

# Goldman Sachs Euro Covered Bond - Zz Cap EUR

## Morningstar Categorie Index

Morningstar Eurozone Corporate Bond GR  
EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

## Benchmark van het fonds

Bloomberg Euro Agg Seczd Covered TR  
EUR

## Morningstar Rating™

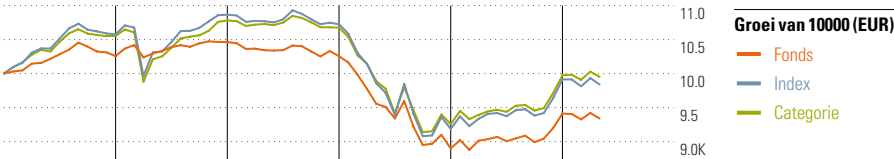
★★

## Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Bedrijven

### Beleggingsdoelstelling

Dit Compartiment streeft naar rendement door voornamelijk te beleggen in een portefeuille van gedekte obligaties en geldmarktinstrumenten die in euro luiden. Gedekte obligaties zijn gewaarborgde, preferentie schuldinstrumenten van een emittent, gewoonlijk een bank, die beleggers toegang biedt tot zowel de emittent als de onderliggende, dynamische pool van onderpanden. Dit Compartiment heeft tot doel de prestaties van de Benchmark, de Barclays Euro-Aggregate Securitized Covered Bond Index, over een periode van meerdere...



|                  | 2019  | 2020  | 2021  | 2022   | 2023  | 04/24 | Rendement        |
|------------------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|------------------|
| Fonds            | 2.57  | 2.01  | -1.98 | -13.24 | 5.77  | -0.78 | Fonds            |
| +/- Index        | -3.20 | -0.72 | -0.68 | 1.10   | -2.14 | -0.02 | +/- Index        |
| +/- Categorie    | -2.97 | -0.14 | -1.01 | 0.14   | -1.95 | -0.55 | +/- Categorie    |
| Percentiel Score | 94    | 58    | 92    | 32     | 93    | 85    | Percentiel Score |

### Risicomaatstaven

|                  |       |              |       |
|------------------|-------|--------------|-------|
| Alpha            | -1.60 | Sharpe Ratio | -0.93 |
| Beta             | 0.73  | Std Deviatie | 5.08  |
| R-kwadraat       | 91.38 | 3-jr Risico  | - gem |
| Informatie Ratio | -0.17 | 5-jr Risico  | Laag  |
| Tracking Error   | 2.29  | 10-jr Risico | -     |

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

### Rendementen (17 mei 2024)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | 0.81   | -0.07  | -1.36  |
| 6 Maanden  | 2.81   | -0.70  | -2.38  |
| 1 jaar     | 3.81   | -1.86  | -3.72  |
| 3 jr gean. | -3.11  | -0.44  | -1.19  |
| 5 jr gean. | -1.62  | -0.69  | -1.28  |

### Kwartaalrendementen

|      | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2024 | 0.09  | -     | -     | -     |
| 2023 | 1.29  | -0.08 | -0.16 | 4.68  |
| 2022 | -4.68 | -4.46 | -4.18 | -0.57 |
| 2021 | -0.93 | -0.21 | -0.18 | -0.67 |
| 2020 | -0.20 | 1.48  | 0.53  | 0.18  |

### Portefeuille 31 dec 2023

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 98.68  | 3.94    | 94.74   |
| Kas/ geldmarkt | 5.21   | 0.45    | 4.76    |
| Overig         | 0.50   | 0.00    | 0.50    |

### Morningstar Vastrentende Style Box™

|                   |      |     |      |
|-------------------|------|-----|------|
|                   | Laag | Gem | Hoog |
| Kredietkwaliteit  |      |     |      |
| Rentegevoeligheid |      |     |      |

|                     |      |
|---------------------|------|
| Tijdsduur           | 4.31 |
| Effectieve Looptijd | -    |
| Gem Krediet         | AA   |
| Kwaliteit           |      |

| Kredietkwaliteit | % Oblg | % Oblg           |
|------------------|--------|------------------|
| AAA              | 85.01  | BBB 0.51         |
| AA               | 9.42   | BB 0.00          |
| A                | 5.06   | B 0.00           |
|                  |        | Below B 0.00     |
|                  |        | Geen Rating 0.00 |

Data per 31 dec 2023

### Top 10 Onderliggende posities

|                                          | % Port |
|------------------------------------------|--------|
| UniCredit Bank AG 0.625%2025-11-20       | 2.42   |
| GS Liquid Euro-Z Cap EUR                 | 2.32   |
| Euro Schatz Future Mar 242024-03-07      | 2.00   |
| Banco Santander, S.A. 3.25%2028-02-14    | 1.95   |
| Bpce Sfh 3.25%2028-04-12                 | 1.95   |
| Credit Agricole Home Loan SFH...         | 1.76   |
| DnB Boligkreditt AS 0.01%2031-01-21      | 1.66   |
| Westpac Securities NZ Ltd (London)...    | 1.64   |
| The Toronto-Dominion Bank 3.715%2030-03- | 1.50   |
| Societe Generale SFH 3.375%2030-07-31    | 1.47   |
| Totaal Aantal Aandelen                   | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties                 | 136    |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities        | 18.66  |

### Maturity-verdeling

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 25.12  |
| 3 tot 5 jaar     | 35.00  |
| 5 tot 7 jaar     | 21.01  |
| 7 tot 10 jaar    | 11.12  |
| 10 tot 15 jaar   | 3.55   |
| 15 tot 20 jaar   | 0.90   |
| 20 tot 30 jaar   | 0.00   |
| Meer dan 30 jaar | 0.12   |

### Couponverdeling

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 0.00   |
| 0% tot 4%    | 93.83  |
| 4% tot 6%    | 6.17   |
| 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 | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 5,000,000 |
| Telefoon            | +31-703781781          | Fondsvaluta    | EUR          | Min Additioneel    | -         |
| Website             | https://www.gsam.com   | UCITS          | ja           |                    |           |
| Oprichtingsdatum    | 1 mei 2018             | Inc/Acc        | Acc          |                    |           |
| Fondsmanager        | Dirk Frikkee           | ISIN           | LU1473481858 |                    |           |
| Aanvangsdatum       | 1 aug 2015             |                |              |                    |           |
| Koers (17 mei 2024) | EUR 236,151.82         |                |              |                    |           |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 12.86              |                |              |                    |           |