

# Goldman Sachs Global Flexible Multi Asset - I Cap USD (hedged i)

Morningstar Medalist Rating™  
**Negative**

Morningstar Categorie Index  
Morningstar EAA USD Mod  
Target Allocation NR USD  
Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds  
Euribor 1 Month EUR

Morningstar Rating™  
★★

Morningstar Categorie™  
Mixfondsen USD Neutraal

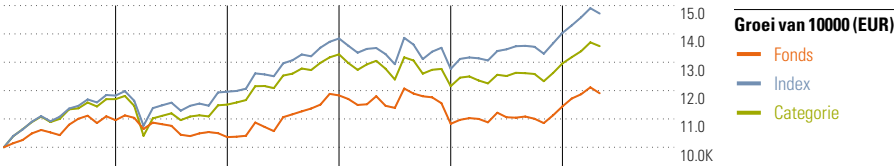
## Beleggingsdoelstelling

Het Compartiment streeft ernaar aantrekkelijke rendementen te genereren onder alle marktomstandigheden door te beleggen in de hieronder omschreven activaklassen. Het Compartiment zal te allen tijde hoofdzakelijk belegd zijn in een combinatie van schuldpapier met investment grade-rating, liquide middelen en kortlopende schulden. Het Compartiment kan bijkomstig ook beleggen in andere activaklassen zoals hieronder omschreven (waarbij maximaal 20% van het nettovermogen van het Compartiment mag worden belegd in door activa...

## Risicomaatstaven

|                  |       |              |       |
|------------------|-------|--------------|-------|
| Alpha            | -2.36 | Sharpe Ratio | 0.32  |
| Beta             | 0.70  | Std Deviatie | 7.92  |
| R-kwadraat       | 85.31 | 3-jr Risico  | - gem |
| Informatie Ratio | -0.41 | 5-jr Risico  | Laag  |
| Tracking Error   | 4.27  | 10-jr Risico | -     |

Berekeningen met Morningstar EAA USD Mod Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)



|                  | 2019  | 2020  | 2021  | 2022  | 2023  | 04/24 | Rendement        |
|------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------------------|
| Fonds            | 9.58  | -5.46 | 14.20 | -8.48 | 5.68  | 4.05  | Fonds            |
| +/- Index        | -     | -     | -1.50 | -0.70 | -4.28 | -0.83 | +/- Index        |
| +/- Categorie    | -7.42 | -4.09 | -1.26 | 0.05  | -0.91 | -0.65 | +/- Categorie    |
| Percentiel Score | 97    | 80    | 65    | 48    | 61    | 68    | Percentiel Score |

| Rendementen (17 mei 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|---------------------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden                 | 1.23   | -1.48  | -1.60  |
| 6 Maanden                 | 8.95   | -1.03  | -0.93  |
| 1 jaar                    | 8.59   | -3.68  | -2.15  |
| 3 jr gean.                | 4.31   | -1.91  | -0.63  |
| 5 jr gean.                | 2.59   | -3.68  | -2.17  |

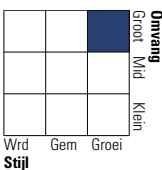
| Kwartaalrendementen | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| 2024                | 5.88  | -     | -     | -     |
| 2023                | 1.60  | 0.54  | -0.49 | 3.97  |
| 2022                | -2.64 | -1.12 | 3.62  | -8.25 |
| 2021                | 4.96  | 1.75  | 2.74  | 4.08  |
| 2020                | -2.85 | 1.04  | -2.48 | -1.24 |

## Portefeuille 29 feb 2024

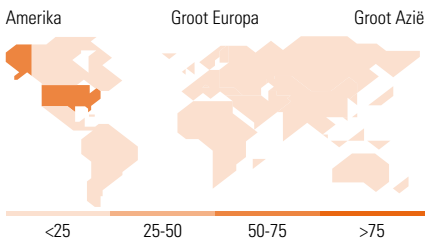
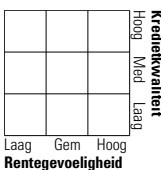
| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 42.34  | 0.00    | 42.34   |
| Obligaties     | 73.57  | 0.00    | 73.57   |
| Kas/ geldmarkt | 51.52  | 68.64   | -17.12  |
| Overig         | 1.25   | 0.05    | 1.20    |

## Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



| Top 10 Onderliggende posities     | Sector | % Port |
|-----------------------------------|--------|--------|
| 10 Year Treasury Note Future...   | —      | 12.23  |
| E-mini S&P 500 Future Mar...      | —      | 6.11   |
| Microsoft Corp                    | 📄      | 2.57   |
| United States Treasury Notes...   | —      | 2.51   |
| United States Treasury Notes...   | —      | 2.50   |
| United States Treasury Notes...   | —      | 2.44   |
| United States Treasury Notes...   | —      | 2.42   |
| 10 Year Government of Canada...   | —      | 1.89   |
| United States Treasury Notes...   | —      | 1.86   |
| Australian 10 Year Treasury...    | —      | 1.77   |
| Totaal Aantal Aandelen            |        | 60     |
| Totaal Aantal Obligaties          |        | 386    |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities |        | 36.31  |

| Sectorverdeling                | % Aand       |
|--------------------------------|--------------|
| <b>Cyclisch</b>                | <b>28.52</b> |
| Basismaterialen                | 2.47         |
| Cyclische consumentenproducten | 9.19         |
| Financiële dienstverlening     | 16.51        |
| Vastgoed                       | 0.36         |
| <b>Licht Cyclisch</b>          | <b>46.55</b> |
| Communicatiediensten           | 6.54         |
| Energie                        | 2.73         |
| Industrie                      | 7.91         |
| Technologie                    | 29.36        |
| <b>Defensief</b>               | <b>24.93</b> |
| Defensieve consumptiegoederen  | 8.09         |
| Gezondheidszorg                | 16.06        |
| Nutsbedrijven                  | 0.78         |

| Regioverdeling          | % Aand       |
|-------------------------|--------------|
| <b>Amerika</b>          | <b>75.41</b> |
| Verenigde Staten        | 74.77        |
| Canada                  | 0.63         |
| Latijns Amerika         | 0.00         |
| <b>Groot Europa</b>     | <b>19.29</b> |
| Verenigd Koninkrijk     | 2.66         |
| West Europa – Euro      | 7.34         |
| West Europa – Niet Euro | 9.29         |
| Emerging Europa         | 0.00         |
| Midden-Oosten / Afrika  | 0.00         |
| <b>Groot Azië</b>       | <b>5.30</b>  |
| Japan                   | 3.71         |
| Australazië             | 0.00         |
| Azië - Ontwikkeld       | 1.59         |
| Azië - Emerging         | 0.00         |

## Fondsinformatie

|                     |                        |                |              |                    |         |
|---------------------|------------------------|----------------|--------------|--------------------|---------|
| Fondsgroep          | Goldman Sachs Asset... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 250,000 |
| Telefoon            | +31-703781781          | Fondsvaluta    | USD          | Min Additioneel    | -       |
| Website             | https://www.gsam.com   | UCITS          | ja           |                    |         |
| Oprichtingsdatum    | 6 mrt 2018             | Inc/Acc        | Acc          |                    |         |
| Fondsmanager        | Niels de Visser        | ISIN           | LU1175220679 |                    |         |
| Aanvangsdatum       | 1 dec 2014             |                |              |                    |         |
| Koers (17 mei 2024) | USD 5,734.41           |                |              |                    |         |
| Fondsvermogen (mln) | USD 0.01               |                |              |                    |         |