

# Goldman Sachs Global High Yield Portfolio P Inc USD

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar Global High-Yield  
Bond GR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Bloomberg US HY 2% Issuer Cap  
TR USD

Morningstar Rating™

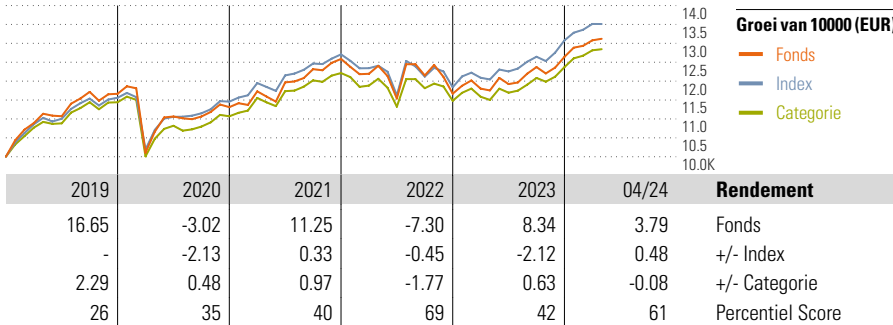
★★★

Morningstar Categorie™

Obligaties Wereldwijd High Yield

## Beleggingsdoelstelling

Goldman Sachs Global High Yield Portfolio zal voornamelijk beleggen in vastrentende effecten met een hoog rendement van bedrijven waarvan de zetel gevestigd is in de Verenigde Staten of West-Europa en die op het moment van de belegging onder de beleggingsnorm zijn gequoteerd.



## Risicomaatstaven

|                  |       |              |         |
|------------------|-------|--------------|---------|
| Alpha            | -0.55 | Sharpe Ratio | 0.39    |
| Beta             | 0.90  | Std Deviatie | 8.10    |
| R-kwadraat       | 95.17 | 3-jr Risico  | Gem     |
| Informatie Ratio | -0.13 | 5-jr Risico  | Bov gem |
| Tracking Error   | 2.04  | 10-jr Risico | -       |

Berekeningen met Morningstar Gbl HY Bd GR USD (waar van toepassing)

## Rendementen (17 mei 2024)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | 0.77   | -0.36  | -0.30  |
| 6 Maanden  | 6.82   | -0.41  | -0.47  |
| 1 jaar     | 9.59   | -1.31  | -0.88  |
| 3 jr gean. | 4.30   | -0.38  | -0.13  |
| 5 jr gean. | 3.26   | -0.94  | -0.14  |

## Kwartaalrendementen

|      | 1e kw  | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------|--------|-------|-------|-------|
| 2024 | 3.48   | -     | -     | -     |
| 2023 | 1.15   | 1.02  | 3.78  | 2.17  |
| 2022 | -3.11  | -5.37 | 5.29  | -3.97 |
| 2021 | 3.69   | 2.02  | 2.93  | 2.18  |
| 2020 | -13.34 | 9.45  | 0.00  | 2.25  |

## Portefeuille 31 mrt 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.68   | 0.00    | 0.68    |
| Obligaties     | 116.54 | 8.97    | 107.57  |
| Kas/ geldmarkt | 9.11   | 19.77   | -10.66  |
| Overig         | 2.41   | 0.00    | 2.41    |

## Morningstar Vastrentende Style Box™

|      | Tijdsduur           | 3.18 |
|------|---------------------|------|
|      | Effectieve Looptijd | -    |
|      | Gem Krediet         | B    |
|      | Kwaliteit           |      |
| Laag | Gem                 | Hoog |
| Laag | Gem                 | Hoog |
| Laag | Gem                 | Hoog |

| Kredietkwalite it | % Oblg | % Oblg           |
|-------------------|--------|------------------|
| AAA               | 0.54   | BBB 7.62         |
| AA                | 0.00   | BB 46.33         |
| A                 | 0.28   | B 32.12          |
|                   |        | Below B 11.44    |
|                   |        | Geen Rating 1.67 |

Data per 31 mrt 2024

## Top 10 Onderliggende posities

|                                            | % Port |
|--------------------------------------------|--------|
| 2 Year Treasury Note Future June...        | 4.37   |
| CCO Holdings, LLC/ CCO Holdings Capital... | 0.82   |
| 10 Year Treasury Note Future June...       | 0.65   |
| ARKO Corp. 5.125%2029-11-15                | 0.61   |
| TransDigm, Inc. 5.5%2027-11-15             | 0.56   |
| INTELSAT EMERGENCE S.A.                    | 0.56   |
| Urban One Inc 7.375%2028-02-01             | 0.55   |
| LifePoint Health, Inc 9.75%2026-12-01      | 0.55   |
| SRM Escrow Issuer Llc 6%2028-11-01         | 0.52   |
| Hawaiian Brand Intellectual Property...    | 0.52   |
| Totaal Aantal Aandelen                     | 7      |
| Totaal Aantal Obligaties                   | 524    |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities          | 9.71   |

## Maturity-verdeling

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 17.52  |
| 3 tot 5 jaar     | 42.22  |
| 5 tot 7 jaar     | 27.63  |
| 7 tot 10 jaar    | 5.06   |
| 10 tot 15 jaar   | 1.06   |
| 15 tot 20 jaar   | 0.11   |
| 20 tot 30 jaar   | 0.42   |
| Meer dan 30 jaar | 0.36   |

## Couponverdeling

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 0.00   |
| 0% tot 4%    | 16.99  |
| 4% tot 6%    | 46.84  |
| 6% tot 8%    | 24.05  |
| 8% tot 10%   | 8.78   |
| 10% tot 12%  | 2.02   |
| Meer dan 12% | 1.32   |

## Fondsinformatie

|                     |                        |                |              |                    |           |
|---------------------|------------------------|----------------|--------------|--------------------|-----------|
| Fondsgroep          | Goldman Sachs Asset... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 1,000,000 |
| Telefoon            | +31-703781781          | Fondsvaluta    | USD          | Min Additioneel    | -         |
| Website             | https://www.gsam.com   | UCITS          | ja           |                    |           |
| Oprichtingsdatum    | 3 mei 2017             | Inc/Acc        | Inc          |                    |           |
| Fondsmanager        | Robert Magnuson        | ISIN           | LU1602483866 |                    |           |
| Aanvangsdatum       | 1 jan 2014             |                |              |                    |           |
| Koers (17 mei 2024) | USD 8.72               |                |              |                    |           |
| Fondsvermogen (mln) | USD 4.44               |                |              |                    |           |