

# Goldman Sachs US Fixed Income Portfolio Base USD MDist

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Core Bond TR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Bloomberg US Agg Bond TR USD

Morningstar Rating™

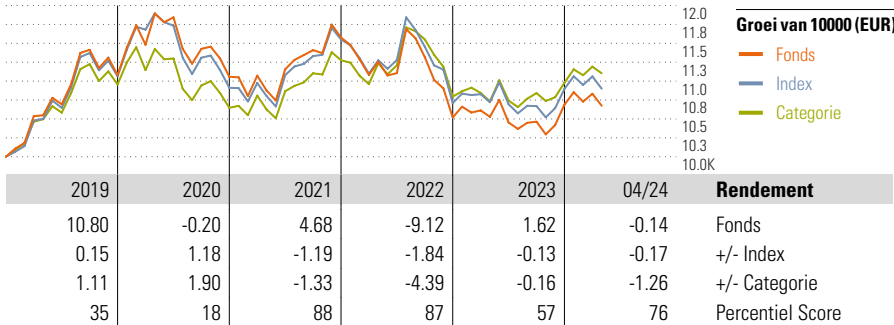
★★

Morningstar Categorie™

Obligaties USD Gediversifieerd

## Beleggingsdoelstelling

Goldman Sachs US Fixed Income Portfolio zal onder normale marktomstandigheden minstens twee derde van zijn totale activa beleggen in vastrentende effecten van emittenten in de Verenigde Staten van Amerika, met inbegrip van effecten die zijn uitgegeven of gewaarborgd door de regering van de VS, effecten van bedrijven, door hypothecaire zekerheid gedekte effecten en effecten op onderpand van activa.



## Risicomaatstaven

|                  |       |              |         |
|------------------|-------|--------------|---------|
| Alpha            | -0.74 | Sharpe Ratio | -0.25   |
| Beta             | 1.03  | Std Deviatie | 6.70    |
| R-kwadraat       | 98.13 | 3-jr Risico  | Bov gem |
| Informatie Ratio | -0.86 | 5-jr Risico  | Bov gem |
| Tracking Error   | 1.02  | 10-jr Risico | Bov gem |

Berekeningen met Morningstar US Core Bd TR USD (waar van toepassing)

## Rendementen (3 mei 2024)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | -1.32  | -0.23  | 0.03   |
| 6 Maanden  | 3.49   | 0.05   | -0.26  |
| 1 jaar     | 1.79   | -0.10  | -0.68  |
| 3 jr gean. | -0.37  | -0.92  | -0.86  |
| 5 jr gean. | 0.30   | -0.54  | -0.53  |

## Kwartaalrendementen

|      | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2024 | 1.34  | -     | -     | -     |
| 2023 | 0.89  | -1.50 | 0.09  | 2.16  |
| 2022 | -4.26 | 0.22  | 1.92  | -7.07 |
| 2021 | 0.13  | 0.77  | 2.26  | 1.45  |
| 2020 | 3.63  | 3.15  | -3.52 | -3.23 |

## Portefeuille 31 mrt 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 165.45 | 71.92   | 93.53   |
| Kas/ geldmarkt | 6.54   | 0.07    | 6.47    |
| Overig         | 0.00   | 0.00    | 0.00    |

## Morningstar Vastrentende Style Box™

|      | Tijdsduur           | 6.42 |
|------|---------------------|------|
|      | Effectieve looptijd | -    |
|      | Gem Krediet         | A    |
|      | Kwaliteit           |      |
| Laag | Gem                 | Hoog |
| Laag | Mied                | Laag |
| Laag | Hoog                | Laag |

| Kredietkwaliteit | % Oblg |             | % Oblg |
|------------------|--------|-------------|--------|
| AAA              | 60.81  | BBB         | 20.42  |
| AA               | 4.94   | BB          | 0.00   |
| A                | 13.79  | B           | 0.00   |
|                  |        | Below B     | 0.01   |
|                  |        | Geen Rating | 0.02   |

Data per 31 mrt 2024

## Top 10 Onderliggende posities

|                                          | % Port |
|------------------------------------------|--------|
| 2 Year Treasury Note Future June...      | 9.11   |
| Us 5yr Note (Cbt) Jun24 Xcbt...          | 5.16   |
| GS USD Treasury Liq Res X Acc            | 4.69   |
| Us Ultra Bond Cbt Jun24 Xcbt...          | 3.01   |
| United States Treasury Notes...          | 2.61   |
| United States Treasury Notes...          | 1.77   |
| 10 Year Treasury Note Future June...     | 1.64   |
| Federal National Mortgage Association... | 1.20   |
| Federal National Mortgage Association... | 1.19   |
| Federal Home Loan Mortgage Corp...       | 1.18   |
| Totaal Aantal Aandelen                   | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties                 | 720    |
| % Van vermogen in top 10 posities        | 31.56  |

## Maturity-verdeling

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 13.64  |
| 3 tot 5 jaar     | 8.09   |
| 5 tot 7 jaar     | 8.00   |
| 7 tot 10 jaar    | 11.25  |
| 10 tot 15 jaar   | 10.31  |
| 15 tot 20 jaar   | 5.58   |
| 20 tot 30 jaar   | 21.10  |
| Meer dan 30 jaar | 4.52   |

## Couponverdeling

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 12.80  |
| 0% tot 4%    | 60.58  |
| 4% tot 6%    | 20.63  |
| 6% tot 8%    | 5.94   |
| 8% tot 10%   | 0.06   |
| 10% tot 12%  | 0.00   |
| Meer dan 12% | 0.00   |

## Fondsinformatie

|                     |                        |                |              |                           |       |
|---------------------|------------------------|----------------|--------------|---------------------------|-------|
| Fondsgroep          | Goldman Sachs Asset... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag        | 5,000 |
| Telefoon            | +31-703781781          | Fondsvaluta    | USD          | Min Additioneel           | -     |
| Website             | https://www.gsam.com   | UCITS          | ja           | Jaarlijkse Management Fee | 1.00% |
| Oprichtingsdatum    | 5 mei 2011             | Inc/Acc        | Inc          |                           |       |
| Fondsmanager        | Not Disclosed          | ISIN           | LU0620231984 |                           |       |
| Aanvangsdatum       | 27 jul 1998            |                |              |                           |       |
| Koers (3 mei 2024)  | USD 9.42               |                |              |                           |       |
| Fondsvermogen (mln) | USD 188.65             |                |              |                           |       |