

Sovereign LT Bond Fund (NL) - I

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar Eurozone Treasury
Bond GR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Markit iBoxx € Sub&sov 5+ex
BBB

Morningstar Rating™

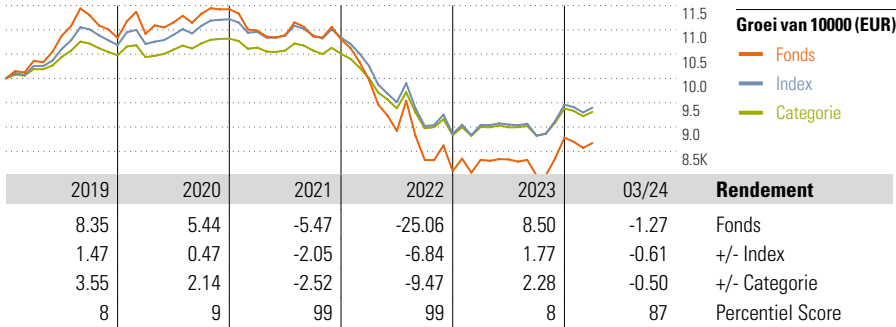
★★

Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Overheid

Beleggingsdoelstelling

Het Fonds stelt zich ten doel om door middel van actief beheer te komen tot een beter totaal rendement op lange termijn dan de index. De index voor het Fonds is de iBoxx EUR Sovereigns & Sub-Sovereigns ex BBB 5+Y. De beheerder van de index, Markit, is opgenomen in het ESMA register voor indices en beheerders van indices.



Risicomaatstaven

Alpha	0.32	Sharpe Ratio	-0.77
Beta	1.46	Std Deviatie	11.10
R-kwadraat	98.94	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.72	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	3.61	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met Morningstar EZN Trsy Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (25 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.59	-0.87	-0.64
6 Maanden	6.62	1.56	2.64
1 jaar	2.34	-0.57	0.12
3 jr gean.	-8.23	-2.93	-3.47
5 jr gean.	-3.89	-1.88	-1.76

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-1.27	-	-	-
2023	2.84	0.11	-3.95	9.71
2022	-7.64	-10.58	-6.69	-2.74
2021	-3.86	-0.88	-0.21	-0.59
2020	0.78	2.12	1.61	0.83

Portefeuille 31 dec 2023

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	96.31	0.20	96.12
Kas/ geldmarkt	3.95	0.00	3.95
Overig	0.00	0.07	-0.07

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	-
	Gem Krediet	-
	Kwaliteit	-
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
Netherlands (Kingdom Of) 0%2031-07-15	5.47
Netherlands (Kingdom Of) 0%2038-01-15	5.03
Spain (Kingdom of) 1.45%2071-10-31	4.94
Germany (Federal Republic Of) 0%2030-08-1!	4.39
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	3.65
Germany (Federal Republic Of) 0%2031-08-1!	3.48
Germany (Federal Republic Of) 0%2029-08-1!	2.64
France (Republic Of) 5.5%2029-04-25	2.15
European Union 3.375%2032-04-04	1.97
Caisse d Amortissement De La Dette...	1.85
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	110
% Van Vermogen In Top 10 Posities	35.56

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	0.00
3 tot 5 jaar	0.00
5 tot 7 jaar	23.04
7 tot 10 jaar	30.26
10 tot 15 jaar	19.77
15 tot 20 jaar	7.08
20 tot 30 jaar	10.57
Meer dan 30 jaar	9.08

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	33.07
0% tot 4%	57.08
4% tot 6%	9.85
6% tot 8%	0.00
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	100,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	29 jun 2001	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Hans van Zwol	ISIN	NL0001130499		
Aanvangsdatum	1 jan 2018				
Koers (25 apr 2024)	EUR 1,531.72				
Fondsvermogen (mln)	EUR 7.59				