

Enhanced Index Sustainable Equity Fund (NL) - T

Morningstar Categorie Index

Morningstar Global Target Market
Exposure NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

MSCI World NR

Morningstar Rating™

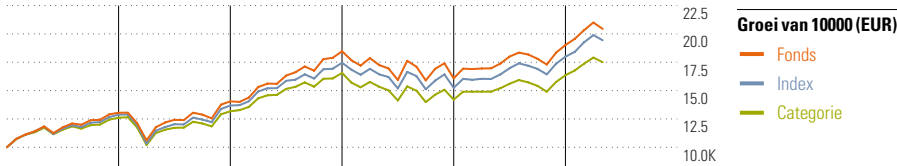
★★★★

Morningstar Categorie™

Aandelen Wereldwijd Large Cap
Gemengd

Beleggingsdoelstelling

Het fonds heeft het doel, voor rekening en risico van de participanten, de waardeontwikkeling van de MSCI World EUR Net Total Return Index (benchmark), te volgen, door wereldwijd te beleggen in aandelen van bedrijven die deel uitmaken van de benchmark en een bovengemiddelde score hebben op het gebied van milieu, samenleving en corporate governance (ook wel aangeduid met de Engelse afkorting 'ESG' wat staat voor Environmental, Social and Governance). De MSCI World EUR Net Total Return Index is een wereldwijde index...



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
	30.47	7.69	31.45	-12.95	18.30	7.47	Fonds
	1.71	1.43	3.88	-0.28	0.30	-0.61	+/- Index
	4.38	3.00	5.60	1.26	2.85	0.42	+/- Categorie
	18	26	21	38	33	47	Percentiel Score

Risicomaatstaven

Alpha	0.79	Sharpe Ratio	0.61
Beta	1.04	Std Deviatie	14.19
R-kwadraat	98.98	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.45	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	1.82	10-jr Risico	Gem

Berekeningen met Morningstar Global TME NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (30 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.99	-0.43	0.26
6 Maanden	14.10	-0.53	0.75
1 jaar	20.03	-1.29	2.82
3 jr gean.	10.13	0.72	3.05
5 jr gean.	12.96	0.71	2.87

Kwartaalrendementen

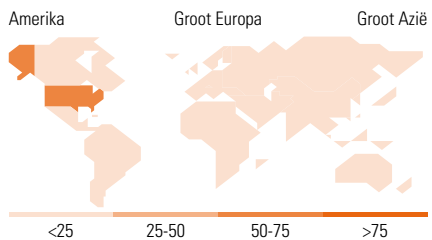
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	10.41	-	-	-
2023	5.42	6.19	-1.09	6.84
2022	-3.28	-10.79	-0.24	1.13
2021	9.00	6.59	2.64	10.23
2020	-18.66	17.07	3.67	9.09

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	98.61	0.00	98.61
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	2.18	1.89	0.29
Overig	1.11	0.01	1.10

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	42.91
Groot	35.58
Midden	21.14
Klein	0.36
Micro	0.00
Gem Mkt Cap (mIn)	EUR 124907



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Microsoft Corp	Software	4.78
Apple Inc	Software	4.55
NVIDIA Corp	Software	3.24
Amazon.com Inc	Software	2.66
Alphabet Inc Class A	Software	1.35
Alphabet Inc Class C	Software	1.31
Eli Lilly and Co	Pharmaceuticals	1.08
Broadcom Inc	Software	1.04
JPMorgan Chase & Co	Banking	0.96
Tesla Inc	Automotive	0.89
Totaal Aantal Aandelen		737
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		21.86

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	32.16
Basismaterialen	3.70
Cyclische consumentenproducten	10.09
Financiële dienstverlening	15.60
Vastgoed	2.77
Licht Cyclisch	47.01
Communicatiediensten	7.31
Energie	2.30
Industrie	10.07
Technologie	27.33
Defensief	20.84
Defensieve consumptiegoederen	6.78
Gezondheidszorg	12.57
Nutsbedrijven	1.48

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	74.40
Verenigde Staten	70.17
Canada	4.07
Latijns Amerika	0.16
Groot Europa	16.13
Verenigd Koninkrijk	3.33
West Europa – Euro	7.28
West Europa – Niet Euro	5.31
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.20
Groot Azië	9.47
Japan	6.58
Australazië	1.75
Azië - Ontwikkeld	1.13
Azië - Emerging	0.02

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	27 apr 2011	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Paul Vrouwes	ISIN	NL0009712488		
Aanvangsdatum	1 jan 2018				
Koers (30 mei 2024)	EUR 4,202.61				
Fondsvermogen (mIn)	EUR 314.62				