

Goldman Sachs European ABS - Z Cap EUR

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Euribor 3 Month EUR

Morningstar Rating™

Senza rating

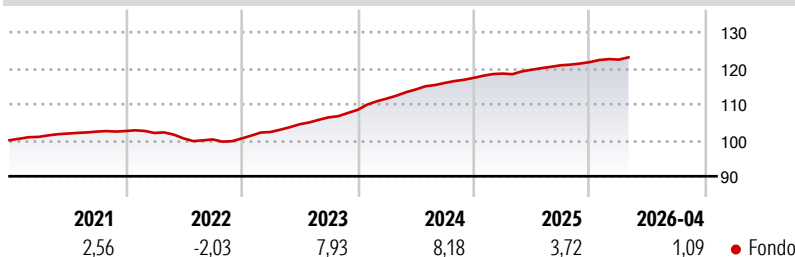
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed and aims to generate returns by predominantly investing in Euro denominated European Asset Backed Securities (ABS). ABS are debt securities where the right for interest and principal is backed by an underlying pool of assets or its revenue. The economic risks and benefits of the pool of assets are transferred, directly or indirectly, by an enterprise, financial institution or other vehicle by the means of a securitization program to the issuing party. The pools of assets will include, but will not be limited to, residential mortgages, credit card loans, student loans and lease contracts.

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|---|-----------------|------|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 3,47 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 1,02 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti



Rend. Cumulati %

| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 0,64 |
| 6-Mesi | 1,71 |
| 1-Anno | 3,93 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,07 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,96 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 11/05/2026

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------|-------|-------|-------|------|
| 2026 | 0,57 | - | - | - |
| 2025 | 1,01 | 0,90 | 1,04 | 0,73 |
| 2024 | 2,88 | 2,26 | 1,59 | 1,22 |
| 2023 | 1,80 | 2,11 | 1,83 | 1,97 |
| 2022 | -0,53 | -1,49 | -0,27 | 0,25 |

Portafoglio 28/02/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 93,04 |
| ● Liquidità | 6,96 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style

Box™

| Qualità Credito | Alto | Med | Basso |
|-----------------|------|-----|-------|
| Bassa | | | |
| Med | | | |
| Alta | | | |

Sensibilità ai Tassi

| Duration Effettiva | Fondo |
|--------------------|-------|
| Duration Effettiva | 3,14 |

| Maturità effettiva | Fondo |
|--------------------|-------|
| Maturità effettiva | - |

| Qualità Credito Media | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Qualità Credito Media | AA |

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|-------|
| AAA | 35,45 | BBB | 12,89 |
| AA | 44,24 | BB | 0,00 |
| A | 7,47 | B | 0,00 |
| | | Below B | 0,01 |
| | | Not Rated | -0,07 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| GS Liquid Euro-Z Cap EUR | - | 3,49 |
| Saecure 22 BV 2.438% | - | 2,33 |
| Aqueduct European Clo 4 -... | - | 1,52 |
| Penta Clo 2021-2 Designated... | - | 1,52 |
| Domi 2026-1 BV 2.62534% | - | 1,47 |
| Candide Financing 2021-1 BV... | - | 1,43 |
| Fortuna Consumer Loan ABS... | - | 1,37 |
| Armada Euro Clo IV... | - | 1,31 |
| Penta CLO 7 Designated... | - | 1,31 |
| Voya Euro CLO VIII... | - | 1,31 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 17,06 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 211 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|----------------------------|-------|
| 🏠 Governativo | 0,00 |
| ⚙️ Societario | 0,02 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 93,04 |
| 🏠 Enti Locali | 0,00 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 6,92 |
| 🏠 Derivati | 0,01 |

Coupon Range %

| Range | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 71,38 |
| Da 4 a 6 cedole | 25,77 |
| Da 6 a 8 cedole | 2,86 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| Scadenza | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 0,00 |
| da 3 a 5 | 0,18 |
| da 5 a 7 | 2,97 |
| da 7 a 10 | 11,34 |
| da 10 a 15 | 68,42 |
| da 15 a 20 | 3,37 |
| da 20 a 30 | 1,34 |
| oltre 30 | 12,38 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 395,54 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 0,06% |
| Data di Partenza | 10/12/2018 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,06% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 31/10/2025 | ISIN | LU1900228898 | | |
| NAV (11/05/2026) | EUR 6.581,26 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 600,17 EUR | | | | |

(28/02/2026)