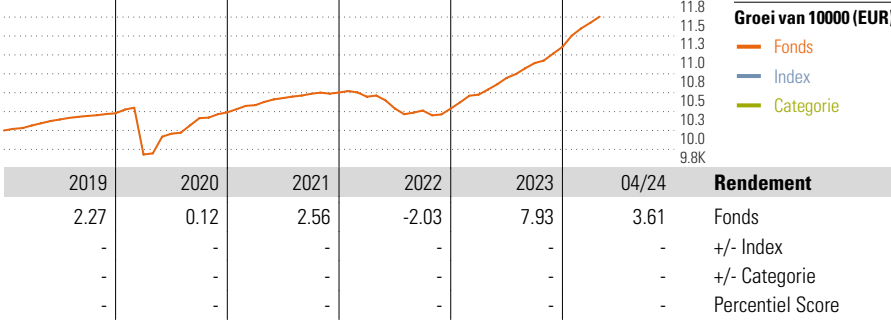


Goldman Sachs European ABS - Z Cap EUR

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Euribor 3 Month EUR	—	Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

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,...



Risicomaatstaven				Rendementen (17 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	1.48	3 Maanden	2.11	-	-	2024	2.88	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	1.82	6 Maanden	5.26	-	-	2023	1.80	2.11	1.83	1.97
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	9.10	-	-	2022	-0.53	-1.49	-0.27	0.25
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	3.59	-	-	2021	0.93	0.91	0.54	0.16
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	2.69	-	-	2020	-5.33	2.84	2.07	0.76

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™			Kredietkwaliteit																	
Aandelen	0.00	0.00	0.00	<table><tr><td></td><td></td><td></td><td rowspan="4">Kredietkwaliteit</td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td>Laag</td><td>Gem</td><td>Hoog</td><td></td></tr></table>				Kredietkwaliteit											Laag	Gem	Hoog		Tijdsduur	-
			Kredietkwaliteit																					
	Laag	Gem	Hoog																					
Obligaties	96.77	0.00	96.77		Effectieve Looptijd	-																		
Kas/ geldmarkt	23.29	20.05	3.23		Gem Krediet	-																		
Overig	0.00	0.00	0.00		Kwaliteit	-																		
				Rentegevoeligheid																				

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	4.54	1 tot 3 jaar	0.00	0% PIK	0.67
Miravet S.A.R.L. 5.445%2065-05-26	1.86	3 tot 5 jaar	0.49	0% tot 4%	1.57
Hops Hill No. 3 PLC 8.69042%2055-12-21	1.84	5 tot 7 jaar	8.37	4% tot 6%	47.01
Precise Mortgage Funding 2019-1B PLC...	1.73	7 tot 10 jaar	20.06	6% tot 8%	35.50
Together Asset Backed Securitisation...	1.71	10 tot 15 jaar	21.12	8% tot 10%	11.85
FT Santander Consumer Spain Auto 2023-1...	1.69	15 tot 20 jaar	11.70	10% tot 12%	3.40
Dutch Property Finance 2022-1 B.V....	1.59	20 tot 30 jaar	7.13	Meer dan 12%	0.00
TAGUS - Sociedade de Titularizacao de...	1.59	Meer dan 30 jaar	31.14		
Contego CLO XI DAC 10.233%2035-12-20	1.59				
Primrose Residential 2021-1 Designated...	1.54				
Totaal Aantal Aandelen	0				
Totaal Aantal Obligaties	108				
% Van Vermogen In Top 10 Posities	19.68				

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	10 dec 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Wouter Van Der Grinten	ISIN	LU1900228898		
Aanvangsdatum	10 dec 2018				
Koers (17 mei 2024)	EUR 6,025.18				
Fondsvermogen (mln)	EUR 70.29				