

Neutral

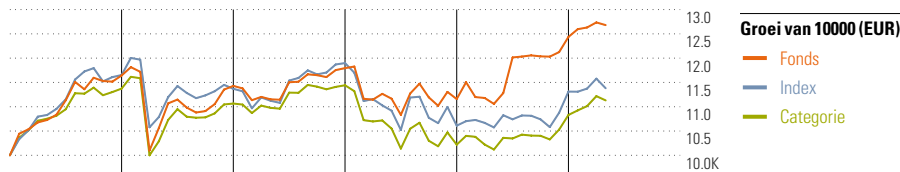
Wordt gebruikt in dit rapport als index

CEMBI Broad Diversified TR...

★★★★

Markets

The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing primarily in fixed income securities of Emerging Markets government and corporate issuers.



2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
16.42	-1.84	3.21	-5.40	11.45	1.96	Fonds
-0.10	0.60	-1.46	5.44	4.84	1.35	+/- Index
2.34	0.98	-0.33	5.32	4.75	-0.95	+/- Categorie
33	32	65	16	8	69	Percentiel Score

Alpha	2.64	Sharpe Ratio	0.44
Beta	0.85	Std Deviatie	7.45
R-kwadraat	71.25	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	0.58	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	6.01	10-jr Risico	Gem

Berekeningen met Morningstar EM Sov Bd GR USD (waar van toepassing)

3 Maanden	1.12	-0.40	-1.09
6 Maanden	5.58	-1.98	-3.05
1 jaar	13.90	6.08	2.57
3 jr gean.	4.57	3.39	2.59
5 jr gean.	3.50	2.40	1.85

2024	2.40	-	-	-
2023	0.19	7.46	0.19	3.32
2022	-5.50	-2.82	3.33	-0.31
2021	-1.98	2.69	1.26	1.25
2020	-13.25	10.37	-2.12	4.74

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.05	0.04	0.01
Obligaties	198.41	106.67	91.75
Kas/ geldmarkt	19.90	11.65	8.25
Overig	0.00	0.00	0.00

			Hoog	Kredietkwaliteit	Tijdsduur	5.81
			Med		Effectieve Looptijd	-
			Med		Gem Krediet	BB
			Laag		Kwaliteit	
Laag	Gem	Hoog				
Rentegevoeligheid						

it			
AAA	10.97	BBB	31.94
AA	2.85	BB	29.46
A	8.93	B	9.05
		Below B	3.62
		Geen Rating	3.18

Data per 31 mrt 2024

Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.09
10 Year Treasury Note Future June...	4.91
Us 5yr Note (Cbt) Jun24 Xcbt...	4.26
GS USD Treasury Liq Res X Acc	3.49
Us Long Bond(Cbt) Jun24 Xcbt...	2.66

Chile (Republic of) 1.5%	2026-03-01	1.98
Inter-American Development Bank...		1.80
Indonesia (Republic of) 6.625%	2034-02-15	1.74
Mexico (United Mexican States)...		1.57
Plurinational State of Bolivia...		1.53

Totaal Aantal Aandelen	10
Totaal Aantal Obligaties	283
% Van Vermogen In Top 10 Posities	30.03

1 tot 3 jaar	35.11
3 tot 5 jaar	9.88
5 tot 7 jaar	11.33
7 tot 10 jaar	8.11
10 tot 15 jaar	11.03
15 tot 20 jaar	2.64
20 tot 30 jaar	1.92
Meer dan 30 jaar	0.43

0% PIK	10.92
0% tot 4%	41.72
4% tot 6%	15.18
6% tot 8%	10.39
8% tot 10%	9.08
10% tot 12%	4.92
Meer dan 12%	7.80

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	8 mei 2013	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Angus Bell	ISIN	LU0910637270		
Aanvangsdatum	31 okt 2016				
Koers (17 mei 2024)			USD 68.00		
Fondsvermogen (mln)	USD 0.01				