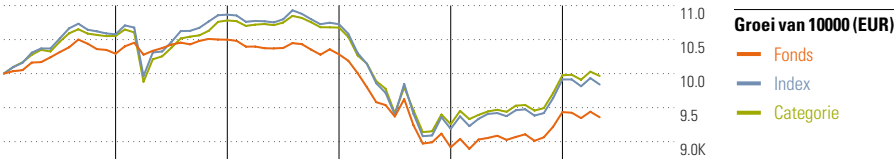


# Euro Covered Bond Fund (NL) D

| Morningstar Categorie Index                | Benchmark van het fonds                 | Morningstar Rating™ | Morningstar Categorie™    |
|--------------------------------------------|-----------------------------------------|---------------------|---------------------------|
| Morningstar Eurozone Corporate Bond GR EUR | Bloomberg Euro Agg Seczd Covered TR EUR | ★★                  | Obligaties Euro Bedrijven |
| Wordt gebruikt in dit rapport als index    |                                         |                     |                           |

**Beleggingsdoelstelling**

Het Subfonds belegt hoofdzakelijk in een gespreide portefeuille van investment grade gedekte obligaties gedemonineerd in euro. Het Subfonds heeft de mogelijkheid om de beleggingen zowel direct als indirect – bijvoorbeeld door het aangaan van exposure op de betreffende financiële instrumenten via derivaten of beleggingen in andere beleggingsfondsen – aan te houden. Het Subfonds kan gebruik maken van derivaten zoals opties, futures, warrants, swaps en valutatermijntransacties. Deze kunnen worden toegepast voor het...



|  | 2019  | 2020  | 2021  | 2022   | 2023  | 04/24 | Rendement        |
|--|-------|-------|-------|--------|-------|-------|------------------|
|  | 2.92  | 2.01  | -2.06 | -13.28 | 5.80  | -0.80 | Fonds            |
|  | -2.86 | -0.72 | -0.77 | 1.06   | -2.10 | -0.05 | +/- Index        |
|  | -2.62 | -0.15 | -1.10 | 0.09   | -1.91 | -0.72 | +/- Categorie    |
|  | 91    | 58    | 93    | 33     | 93    | 79    | Percentiel Score |

| Risicomaatstaven |       |              |       |
|------------------|-------|--------------|-------|
| Alpha            | -1.63 | Sharpe Ratio | -0.93 |
| Beta             | 0.73  | Std Deviatie | 5.09  |
| R-kwadraat       | 91.18 | 3-jr Risico  | - gem |
| Informatie Ratio | -0.18 | 5-jr Risico  | Laag  |
| Tracking Error   | 2.30  | 10-jr Risico | -     |

| Rendementen (2 mei 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|--------------------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden                | -0.19  | -0.11  | -0.17  |
| 6 Maanden                | 2.95   | -1.09  | -1.64  |
| 1 jaar                   | 3.29   | -1.23  | -2.29  |
| 3 jr gean.               | -3.32  | -0.41  | -0.84  |
| 5 jr gean.               | -1.62  | -0.60  | -0.97  |

| Kwartaalrendementen | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| 2024                | 0.05  | -     | -     | -     |
| 2023                | 1.28  | -0.06 | -0.16 | 4.69  |
| 2022                | -4.69 | -4.40 | -4.24 | -0.61 |
| 2021                | -0.97 | -0.20 | -0.23 | -0.68 |
| 2020                | -0.14 | 1.44  | 0.52  | 0.18  |

**Portefeuille** 29 feb 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 98.36  | 0.42    | 97.94   |
| Kas/ geldmarkt | 2.54   | 0.04    | 2.50    |
| Overig         | 0.29   | 0.73    | -0.44   |

| Morningstar Vastrentende Style Box™                                                                                       |     |                  |                     |   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|------------------|---------------------|---|
| <div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div></div> |     | Kredietkwaliteit | Tijdsduur           | - |
|                                                                                                                           |     |                  | Effectieve Looptijd | - |
|                                                                                                                           |     |                  | Gem Krediet         | - |
|                                                                                                                           |     |                  | Kwaliteit           | - |
|                                                                                                                           |     |                  | Rentegevoeligheid   |   |
| Laag                                                                                                                      | Gem | Hoog             |                     |   |

| Kredietkwaliteit |       |
|------------------|-------|
| 0% PIK           | 0.00  |
| 0% tot 4%        | 93.99 |
| 4% tot 6%        | 6.01  |
| 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 Euro Covered Bond-Zz Cap EUR          | 9.82   |
| DnB Boligkreditt AS 0.01%2031-01-21      | 2.06   |
| UniCredit Bank GmbH 0.625%2025-11-20     | 1.62   |
| Sparebank 1 Boligkreditt AS...           | 1.32   |
| Credit Agricole Home Loan SFH...         | 1.31   |
| Caisse de Refinancement de l'Habitat...  | 1.26   |
| Programa Cedula TDA 4.25%2027-03-28      | 1.23   |
| Compagnie de Financement Foncier CFF...  | 1.21   |
| Bank of New Zealand 3.7075%2028-12-20    | 1.18   |
| The Toronto-Dominion Bank 0.864%2027-03- | 1.15   |
| Totaal Aantal Aandelen                   | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties                 | 156    |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities        | 22.16  |

| Maturity-verdeling | % Oblg |
|--------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar       | 29.48  |
| 3 tot 5 jaar       | 34.29  |
| 5 tot 7 jaar       | 17.07  |
| 7 tot 10 jaar      | 11.15  |
| 10 tot 15 jaar     | 5.33   |
| 15 tot 20 jaar     | 1.30   |
| 20 tot 30 jaar     | 0.00   |
| Meer dan 30 jaar   | 0.20   |

**Fondsinformatie**

|                     |                        |                |              |                    |   |
|---------------------|------------------------|----------------|--------------|--------------------|---|
| Fondsgroep          | Goldman Sachs Asset... | Vestigingsland | Nederland    | Min Aanvangsbedrag | - |
| Telefoon            | +31-703781781          | Fondsvaluta    | EUR          | Min Additioneel    | - |
| Website             | https://www.gsam.com   | UCITS          | ja           |                    |   |
| Oprichtingsdatum    | 30 sep 2018            | Inc/Acc        | Acc          |                    |   |
| Fondsmanager        | Dirk Frikkee           | ISIN           | NL0013040397 |                    |   |
| Aanvangsdatum       | 1 jun 2018             |                |              |                    |   |
| Koers (2 mei 2024)  | EUR 941.95             |                |              |                    |   |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 98.53              |                |              |                    |   |