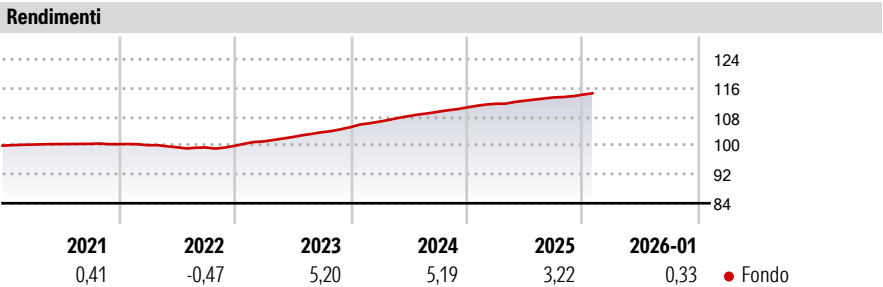


Goldman Sachs AAA ABS - Z Cap EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Altro	Not Categorized Usato nel Report	Bloomberg Euro Floating AAA ABS TR EUR	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.

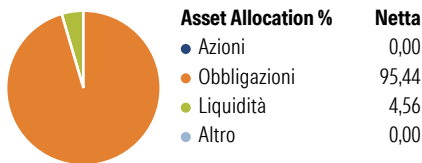


Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	3,86
3Y Beta	-	3Y Std Dev	0,45
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,82	2026	-	-	-	-
6-Mesi	1,55	2025	0,93	0,76	0,81	0,67
1-Anno	3,12	2024	1,46	1,42	1,11	1,10
3-Anni Ann.ti	4,41	2023	1,23	1,21	1,29	1,38
5-Anni Ann.ti	2,74	2022	-0,28	-0,57	-0,06	0,45
10-Anni Ann.ti	1,57					

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-		o		o
Maturity effettiva	-				
Qualità Credito Media					
Qualità Credito					
Sensibilità ai Tassi					

Titoli principali		
Nome	Settore	%
GS Liquid Euro-Z Cap EUR	—	3,62
Firstmac Mortgage Funding...	—	2,49
Cars Alliance Auto Loans...	—	2,10
Weser Funding S.A. 2.596%	—	1,95
Bumper NL 2020-1 BV 2.559%	—	1,94
Rockford Tower Europe Clo...	—	1,81
BL Consumer Issuance...	—	1,81
Delphinus 2025-I BV 2.519%	—	1,79
Fact SA acting in respect of...	—	1,68
Arini European Clo L...	—	1,59
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		20,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		119

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Scadenze %	Fondo
Governativo	0,00	da 1 a 3	0,00
Societario	0,12	da 3 a 5	0,70
Cartolarizzazioni	95,32	da 5 a 7	5,84
Enti Locali	0,00	da 7 a 10	21,95
Liquidità ed equivalenti	4,51	da 10 a 15	33,85
Derivati	0,05	da 15 a 20	5,99
		da 20 a 30	4,58
		oltre 30	26,97
Coupon Range %	Fondo		
0 coupon	0,26		
Da 0 a 4 cedole	75,59		
Da 4 a 6 cedole	22,61		
Da 6 a 8 cedole	0,00		
Da 8 a 10 cedole	1,54		
Da 10 a 12 cedole	0,00		
Oltre 12 cedole	0,00		

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	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	07/10/2013	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,06%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/08/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (11/02/2026)	EUR 5.941,18	ISIN	LU0939624606		
Patrimonio Netto (Mln)	572,85 EUR				

(30/11/2025)