EQUITIES

FIXED INCOME

MULTI ASSET

STRUCTURED

MONEY MARKET

Factsheet Publicitaire Mededeling

Goldman Sachs Euro Obligatie Fonds (NL)

Management company: Goldman Sachs Asset Management B.V.

★★ Overall Morningstar Rating™ ★★★ 3-year Morningstar Rating™ ★★ 5-year Morningstar Rating™

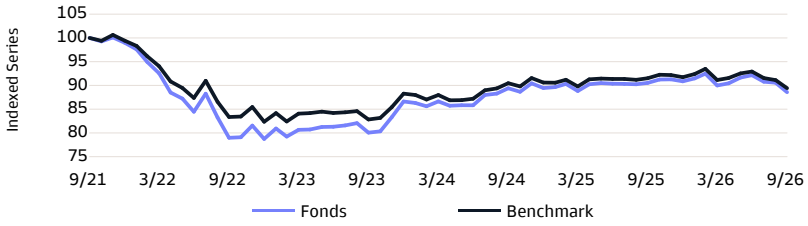
Morningstar Ratings 31/08/2026. Meer info: zie lexicon

Beleggingsbeleid

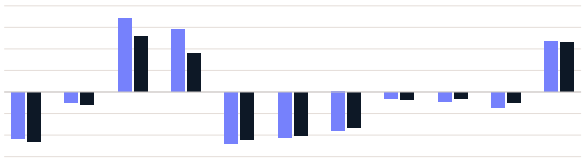
Het Fonds is geclassificeerd als een financieel product conform artikel 8 van de Verordening (EU) betreffende informatieverschaffing over duurzaamheid in de financiëledienstensector. Het Fonds promoot ecologische/sociale kenmerken (E/S-kenmerken), maar heeft geen duurzame beleggingen als doelstelling. Het Fonds integreert naast traditionele factoren ook ESG-factoren en risico's in het beleggingsproces. Gedetailleerde informatie over de informatieverschaffing over duurzaamheid van het Fonds is te vinden in de PCD (bijlage voor de precontractuele informatieverschaffing van het prospectus) op https://am.gs.com/en-int/advisors/funds. Het subfonds belegt hoofdzakelijk in een gespreide portefeuille van staatsobligaties en bedrijfsleningen van hoge kwaliteit. Daar-mee wordt bedoeld een kwaliteitsoordeel van AAA tot en met BBB- of daaraan gelijkwaardig. Het subfonds wordt actief beheerd op basis van zowel fundamentele- als kwantitatieve analyses. Deze analyses worden gebruikt om in het fonds binnen de euro-zone actief te sturen op de stand van de rente en het landen- en kredietbeleid. Hierdoor kan de samenstelling van het subfonds materieel afwijken van de vergelijkingsmaatstaf de Bloomberg Euro-Aggregate index. Dit is een brede weergave van het beleggingsuniversum. Gemeten over een periode van meerdere jaren heeft het subfonds als doel beter te presteren dan de vergelijkingsmaatstaf. Om het risico van het subfonds te beheersen wordt een strikte risicocontrole gehanteerd, waarbij de risico-limieten ten opzichte van de bovengenoemde index het uitgangspunt zijn. U kunt uw aandelen in het subfonds verkopen op elke beursdag waarop de waarde van de aandelen wordt berekend. Dit vindt dagelijks plaats voor dit subfonds. In principe keert het subfonds aan u geen dividend uit. Het zal alle inkomsten opnieuw beleggen.

* Het beleggingsbeleid werd integraal overgenomen uit het Essentiële Informatiedocument (KID). Het kapitaal en/of het rendement word(t)(en) niet gewaarborgd of beschermd.

Rendement (netto %) in het verleden *



Rendement per jaar (netto %) *



EUR	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y	6Y	7Y	8Y	9Y	10Y	Since Inception
Fonds	-2.16	-0.47	3.42	2.90	-2.40	-2.13	-1.81	-0.31	-0.44	-0.70	2.33
Benchmark	-2.29	-0.58	2.58	1.77	-2.21	-2.02	-1.67	-0.36	-0.31	-0.51	2.32

Gegevens per 30/09/2026

Kerngegevens

Type Fonds	Vastrentende Waarden
Share Class	G
Valuta Share Class	EUR
ISIN Code	NL0010622254
Bloomberg Code	-
Reuters Code	-
Telekurs Code	-
WKN Code	-
Sedol Code	-
SFDR Classificatie	Artikel 8
Domicilie	NLD
Benchmark	Bloomberg Euro Aggregate Bond index, in EUR
Koers Frequentie	Daily

Fondsgegevens

Oprichtingsdatum Fonds		31/03/2014
Oprichtingsdatum Share Class		10/05/2014
Vervaldatum Fonds		Onbepaald
Minimum subscription	share	1
Koers	EUR	21.29
Koers vorige maand	EUR	21.77
1 Jaar Hoog (27/02/2026)	EUR	22.23
1 Jaar Laag (28/09/2026)	EUR	21.24
Totale Nettowaarde Fonds (Mln)	EUR	730.81
Totale Nettowaarde Share Class (Mln)	EUR	19.43
Totale Nettowaarde Beleggingen (Mln)	EUR	730.52
Aantal Uitstaande Aandelen		912,819
Duratie		5.99
Gemiddelde kredietrating		A+
Rendement tot vervaldatum		4.59
Laagste potentiele rendement		4.58

Kosten

Lopende kosten die elk jaar in rekening worden gebracht	
Beheerskosten en andere administratie- of exploitatiekosten	0.29%
Transactiekosten	0.00%

Top 10 Holdings

CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETT 25 NOV 2030 REGS	3.02%
EUROPEAN UNION 2.5% 04 OCT 2052 REGS	2.28%
DUTCH GOVT 2.5% 15 JUL 2035 144A REGS	2.24%
FRENCH GOVT OAT 2.4% 24 SEP 2029 144A REGS	1.40%
EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.625% 14 MAR 2042 REGS	1.32%
ITALIAN GOVT BTP 3.85% 01 FEB 2035 REGS	1.31%
SPANISH GOVT 1.45% 30 APR 2029 144A REGS	1.25%
GERMAN GOVT BOBL192 2.2% 10 OCT 2030 REGS	1.21%
ITALIAN GOVT BTP 3.15% 01 JUN 2031 REGS	1.17%
KFW 0.05% 29 SEP 2034 REGS	1.06%

Disclaimer

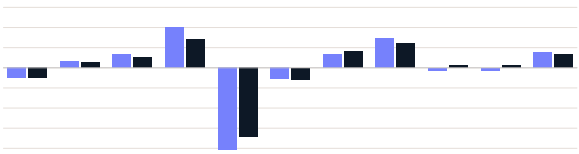
Raadpleeg de belangrijke informatie en het lexicon aan het einde van dit document. Prestatiegegevens verstrekt door Goldman Sachs Asset Management.

Goldman Sachs | Asset Management

Factsheet

Goldman Sachs Euro Obligatie Fonds (NL)

Jaarlijks rendement (netto %) *



EUR	2026Q3	2025	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Fonds	-2.52	1.58	3.26	10.02	-20.45	-2.79	3.29	7.37	-0.67	-0.25	3.95
Benchmark	-2.52	1.25	2.63	7.19	-17.17	-2.85	4.05	5.98	0.41	0.68	3.32

* In het verleden behaalde resultaten vormen geen betrouwbare indicator voor toekomstige resultaten. Bij de berekening zijn alle vergoedingen en kosten meegewogen die op het niveau van het Fonds zijn gerekend, met uitzondering van de inschrijvingskosten. Indien van toepassing, zullen eventuele bewaarderskosten de waardeontwikkeling verder verlagen.

Statistieken

EUR	1 jaar	3 jaar	5 jaar
Standaard Afwijking	4.34	4.81	6.96
Sharpe Ratio per jaar	-1.02	0.11	-0.67
Alpha	0.03	0.05	0.01
Bèta	1.07	1.11	1.15
R-Squared	0.99	0.98	0.98
Informatie Ratio per jaar	0.22	0.97	-0.14
Tracking Error per jaar	0.57	0.86	1.33
VaR (95% per jaar)			8.17%

De VaR (Value at Risk) is een statistische indicator voor het maximale jaarlijkse verlies dat kan worden behaald binnen een bepaald betrouwbaarheidsinterval.

Risicoprofiel (categorie: zie pag. 1)

De samenvattende risico-indicator is een richtsnoer voor het risiconiveau van dit product ten opzichte van andere producten. De indicator laat zien hoe groot de kans is dat beleggers verliezen op het product wegens marktontwikkelingen of doordat er geen geld voor betaling is. Voor de risico-indicator wordt ervan uitgegaan dat u het product houdt voor minstens 5 jaar.Het daadwerkelijke risico kan sterk variëren als u in een vroeg stadium verkoopt en u kunt minder terugkrijgen.
We hebben dit Fonds ingedeeld in klasse 3 uit 7; dat is een middelgroot-lage risicoklasse. Hierdoor zijn de potentiële verliezen als gevolg van toekomstige prestaties middelgroot-laag en is het onwaarschijnlijk dat ongunstige marktomstandigheden het vermogen van het Fonds om u te betalen zullen beïn
Wees u bewust van het valutarisico wanneer de fondsvaluta afwijkt van de officiële valuta van de lidstaat waar het Fonds u wordt aangeboden. U ontvangt betalingen in een andere valuta dan de officiële valuta van de lidstaat waar het Fonds u wordt aangeboden. Het uiteindelijke rendement dat u ontvangt, is dus afhankelijk van de wisselkoers tussen beide valuta. Dit risico is niet opgenomen in de bovenstaande indicator.
De relevante risico's voor dit Fonds zijn de volgende:
Marktrisico: Dit risico wordt geassocieerd met financiële instrumenten waarvan de waarde beïnvloed wordt door economische ontwikkeling van individuele bedrijven, door de algemene wereldwijde economische situatie en door de economische en politieke condities die van kracht zijn in elk relevant land.
Kredietrisico: het potentiële falen van onderliggende uitgevende partijen om aan hun verplichtingen te voldoen kan invloed hebben op de waarde van uw beleggingen.
Concentratierisico: Beleggingen geconcentreerd in een bepaalde regio of thema zouden in hoge mate geraakt kunnen worden door een enkele marktgebeurtenis.
Duurzaamheidsrisico: Het zich voordoen van een gebeurtenis met impact op milieu, sociale omstandigheden of bestuur, die een negatieve impact kan hebben op de waarde van uw beleggingen.

Raadpleeg het prospectus en het essentiële-informatiedocument voor aanvullende informatie.

Uitgekeerd Dividend (bruto)

Jaar	2026 YTD	2025	2024	2023	2022
EUR	-	-	-	-	-

Gegevens per 30/09/2026

Geografische verdeling

Ierland	19.24%
Frankrijk	11.28%
Italië	8.59%
Spanje	8.04%
Nederland	7.52%
Duitsland	6.73%
Verenigd Koninkrijk	6.20%
Supranational	5.26%
Verenigde Staten	4.57%
België	3.32%
Overige	19.24%

Valuta verdeling

EUR	100.00%
GBP	-0.01%

Rating allocatie

AAA	28.14%
AA	13.32%
A	33.96%
BBB	23.87%
Liquide Middelen	0.51%
Derivaten	0.20%

Sector verdeling

Bedrijven - Investment Grade	30.05%
Overheid	24.80%
Asset-Backed Securities (ABS)	22.14%
Quasi-overheid	9.64%
Covered Bond	7.06%
Opkomende markten	3.20%
Effecten op basis van woninghypotheken	2.00%
Liquide Middelen	0.51%
Commerciële hypotheken (CMBS)	0.40%
Derivaten	0.20%

Andere aandelenklassen

O	EUR	NL0012650386
Z	EUR	NL0010622262
U	EUR	NL0010622247
P	EUR	NL0006311797

Disclaimer

Raadpleeg de belangrijke informatie en het lexicon aan het einde van dit document. Prestatiegegevens verstrekt door Goldman Sachs Asset Management.

Factsheet

Goldman Sachs Euro Obligatie Fonds (NL)

Disclaimer

Dit is een publicitaire mededeling gepubliceerd door Goldman Sachs Asset Management B.V., een UCITS (icbe) /AIF (abi) beheerder gevestigd in Nederland. Deze publicitaire mededeling is uitsluitend opgesteld ter informatie en is geen aanbod noch een uitnodiging om effecten of een ander beleggingsproduct te kopen of verkopen of om deel te nemen in een handelsstrategie noch het verlenen van een beleggingsdienst noch beleggingsresearch. De informatie in deze publicitaire mededeling mag niet worden beschouwd als fiscaal of juridisch advies.

Goldman Sachs Asset Management B.V. is de beheerder van de in Nederland gevestigde NN Investment Partners fondsen en in die hoedanigheid in het bezit van vergunningen van de Autoriteit Financiële Markten (AFM) op grond van de Wet op het Financieel Toezicht. Het fonds is geregistreerd bij de AFM. Alle prestatiewaarden die niet in de fondsvaluta worden uitgedrukt, zijn berekend door conversie. Het rendement wordt berekend op basis van de Koers (NAV) per deelbewijs: NAV-NAV (zonder eventuele initiële kosten; uitkeringen herbelegd), met inkomen herbelegd. Indien een fonds in het buitenland belegt, kan de waarde ervan schommelen vanwege de wisselkoersen. De lopende kosten zijn de som van alle commissies en kosten aangerekend op permanente basis voor de gemiddelde fondsactiva (bedrijfskosten). De waarde wordt uitgedrukt als een percentage van de activa van het fonds. Tenzij anders vermeld, zijn alle gegevens 'non audited'.

Aan beleggen zijn risico's verbonden, onder andere het risico op kapitaalverlies. De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. De prijs van eenheden en eventuele inkomsten hieruit kan dalen alsook stijgen en is niet gegarandeerd. Beleggers lopen het risico dat ze het oorspronkelijk belegde bedrag verliezen. Wisselkoersvolatiliteit vormt een bijkomend wisselkoersrisico. Bij de beslissing om te beleggen in een fonds moet rekening gehouden worden met alle kenmerken en doelstellingen van het fonds, zoals beschreven in het prospectus.

Loop geen onnodig risico: lees raadpleeg het prospectus, het supplement en het Essentiële-informatiedocument (Eid) voordat u belegt. Het prospectus, het supplement en het Eid (indien van toepassing), informatie over duurzaamheidsaspecten van het fonds (zoals de SFDR classificatie) en andere wettelijke verplichte documenten inzake het fonds (met daarin informatie over het fonds, de kosten en de risico's) zijn beschikbaar op www.gsam.com/responsible-investing (sectie Documenten) in de relevante talen van de landen waar het fonds is geregistreerd danwel genotificeerd voor marketing-doeleinden. Goldman Sachs Asset Management B.V. kan beslissen de regelingen voor de verhandeling van zijn fondsen stop te zetten overeenkomstig artikel 93 bis van Richtlijn 2009/65/EG en artikel 32 bis van Richtlijn 2011/61/EU zoals geïmplementeerd in artikelen 2:121ca en 2:124.0a Wft. Informatie over rechten van beleggers en informatie over de mechanismen voor collectief verhaal zijn beschikbaar op www.gsam.com/responsible-investing (sectie Beleid).

Deze publicitaire mededeling is niet bestemd voor US Persons als gedefinieerd in Rule 902 van Regulation S van de United States Securities Act of 1933, en mag niet gebruikt worden voor het werven van investeringen of inschrijven op effecten in landen waar dit niet is toegestaan door de lokale toezichthouder of wet- en regelgeving.

Hoewel de inhoud van deze publicitaire mededeling met de meeste zorg is samengesteld en is gebaseerd op betrouwbare informatiebronnen, wordt er geen enkele uitdrukkelijke of impliciete garantie of verklaring gegeven omtrent de juistheid of volledigheid van de informatie. De bewaarder van het fonds, The Bank of New York Mellon SA/NV, Amsterdam Branch, heeft zich ervan vergewist dat de beheerder van het fonds, Goldman Sachs Asset Management B.V., effectieve processen heeft opgezet, welke er voor zorgen dat de navolgende gegevens gepresenteerd in dit document in overeenstemming zijn met wetgeving en richtlijnen zoals vastgelegd in de statuten van het fonds: De Totale fondsgrootte (mio), Uitstaande aandelen, Top 10 Holdings, Geografische- en Valuta verdeling. De bewaarder geeft geen garantie betreffende de accuraatheid van de gepresenteerde informatie en kan hiervoor ook niet aansprakelijk worden gehouden. Krachtens artikel 50 lid 2 Bgfo is deze verklaring van de bewaarder uitsluitend van toepassing indien het fonds onder het Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities (UCITS) toezicht regime valt.

De informatie in deze publicitaire mededeling kan zonder voorafgaande kennisgeving worden gewijzigd. Goldman Sachs Asset Management B.V. noch enig andere vennootschap of bedrijfsonderdeel behorend tot The Goldman Sachs Group Inc. noch een van haar bestuurders of werknemers aanvaarden enige aansprakelijkheid of verantwoordelijkheid met betrekking tot de hierin opgenomen informatie.

Gebruik van de informatie in deze publicitaire mededeling is op eigen risico. Het is niet toegestaan deze publicitaire mededeling en de informatie hierin te vermenigvuldigen, reproduceren, distribueren, verspreiden of tegen vergoeding beschikbaar te stellen aan derden, zonder de voorafgaande uitdrukkelijke, schriftelijke, toestemming van Goldman Sachs Asset Management B.V. Alle claims voortvloeiend uit of in verband met de voorwaarden van deze disclaimer zijn onderworpen aan het Nederlandse recht.

Voetnoot
De Top-10 belangen en portefeuilleallocaties zijn (indien beschikbaar) inclusief cash en synthetic cash. Bij cash gaat het om deposito's, kasgeld als onderpand, valutaspotcontracten, valutatermijncontracten en andere liquide middelen, zoals verplichtingen en vorderingen. Synthetic cash betreft Derivatives' Cash Offsets.

Zie onze SFDR-pagina op www.gsam.com/responsible-investing voor meer informatie over milieu en maatschappelijke kenmerken, die worden gepromoot door het fonds.

Factsheet

Goldman Sachs Euro Obligatie Fonds (NL)

Lexicon

1 jaar hoog (dd.mm.jjjj): Geeft de hoogste koers weer van het fonds over het afgelopen jaar en op welke dag dit was.
1 Jaar laag (dd.mm.jjjj): Geeft de laagste koers weer van het fonds over het afgelopen jaar en op welke dag dit was.
Activa Aandelenklasse (Mio): De totale activa onder beheer van een aandelenklasse.
Alpha: Alpha is het extra rendement – door middel van actief beheer – van een fonds, bovenop het rendement van de benchmark. Bij een positieve alpha heeft het fonds beter gepresteerd dan de benchmark.
Benchmark: Vooraf vastgestelde, objectieve maatstaf waarmee de rendementen van een beleggingsfonds vergeleken worden.
Bèta: De bèta toont de mate van volatiliteit van het fonds aan ten opzichte van de brede markt.
Bevek: Bevek is de afkorting van 'Beleggingsvennootschap met Veranderlijk Kapitaal'. Een Bevek is een ICB van het statutaire type, is een rechtspersoon en is meestal een naamloze vennootschap. Een Bevek heeft als typisch kenmerk dat ze doorlopend en zonder formaliteiten haar kapitaal kan verhogen door nieuwe aandelen uit te geven of omgekeerd haar kapitaal kan verminderen door bestaande aandelen in te kopen.
Compartiment: Een bevek of gemeenschappelijk beleggingsfonds kan bestaan uit verschillende compartimenten die elk hun eigen beleggingsbeleid hebben. Ieder compartiment moet beschouwd worden als een afzonderlijke entiteit. De belegger heeft slechts recht op het vermogen en de opbrengst van het compartiment waarin hij heeft belegd.
Distributie: Distributiefondsen betalen u periodiek (meestal jaarlijks) een dividend uit indien het tijdens het voorbije jaar positieve resultaten wist te behalen. Het dividend ligt evenwel niet vooraf vast en wordt door het fonds zelf bepaald. Het kan dus gevoelig variëren van het ene jaar tot het andere.
Duratie: Maatstaf voor de rentegevoeligheid van obligatiekoersen. Hoe langer de resterende gemiddelde looptijd van de obligaties in het fonds (= hogere duratie), des te sterker obligatiekoersen reageren op een renteverandering. Bij stijgende rentevoeten daalt de koers van een obligatie en vice versa.
Equities: Aandelen.
Fixed Income: Vastrentende waarden.
Floating Rate Notes: Floating rate notes zijn obligaties met een variabele rente.
Fonds: 'Fonds' is een veelgebruikte term voor een Instelling voor Collectieve Belegging (ICB). De term kan betrekking hebben op een compartiment van een Belgische bevek, een compartiment van een Luxemburgse sicav, een gemeenschappelijk beleggingsfonds of een compartiment van een gemeenschappelijk beleggingsfonds. De betreffende belegging betreft de aankoop van deelnemingsrechten of aandelen van een fonds, en niet van een onderliggende waarde waarin het Fonds belegt.
Gemiddelde Krediet Rating: De 'gemiddelde krediet rating' van het fonds is gebaseerd op de gemiddelde krediet rating van de beleggingen van het fonds. Voor de berekening van de gemiddelde rating op het niveauvan de onderliggende beleggingen worden Moody, Fitch en S&P ratings gebruikt. De samenstelling wordt berekend als een gemiddelde op basis van de beschikbaarheid van de krediet ratings. Deze samengestelderating wordt berekend voor beleggingen in obligaties. De ratingschaal gaat van hoog ('AAA' en'AA') over medium ('A' en 'BBB') tot laag ('BB', 'B', 'CCC', 'CC' en 'C').
Gewogen gemiddelde looptijd: De gewogen gemiddelde looptijd wordt uitgedrukt in aantal jaren, gewogen naar het gewicht van de effecten in de portefeuille en laat toe de rentegevoeligheid van het geldmarktfonds in te schatten. Hoe hoger de gewogen gemiddelde looptijd, hoe groter de impact van een wijziging van de rentevoet op de prijs van de portefeuille.
Informatieratio: Maatstaf voor rendementsrisico bij het beoordelen van de prestatie van een fonds. Maatstaf voor rendementsrisico bij het beoordelen van de prestatie van een fonds.
Kapitalisatie: Kapitalisatiefondsen herbeleggen automatisch winsten of dividenden om de waarde van het initiële kapitaal te laten aangroeien. Ze keren dus geen periodieke dividenden uit.
Land toegepaste wet: De domicilie of vestigingsland is het land waarin een beleggingsfonds zijn woonplaats heeft. Deze kan belangrijke gevolgen voor de belastingsheffing hebben.
Lopende kosten: Lopende kosten worden in de loop van een jaar aan het fonds onttrokken en kunnen van jaar tot jaar verschillen. Zie voor meer informatie over lopende kosten het Document met essentiële beleggersinformatie (EBI). Deze lopende kosten bestaan uit (i) beheervergoedingen en andere administratieve of operationele kosten en (ii) transactiekosten.
Minimum inschrijving: Geeft het bedrag of het aantal deelbewijzen weer die minimaal dient geïnvesteerd te worden in het compartiment.
Money Market: Kortlopende geldmarktinstrumenten en cash.
Morningstar rating 3-years: Een (kwantitatieve) rating berekend over een periode van 3 jaar. Hierbij wordt rekening gehouden met in het verleden behaalde rendementen en schommelingen in de koers.
Morningstar rating 5-years: Een (kwantitatieve) rating berekend over een periode van 5 jaar. Hierbij wordt rekening gehouden met in het verleden behaalde rendementen en schommelingen in de koers.
Morningstar rating overall: De Overall Morningstar Rating is een gewogen gemiddelde van de afzonderlijke ratings.
Morningstar Ratings: Morningstar is een onafhankelijk leverancier van beleggingsonderzoek. De Morningstar-rating is een kwantitatieve evaluatie van de prestatie in het verleden van een fonds, rekening houdend met het risico en de aangerekende kosten. De rating neemt geen kwalitatieve elementen in aanmerking en wordt berekend op basis van een (wiskundige) formule. De fondsen worden ondergebracht in categorieën en vergeleken met gelijksoortige fondsen op basis van hun score en krijgen één tot vijf sterren toegekend. In elke categorie krijgt de eerste 10% 5 sterren, de volgende 22,5% 4 sterren, de volgende 35% 3 sterren, de volgende 22,5% 2 sterren en de laatste 10% 1 ster. De rating wordt maandelijks berekend op basis van de prestaties in het verleden over 3, 5 en 10 jaar en houdt geen rekening met de toekomst.
Multi Asset: Gemengd.
Munt aandelenklasse: Is de munt van de netto-invetariswaarde, binnen eenzelfde compartiment kunnen aandelenklassen bestaan in verschillende munten.
Netto-inventariswaarde: De netto-inventariswaarde of NIW is de prijs of koers van een fondscompartiment. De NIW wordt berekend door de waarde van alle producten waarin het fonds heeft belegd samen te tellen en te delen door het aantal uitstaande aandelen.
Rating allocatie: De kredietwaardigheid van obligaties wordt beoordeeld door onafhankelijke ratingagentschappen als Standard&Poors, BarCap & Fitch en Moody's. De aanduiding ervan gaat van hoog ('AAA' en 'AA') over medium ('A' en 'BBB') tot laag ('BB', 'B', 'CCC', 'CC' en 'C'). Investment grade obligaties (ratings 'AAA' tot 'BBB') hebben doorgaans een lager risico dan obligaties met een rating 'BB' tot 'C' die risicovolle obligaties zijn.
Rendement: Geeft weer hoe de waarde van een beleggingsfonds is gestegen (of gedaald) over de aangegeven periode. Het rendement houdt rekening met lopende kosten, maar niet met eventuele instap- en uitstapkosten en taksen.
R-Squared: Dit meet de relatie (correlatie) tussen een portefeuille en de benchmark en biedt inzicht in de vergelijkbaarheid van het rendement van de beleggingsportefeuille vs de bepaalde benchmark. Een cijfer dicht bij 1 betekent een sterke vergelijkbaarheid terwijl cijfers dicht bij nul niet vergelijkbaar zijn.
SFDR classificatie: De Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR) moet zorgen voor meer transparantie over hoe deelnemers op de financiële markt duurzaamheidsrisico's en -kansen integreren in hun beleggingsbeslissingen en aanbevelingen. Onderdeel van de SFDR is een classificatiesysteem met nieuwe informatieverplichtingen voor beleggingsproducten: Artikel 6 – producten die duurzaamheidsrisico's in het beleggingsproces implementeren. Deze fondsen promoten geen milieu-, maatschappelijke of goed bestuur kenmerken, noch hebben ze een duurzame beleggingsdoelstelling. Artikel 8 – producten die milieu- en maatschappelijke kenmerken promoten. Artikel 9 – producten die een duurzame beleggingsdoelstelling hebben.
Sharpe Ratio: De Sharpe Ratio geeft de prestatie van een fonds weer, waarbij deze gecorrigeerd wordt voor risico. Hoe hoger de Sharpe Ratio, hoe beter de voor risico gecorrigeerde prestatie van een fonds.
Standaarddeviatie: Standaarddeviatie vertelt iets over de kans dat een koers zich in een bepaalde bandbreedte zal kunnen gaan bewegen de komende periode. Bij een grote standaarddeviatie (= hoge volatiliteit) is er sprake van een brede range van mogelijke uitslagen.
Structured: Gestructureerd fonds.
Totale netto activa van een beleggingsfonds: De som van de activa onder beheer van alle aandelenklassen van een fonds.
Totale nettowaarde van beleggingen: De som van de activa onder beheer van alle aandelenklassen van een fonds.
Tracking error: De standaardafwijking van het verschil tussen de maandelijkse rendementen van een beleggingsfonds en z'n benchmark .
Transactiekosten: Dit zijn de kosten voor het kopen en verkopen van de beleggingen van het fonds. Dit is een schatting van de kosten die worden gemaakt bij het kopen en/of verkopen van de beleggingen die onderliggend zijn aan het product. Het werkelijke bedrag hangt af van de gekochte en verkochte hoeveelheid.
Type fonds: Geeft het soort fonds aan aandelenfonds, obligatiefonds, money market of geldmarktfonds, gestructureerd fonds (met een of andere vorm van kapitaalbescherming) of multi-asset of gemengd fonds.
VaR: Value at Risk berekent het maximale potentiële verlies dat een fonds over een jaarlijkse periode bij een zekerheidsniveau van 95% loopt.
Yield to Maturity: Yield to Maturity is het rendement op een obligatiebelegging als deze tot het einde van de looptijd wordt aangehouden.
Yield to Worst: Yield to Worst is het laagste rendement op een vervroegd aflosbare obligatiebelegging, zonder dat de uitgever van de obligatie in gebreke blijft en zijn verplichtingen niet nakomt.