

# Goldman Sachs AAA ABS - Z Cap EUR

## Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

## Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Bloomberg Euro Floating AAA ABS TR EUR

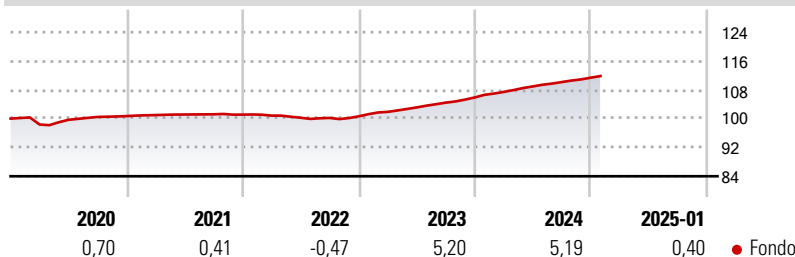
## Morningstar Rating™

Senza rating

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The aim of this Sub-Fund, which is actively managed, is to invest predominantly in Asset Backed Securities ('ABS') with the highest possible credit rating assigned by independent rating organisations such as Standard & Poors, Moody's and Fitch.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |   |                 |      |
|-------------------|---|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | - | 3Y Sharpe Ratio | 1,66 |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | 0,96 |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | -    |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | -    |

### Rend. Cumulati %

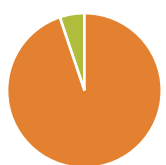
| Periodo        | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi         | 1,13  |
| 6-Mesi         | 2,22  |
| 1-Anno         | 4,98  |
| 3-Anni Ann.ti  | 3,41  |
| 5-Anni Ann.ti  | 2,23  |
| 10-Anni Ann.ti | 1,25  |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Rendimenti

| Periodo       | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % |       |       |       |       |
| 2025          | -     | -     | -     | -     |
| 2024          | 1,46  | 1,42  | 1,11  | 1,10  |
| 2023          | 1,23  | 1,21  | 1,29  | 1,38  |
| 2022          | -0,28 | -0,57 | -0,06 | 0,45  |
| 2021          | 0,28  | 0,16  | 0,06  | -0,09 |

### Portafoglio 30/11/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 0,00  |
| ● Obbligazioni     | 94,83 |
| ● Liquidità        | 5,17  |
| ● Altro            | 0,00  |

### Fixed Income

#### Style Box™

| Quantità Credito |       | Sensibilità ai Tassi |
|------------------|-------|----------------------|
| Alto             | Basso |                      |
|                  |       | Bassa                |
|                  |       | Med                  |
|                  |       | Alta                 |

| Duration Effettiva    | Fondo |
|-----------------------|-------|
|                       | -     |
| Maturità effettiva    | Fondo |
|                       | -     |
| Qualità Credito Media | Fondo |
|                       | -     |

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|------|------------------|------|
|                  | o    |                  | o    |

### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| GS Liquid Euro-Z Cap EUR                    | -       | 4,62  |
| BPCE Consumer Loans FCT 2024...             | -       | 2,10  |
| Fact SA acting in respect of...             | -       | 2,01  |
| Cars Alliance Auto Loans...                 | -       | 1,80  |
| Bumper NL 2020-1 BV 3.675%                  | -       | 1,78  |
| Rockford Tower Europe Clo...                | -       | 1,74  |
| Blackrock European CLO X...                 | -       | 1,68  |
| Hill FL 2024-2 B.V. 3.803%                  | -       | 1,64  |
| RRE 1 Loan Management DAC...                | -       | 1,56  |
| BL Consumer Issuance...                     | -       | 1,56  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 20,49 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 114   |

### Fixed Income Sector Weightings %

| Settore                    | Fondo |
|----------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo             | 0,00  |
| ⚙️ Societario              | 2,56  |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 92,28 |
| 👤 Enti Locali              | 0,00  |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 5,13  |
| 📄 Derivati                 | 0,04  |
| Coupon Range %             | Fondo |
| 0 coupon                   | 1,08  |
| Da 0 a 4 cedole            | 49,84 |
| Da 4 a 6 cedole            | 45,84 |
| Da 6 a 8 cedole            | 1,75  |
| Da 8 a 10 cedole           | 0,00  |
| Da 10 a 12 cedole          | 1,50  |
| Oltre 12 cedole            | 0,00  |

### Scadenze %

| Periodo    | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 0,00  |
| da 3 a 5   | 1,37  |
| da 5 a 7   | 7,76  |
| da 7 a 10  | 20,26 |
| da 10 a 15 | 36,84 |
| da 15 a 20 | 7,09  |
| da 20 a 30 | 2,06  |
| oltre 30   | 24,63 |

### Anagrafica

|                        |                                     |                         |              |                              |               |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione    | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,01 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 5.000.000 EUR |
| Telefono               | +31-703781781                       | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -             |
| Web                    | https://www.gsam.com                | Valuta del Fondo        | EUR          | T.E.R.                       | 0,06%         |
| Data di Partenza       | 07/10/2013                          | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,06%         |
| Nome del Gestore       | -                                   | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -             |
| Data Inizio Gestione   | 01/08/2014                          | ISIN                    | LU0939624606 |                              |               |
| NAV (04/02/2025)       | EUR 5.757,07                        |                         |              |                              |               |
| Patrimonio Netto (Mln) | 665,65 EUR                          |                         |              |                              |               |

(30/11/2024)