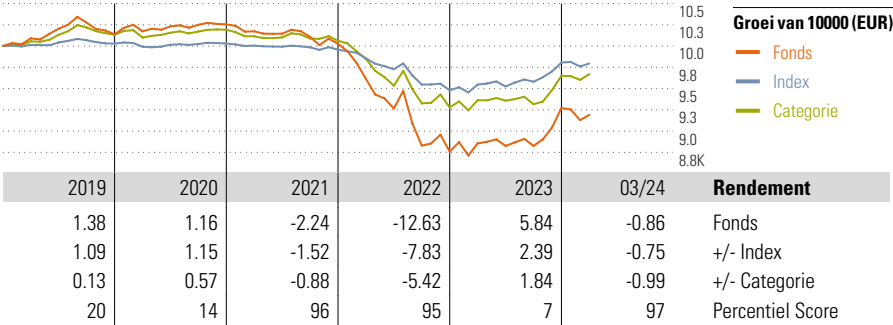


Duration Matching Fund (M) (NL) I

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Eurozone 1-3 Yr Treasury Bond GR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg EuroAgg Treasury 1-3 Yr TR EUR	Morningstar Rating™ ★	Morningstar Categorie™ EUR Government Bond - Short Term
---	---	--	---------------------------------	---

Beleggingsdoelstelling

Het Subfonds belegt hoofdzakelijk in geldmarktinstrumenten, money market funds en vastrentende waarden luidende in euro's alsmede rentederivaten zoals renteswaps en obligatiefutures. Het Subfonds heeft een middellange gewogen gemiddelde looptijd als doelstelling. De gewogen gemiddelde looptijd wordt weergegeven door de 'duratie', een maatstaf voor de rentegevoeligheid. De middellange duratie wordt met name door inzet van rentederivaten gerealiseerd.



Risicomaatstaven			
Alpha	0.33	Sharpe Ratio	-0.94
Beta	2.55	Std Deviatie	4.88
R-kwadraat	90.86	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.85	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	3.09	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EZN 1-3 Yr Tsy Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (29 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.17	-0.84	-0.89
6 Maanden	2.68	1.24	1.38
1 jaar	2.76	0.46	0.61
3 jr gean.	-3.48	-2.75	-2.55
5 jr gean.	-2.00	-1.53	-1.30

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-0.86	-	-	-
2023	1.10	-0.34	0.00	5.04
2022	-4.12	-3.62	-4.71	-0.79
2021	-0.80	-0.27	-0.38	-0.80
2020	0.34	0.58	0.18	0.05

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	27.03	2.50	24.53
Kas/ geldmarkt	75.89	0.11	75.78
Overig	0.00	0.31	-0.31

Morningstar Vastrentende Style Box™			Kredietkwaliteit	
Kredietkwaliteit	Hoog	Med	Laag	
	Tijdsduur	-		
	Effectieve Looptijd	-		
	Gem Krediet	-		
Rentegevoeligheid	Laag	Gem	Hoog	

Kredietkwaliteit	
0% PIK	51.80
0% tot 4%	25.39
4% tot 6%	22.80
6% tot 8%	0.00
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Top 10 Onderliggende posities	% Port
GS Liquid Euribor 3M-Zz Cap EUR	61.56
GS Liquid Euro-Zz Cap EUR	16.91
Germany (Federal Republic Of) 0%2025-10-11	6.67
European Union 0%2025-11-04	5.35
Germany (Federal Republic Of)...	3.59
Netherlands (Kingdom Of) 0.25%2025-07-15	2.82
European Union 0%2028-06-02	1.60
GS Euro Liquid Res X Acc T	1.10
European Union 0%2026-03-04	0.39
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	13
% Van Vermogen In Top 10 Posities	99.98

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	66.40
3 tot 5 jaar	19.20
5 tot 7 jaar	0.00
7 tot 10 jaar	0.00
10 tot 15 jaar	0.09
15 tot 20 jaar	0.00
20 tot 30 jaar	0.00
Meer dan 30 jaar	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	10 mei 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Hans van Zwol	ISIN	NL0010622411		
Aanvangsdatum	1 jun 2018				
Koers (29 apr 2024)	EUR 107.40				
Fondsvermogen (mln)	EUR 152.39				