln)	EUR 34.52				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.