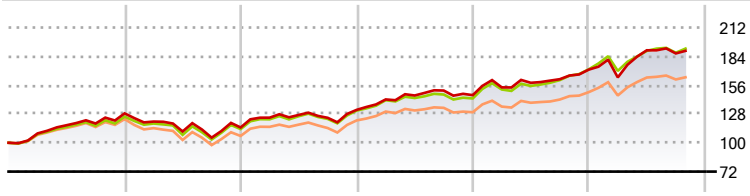
Goldman Sachs Europe Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Azionari Europa Large Cap Blend	Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR Usato nel Report	MSCI Europe NR EUR	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund was launched on 30 September 2019. Investment objective and policy The Sub-Fund is actively managed and aims for a risk and return comparable to the risk and return profile of the Index of the Company's Prospectus. The Sub-Fund also integrates ESG criteria aimed at achieving an enhanced sustainability profile compared to that of the Index. The Investment Manager determines the Sub-Fund's overall portfolio construction in line with its investment strategy on a quarterly basis. 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 Europe.

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	28,55	-10,64	14,93	10,81	16,96	10,66
Benchmark e Indici	25,42	-9,67	15,89	8,98	19,78	11,75
Categoria	22,95	-13,22	14,23	6,85	15,33	9,70

Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,69	3Y Sharpe Ratio	1,18
3Y Beta	1,08	3Y Std Dev	11,21
3Y R-Squared	94,84	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,29	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,68	10Y Risk	-

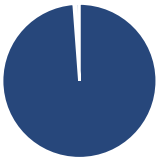
Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-3,46	-3,61	-2,85
6-Mesi	2,12	1,79	2,77
1-Anno	13,43	13,52	12,92
3-Anni Ann.ti	13,42	14,02	12,30
5-Anni Ann.ti	7,62	8,27	6,31
10-Anni Ann.ti	-	-	-

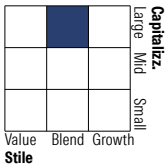
Rendimenti aggiornati al 20/11/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-4,43	16,10	-1,60	-
2025	5,17	2,89	2,21	5,76
2024	7,66	2,68	3,30	-2,96
2023	8,32	2,10	-2,17	6,23
2022	-6,18	-7,95	-5,43	9,40

Portafoglio 31/08/2026

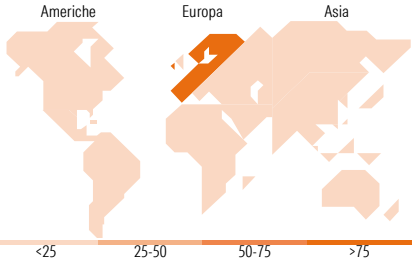


Asset Allocation %	Netta
Azioni	98,82
Obbligazioni	0,00
Liquidità	0,49
Altro	0,69



Mkt Cap %	Fondo
Giant	48,16
Large	31,87
Medium	19,85
Small	0,12
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap EUR	61.850,02



Titoli principali

Nome	Settore	%
ASML Holding NV		4,35
HSBC Holdings PLC		2,80
Novartis AG Registered Shares		2,38
Siemens AG		2,36
Roche Holding AG Ordinary...		2,26
Allianz SE		2,00
SAP SE		1,90
Nestle SA		1,87
Schneider Electric SE		1,84
AstraZeneca PLC		1,81
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		23,58
Numero Complessivo di Titoli Azionari		254
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	**39,74**
Materie Prime	4,22
Beni di Consumo Ciclici	6,83
Finanza	27,08
Immobiliare	1,61
Sensibile	**35,61**
Telecomunicazioni	5,00
Energia	-
Beni Industriali	20,48
Tecnologia	10,13
Difensivo	**24,65**
Beni Difensivi	7,07
Salute	14,10
Servizi di Pubblica Utilità	3,48

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**2,46**
Stati Uniti	2,37
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,09
Europa	**96,97**
Regno Unito	19,90
Europa Occidentale - Euro	52,50
Europa Occidentale - Non Euro	24,53
Europa dell'Est	0,04
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,57**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,57
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln) (20/11/2026)	349,21 EUR	Investimento Min. Ingresso	250 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	01/10/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,19%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

Goldman Sachs Europe Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap EUR

Data Inizio Gestione	01/10/2019	ISIN	LU2037300550
NAV (20/11/2026)	EUR 9.627,40		
Patrimonio Netto (MIn) (31/08/2026)	606,30 EUR		

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR