

# Goldman Sachs Enhanced Index Sustainable Equity Fund A (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

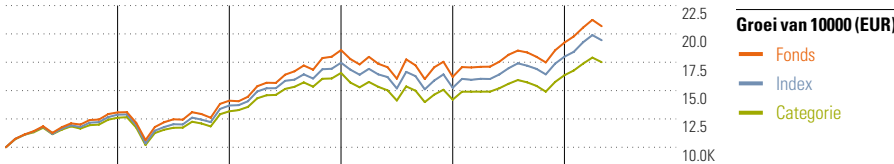
### Beleggingsdoelstelling

Het fonds is een financieel product met duurzame beleggingsdoelstellingen zoals beschreven in artikel 9 van de EU verordening betreffende informatieverstrekking over duurzaamheid in de financiële dienstensector. Het fonds wordt actief beheerd en belegt wereldwijd. Het fonds streeft naar een risico-opbrengst profiel in lijn met de Index, MSCI World (NR). Tegelijkertijd worden duurzaamheidscriteria toegepast met als doel het duurzaamheidsprofiel te verhogen ten opzichte van de index door een positieve selectie op basis...

### Risicomaatstaven

|                  |       |              |         |
|------------------|-------|--------------|---------|
| Alpha            | 1.02  | Sharpe Ratio | 0.63    |
| Beta             | 1.03  | Std Deviatie | 14.16   |
| R-kwadraat       | 99.00 | 3-jr Risico  | Bov gem |
| Informatie Ratio | 0.59  | 5-jr Risico  | Gem     |
| Tracking Error   | 1.79  | 10-jr Risico | -       |

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



|                  | 2019  | 2020 | 2021  | 2022   | 2023  | 04/24 | Rendement     |
|------------------|-------|------|-------|--------|-------|-------|---------------|
| Fonds            | 30.77 | 7.89 | 31.63 | -12.73 | 18.65 | 7.53  | Fonds         |
| Index            | 2.00  | 1.63 | 4.06  | -0.06  | 0.65  | -0.55 | +/- Index     |
| Categorie        | 4.68  | 3.21 | 5.78  | 1.48   | 3.20  | 0.48  | +/- Categorie |
| Percentiel Score | 16    | 24   | 19    | 35     | 30    | 46    |               |

### Rendementen (16 mei 2024)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | 5.07   | -0.39  | 0.26   |
| 6 Maanden  | 16.95  | -0.01  | 0.93   |
| 1 jaar     | 24.14  | 0.79   | 3.92   |
| 3 jr gean. | 11.11  | 0.92   | 3.04   |
| 5 jr gean. | 12.95  | 1.09   | 3.01   |

### Kwartaalrendementen

|      | 1e kw  | 2e kw  | 3e kw | 4e kw |
|------|--------|--------|-------|-------|
| 2024 | 10.41  | -      | -     | -     |
| 2023 | 5.48   | 6.22   | -1.02 | 6.99  |
| 2022 | -3.21  | -10.71 | -0.19 | 1.17  |
| 2021 | 9.03   | 6.64   | 2.67  | 10.27 |
| 2020 | -18.66 | 17.20  | 3.75  | 9.08  |

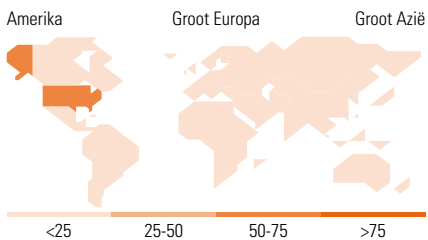
### Portefeuille 29 feb 2024

#### Assetverdeling

|                | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 98.33  | 0.00    | 98.33   |
| Obligaties     | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Kas/ geldmarkt | 2.18   | 1.93    | 0.25    |
| Overig         | 1.44   | 0.01    | 1.42    |

#### Morningstar Aandelen Style Box™

|                   | % Aand     |
|-------------------|------------|
| Zeer Groot        | 42.77      |
| Groot             | 35.61      |
| Midden            | 21.26      |
| Klein             | 0.36       |
| Micro             | 0.00       |
| Gem Mkt Cap (mln) | EUR 124942 |



#### Top 10 Onderliggende posities

|                                   | Sector         | % Port |
|-----------------------------------|----------------|--------|
| Microsoft Corp                    | Software       | 4.77   |
| Apple Inc                         | Technologie    | 4.55   |
| NVIDIA Corp                       | Technologie    | 3.24   |
| Amazon.com Inc                    | Handel         | 2.66   |
| Alphabet Inc Class A              | Technologie    | 1.34   |
| Alphabet Inc Class C              | Technologie    | 1.31   |
| Eli Lilly and Co                  | Geneesmiddelen | 1.08   |
| Broadcom Inc                      | Technologie    | 1.04   |
| JPMorgan Chase & Co               | Bank           | 0.96   |
| Tesla Inc                         | Automobilie    | 0.89   |
| Totaal Aantal Aandelen            |                | 735    |
| Totaal Aantal Obligaties          |                | 0      |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities |                | 21.83  |

#### Sectorverdeling

|                                | % Aand       |
|--------------------------------|--------------|
| <b>Cyclisch</b>                | <b>31.95</b> |
| Basismaterialen                | 3.72         |
| Cyclische consumentenproducten | 9.87         |
| Financiële dienstverlening     | 15.59        |
| Vastgoed                       | 2.77         |
| <b>Licht Cyclisch</b>          | <b>47.13</b> |
| Communicatiediensten           | 7.35         |
| Energie                        | 2.30         |
| Industrie                      | 10.10        |
| Technologie                    | 27.38        |
| <b>Defensief</b>               | <b>20.92</b> |
| Defensieve consumptiegoederen  | 6.78         |
| Gezondheidszorg                | 12.63        |
| Nutsbedrijven                  | 1.50         |

#### Regioverdeling

|                         | % Aand       |
|-------------------------|--------------|
| <b>Amerika</b>          | <b>74.56</b> |
| Verenigde Staten        | 70.34        |
| Canada                  | 4.07         |
| Latijns Amerika         | 0.16         |
| <b>Groot Europa</b>     | <b>15.91</b> |
| Verenigd Koninkrijk     | 3.31         |
| West Europa – Euro      | 7.10         |
| West Europa – Niet Euro | 5.29         |
| Emerging Europa         | 0.00         |
| Midden-Oosten / Afrika  | 0.20         |
| <b>Groot Azië</b>       | <b>9.53</b>  |
| Japan                   | 6.61         |
| Australazië             | 1.76         |
| Azië - Ontwikkeld       | 1.14         |
| 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    | 15 jan 2018            | Inc/Acc        | Inc          |                    |   |
| Fondsmanager        | Not Disclosed          | ISIN           | NL0012727416 |                    |   |
| Aanvangsdatum       | 16 jan 2017            |                |              |                    |   |
| Koers (16 mei 2024) | EUR 3,430.24           |                |              |                    |   |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 4.56               |                |              |                    |   |