

Goldman Sachs North America Enhanced Index Sustainable Equity - Z Cap EUR

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Large-Mid Cap NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

MSCI North America NR EUR

Morningstar Rating™

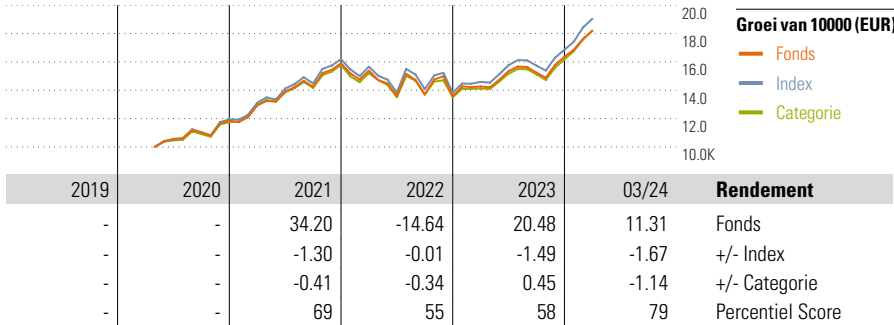
★★★

Morningstar Categorie™

Aandelen VS Large Cap Gemengd

Beleggingsdoelstelling

The actively managed Sub-Fund aims for a risk and return profile in line with that of the index. The Sub-Fund invests predominantly in a diversified portfolio comprised of equities and/or other Transferable Securities (including preference shares) issued by companies domiciled, established, listed or operating in North America.



Risicomaatstaven

Alpha	-1.02	Sharpe Ratio	0.75
Beta	1.00	Std Deviatie	15.24
R-kwadraat	99.44	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.85	5-jr Risico	-
Tracking Error	1.33	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar US LM NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (15 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	7.45	-1.92	-2.65
6 Maanden	14.74	-1.87	-2.21
1 jaar	25.34	-3.45	-2.84
3 jr gean.	9.97	-1.25	-1.16
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

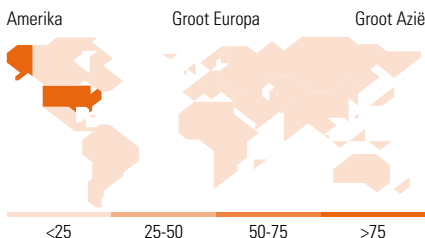
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	11.31	-	-	-
2023	5.10	7.57	-0.75	7.37
2022	-3.27	-11.53	0.69	-0.94
2021	9.12	7.60	2.33	11.70
2020	-	-	4.54	7.31

Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	99.76	0.00	99.76
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	0.29	0.05	0.24
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	42.59
Groot	33.62
Midden	23.28
Klein	0.51
Micro	0.00
Gem Mkt Cap (mIn)	USD 183744



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Apple Inc	Computer	6.55
Microsoft Corp	Computer	6.43
NVIDIA Corp	Computer	3.56
Amazon.com Inc	Computer	3.32
Alphabet Inc Class A	Computer	1.95
Alphabet Inc Class C	Computer	1.85
JPMorgan Chase & Co	Bank	1.30
Eli Lilly and Co	Pharmaceutical	1.29
Broadcom Inc	Computer	1.26
Tesla Inc	Automotive	1.21
Totaal Aantal Aandelen		400
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		28.70

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	30.38
Basismaterialen	3.28
Cyclische consumentenproducten	10.42
Financiële dienstverlening	14.28
Vastgoed	2.40
Licht Cyclisch	49.23
Communicatiediensten	7.95
Energie	2.43
Industrie	7.39
Technologie	31.46
Defensief	20.40
Defensieve consumptiegoederen	6.83
Gezondheidszorg	12.63
Nutsbedrijven	0.93

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	99.19
Verenigde Staten	92.99
Canada	5.95
Latijns Amerika	0.26
Groot Europa	0.76
Verenigd Koninkrijk	0.34
West Europa – Euro	0.00
West Europa – Niet Euro	0.43
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.04
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.04
Azië - Emerging	0.00

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	5 mei 2020	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	-	ISIN	LU2163089720		
Aanvangsdatum					
Koers (15 apr 2024)	EUR 899,874.01				
Fondsvermogen (mIn)	USD 811.99				