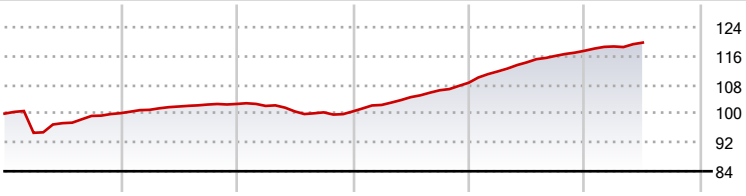
Goldman Sachs European ABS - Z Cap EUR

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.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-06	
0,12	2,56	-2,03	7,93	8,18	1,92	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	2,58
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,40
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,86
6-Mesi	1,92
1-Anno	4,74
3-Anni Ann.ti	6,03
5-Anni Ann.ti	4,22
10-Anni Ann.ti	-

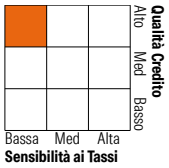
Rendimenti aggiornati al 01/07/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	1,01	0,90	-	-
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
2021	0,93	0,91	0,54	0,16

Portafoglio 30/04/2025

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	89,40
● Liquidità	10,60
● Altro	0,00

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	0,14
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	AA

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
AAA	52,05	BBB	10,74
AA	29,42	BB	0,00
A	7,29	B	0,00
		Below B	0,00
		Not Rated	0,50

Titoli principali

Nome	Settore	%
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	—	9,44
Saecure 22 BV 2.561%	—	2,45
Fortuna Consumer Loan ABS...	—	1,75
Candide Financing 2021-1 BV...	—	1,56
Pony S.A. 2.871%	—	1,54
Aqueduct European Clo 4 -...	—	1,50
Sound Point Euro Clo IV...	—	1,48
SC Germany SA Compartment...	—	1,44
Nassau Euro CLO IV DAC 3.726%	—	1,33
Jubilee Clo 2014-XII...	—	1,32
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		23,81
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		191

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	89,40
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	10,60
Derivati	0,01

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,56
Da 0 a 4 cedole	60,59
Da 4 a 6 cedole	33,99
Da 6 a 8 cedole	4,24
Da 8 a 10 cedole	0,62
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,12
da 5 a 7	4,43
da 7 a 10	21,43
da 10 a 15	55,30
da 15 a 20	6,08
da 20 a 30	1,67
oltre 30	10,97

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	10/12/2018
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	10/12/2018
NAV (01/07/2025)	EUR 6.387,79
Patrimonio Netto (MIn) (30/04/2025)	603,48 EUR
Patrimonio Classe (MIn) (01/07/2025)	406,54 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1900228898
Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,06%
Commissione di incentivo	-

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.