

Duration Matching Fund (XL) (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

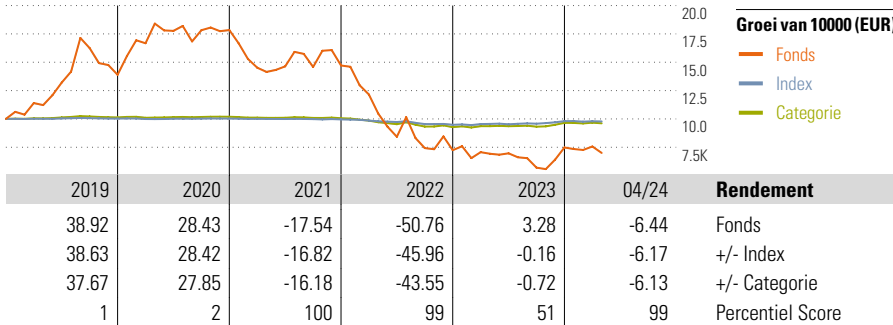
Beleggingsdoelstelling

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 zeer lange gewogen gemiddelde looptijd als doelstelling. De gewogen gemiddelde looptijd wordt weergegeven door de 'duratie', een maatstaf voor de rentegevoeligheid. De zeer lange duratie wordt met name door inzet van rentederivaten gerealiseerd.

Risicomaatstaven

Alpha	8.51	Sharpe Ratio	-0.59
Beta	13.73	Std Deviatie	32.97
R-kwadraat	54.64	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.64	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	31.60	10-jr Risico	-

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



Rendementen (30 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-4.72	-4.70	-4.44
6 Maanden	25.55	24.07	24.25
1 jaar	1.04	-1.23	-1.11
3 jr gean.	-20.90	-20.19	-19.96
5 jr gean.	-9.01	-8.55	-8.31

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.16	-	-	-
2023	-2.41	-1.46	-18.16	31.22
2022	-17.41	-30.67	-11.77	-2.52
2021	-18.63	0.81	-0.38	0.90
2020	20.03	6.54	0.33	0.09

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	45.24	4.66	40.58
Kas/ geldmarkt	63.10	3.61	59.49
Overig	0.00	0.08	-0.08

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Tijdsduur			
Effectieve Looptijd			
Gem Krediet			
Kwaliteit			
Rentegevoeligheid			

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
GS Liquid Euro-Zz Cap EUR	41.71
GS Liquid Euribor 3M-Zz Cap EUR	14.49
Germany (Federal Republic Of) 0%2025-10-11	8.37
European Union 0%2025-11-04	7.11
European Union 0%2028-06-02	7.11
GS Euro Liquid Res X Acc T	7.05
Netherlands (Kingdom Of) 2%2024-07-15	3.87
Netherlands (Kingdom Of) 0%2026-01-15	3.77
Germany (Federal Republic Of)...	3.51
European Union 0%2026-03-04	0.25

Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	29
% Van Vermogen In Top 10 Posities	97.24

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	44.29
3 tot 5 jaar	23.48
5 tot 7 jaar	0.00
7 tot 10 jaar	5.86
10 tot 15 jaar	0.00
15 tot 20 jaar	0.01
20 tot 30 jaar	4.41
Meer dan 30 jaar	11.37

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	58.82
0% tot 4%	37.97
4% tot 6%	3.21
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	-
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	10 mei 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ghilain Vermeiren	ISIN	NL0010622502		
Aanvangsdatum	1 jan 2015				
Koers (30 apr 2024)	EUR 184.28				
Fondsvermogen (mln)	EUR 567.24				