

Duration Matching Fund (L) (NL) D

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

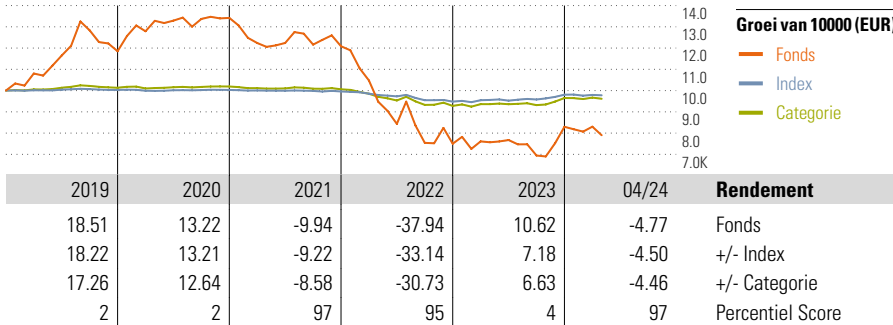
Beleggingsdoelstelling

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

Risicomaatstaven

Alpha	5.13	Sharpe Ratio	-0.66
Beta	9.11	Std Deviatie	20.28
R-kwadraat	64.06	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.66	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	18.78	10-jr Risico	-

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



Rendementen (3 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.60	-1.80	-1.84
6 Maanden	11.41	9.74	9.62
1 jaar	4.47	2.16	1.64
3 jr gean.	-12.84	-12.18	-11.61
5 jr gean.	-5.69	-5.26	-4.72

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	0.07	-	-	-
2023	1.48	0.84	-9.51	19.46
2022	-13.31	-19.50	-10.58	-0.54
2021	-8.80	0.01	-0.63	-0.63
2020	7.92	3.92	0.59	0.36

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	32.38	2.12	30.26
Kas/ geldmarkt	73.04	3.33	69.71
Overig	0.03	0.00	0.03

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Tijdsduur			
Effectieve Looptijd			
Gem Krediet			
Kwaliteit			
Rentegevoeligheid			

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
GS Liquid Euribor 3M-Zz Cap EUR	40.97
GS Liquid Euro-Zz Cap EUR	29.44
Germany (Federal Republic Of)...	7.74
Germany (Federal Republic Of) 0%2025-10-11	6.03
GS Euro Liquid Res X Acc T	5.17
European Union 0%2025-11-04	4.49
Netherlands (Kingdom Of) 0%2026-01-15	2.74
European Union 0%2028-06-02	1.43
European Union 0%2026-03-04	0.18
Euro Buxl Future Mar 242024-03-07	0.03
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	20
% Van Vermogen In Top 10 Posities	98.20

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	46.21
3 tot 5 jaar	28.32
5 tot 7 jaar	0.00
7 tot 10 jaar	10.03
10 tot 15 jaar	0.00
15 tot 20 jaar	6.00
20 tot 30 jaar	0.04
Meer dan 30 jaar	1.36

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	45.94
0% tot 4%	41.38
4% tot 6%	12.68
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	11 apr 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Hans van Zwol	ISIN	NL0012817043		
Aanvangsdatum	1 jun 2018				
Koers (3 mei 2024)	EUR 826.91				
Fondsvermogen (mln)	EUR 511.21				