

Goldman Sachs AAA ABS - Zz Cap EUR

Morningstar Categorie Index

—

Benchmark van het fonds

Bloomberg Euro Floating AAA ABS TR EUR

Morningstar Rating™

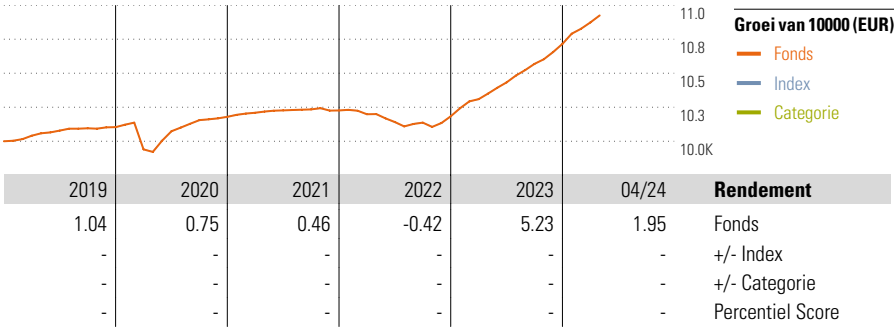
—

Morningstar Categorie™

Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

"Dit Compartiment 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 Compartiment 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 effectiseringsprogramma...



Risicomaatstaven

Alpha	-	Sharpe Ratio	1.50
Beta	-	Std Deviatie	1.00
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-
Tracking Error	-	10-jr Risico	-

Rendementen (2 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.31	-	-
6 Maanden	3.03	-	-
1 jaar	5.54	-	-
3 jr geän.	2.26	-	-
5 jr geän.	1.67	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.47	-	-	-
2023	1.24	1.19	1.30	1.39
2022	-0.27	-0.56	-0.04	0.46
2021	0.29	0.17	0.07	-0.08
2020	-1.62	1.34	0.81	0.24

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	97.45	0.00	97.45
Kas/ geldmarkt	33.09	30.54	2.55
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	
	Effectieve Looptijd	-
	Gem Krediet	-
	Kwaliteit	-

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	6.49
VCL Multi-Compartment S.A....	2.95
Red & Black Auto Germany 10 UG...	2.33
Auto ABS French Leases 2023...	2.03
Elstree Funding No.4 PLC 0%2055-10-21	1.79
RRE 1 Loan Management DAC 4.762%2035-1	1.60
BPCE Home Loans FCT 2023 4.612%2057-10	1.59
Fortuna Consumer Loan ABS 2023-1 DAC...	1.56
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

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	0.00
3 tot 5 jaar	0.65
5 tot 7 jaar	9.57
7 tot 10 jaar	21.79
10 tot 15 jaar	25.99
15 tot 20 jaar	5.90
20 tot 30 jaar	4.46
Meer dan 30 jaar	31.64

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	4.03
0% tot 4%	0.00
4% tot 6%	80.85
6% tot 8%	13.49
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	1.63
Meer dan 12%	0.00

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	2 mei 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Wouter Van Der Grinten	ISIN	LU1473480967		
Aanvangsdatum	1 aug 2014				
Koers (2 mei 2024)	EUR 271,307.59				
Fondsvermogen (mln)	EUR 164.99				