

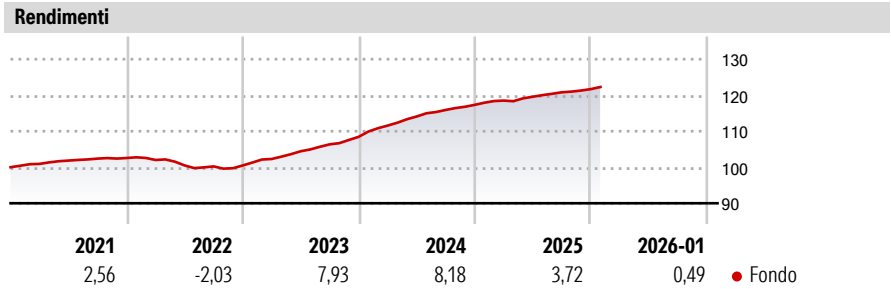
Goldman Sachs European ABS - Z Cap EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Altro	Not Categorized Usato nel Report	Euribor 3 Month EUR	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.

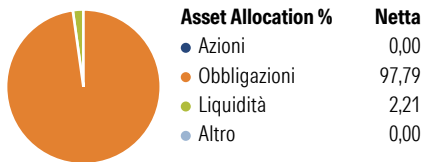
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	3,86
3Y Beta	-	3Y Std Dev	0,98
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,08	2026	-	-	-	-
6-Mesi	1,90	2025	1,01	0,90	1,04	0,73
1-Anno	3,64	2024	2,88	2,26	1,59	1,22
3-Anni Ann.ti	6,40	2023	1,80	2,11	1,83	1,97
5-Anni Ann.ti	4,01	2022	-0,53	-1,49	-0,27	0,25
10-Anni Ann.ti	-					

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	0,16
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	AA

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
AAA	39,54	BBB	12,00
AA	40,91	BB	0,00
A	7,54	B	0,00
		Below B	0,00
		Not Rated	0,00

Titoli principali		
Nome	Settore	%
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	—	3,00
Saecure 22 BV 2.472%	—	2,26
Fortuna Consumer Loan ABS...	—	1,57
Penta Clo 2021-2 Designated...	—	1,45
Aqueduct European Clo 4 -...	—	1,44
Sound Point Euro Clo IV...	—	1,43
Candide Financing 2021-1 BV...	—	1,40
Nassau Euro CLO IV DAC 3.494%	—	1,28
Jubilee Clo 2014-XII...	—	1,28
Armada Euro Clo IV...	—	1,25
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		16,36
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		219

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,58
Cartolarizzazioni	97,22
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	2,21
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	3,17
Da 0 a 4 cedole	72,00
Da 4 a 6 cedole	21,09
Da 6 a 8 cedole	3,74
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,05
da 5 a 7	3,25
da 7 a 10	12,40
da 10 a 15	70,10
da 15 a 20	3,55
da 20 a 30	1,28
oltre 30	9,26

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	402,12 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.	-
Data di Partenza	10/12/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,06%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	10/12/2018	ISIN	LU1900228898		
NAV (09/02/2026)	EUR 6.537,80				
Patrimonio Netto (Mln)	630,15 EUR				

(30/11/2025)