

Goldman Sachs US Small Cap CORE Equity Portfolio Base Acc USD Close

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Small Cap
Extended NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Russell 2000 NR USD

Morningstar Rating™

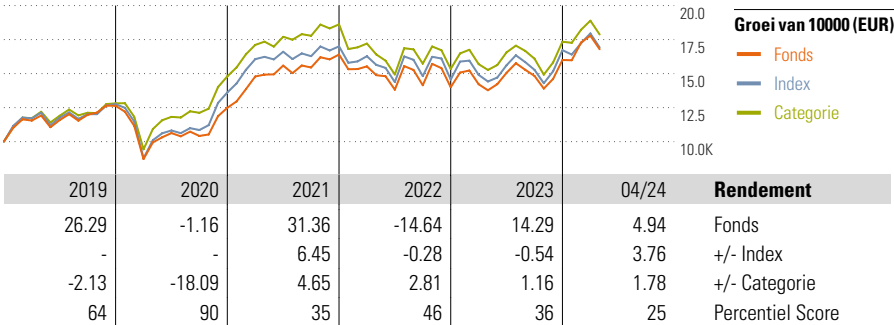
★★★

Morningstar Categorie™

Aandelen VS Small Cap

Beleggingsdoelstelling

De Goldman Sachs US Small Cap CORESM Equity Portefeuille belegt in effecten van Amerikaanse bedrijven die relatief klein zijn in marktkapitalisatie, d.w.z. bedrijven met een marktkapitalisatie die op het moment dat de belegging van de Portefeuille wordt gedaan niet hoger ligt dan die van het grootste bedrijf in de Russel 2500 Index.



Risicomaatstaven

Alpha	2.36	Sharpe Ratio	0.23
Beta	0.97	Std Deviatie	19.08
R-kwadraat	97.71	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	0.77	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	3.25	10-jr Risico	Gem

Berekeningen met Morningstar US Small Extended NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	4.69	2.07	2.43
6 Maanden	20.63	3.60	2.48
1 jaar	24.23	4.31	3.77
3 jr gean.	5.95	2.59	1.66
5 jr gean.	8.81	0.36	-0.79

Kwartaalrendementen

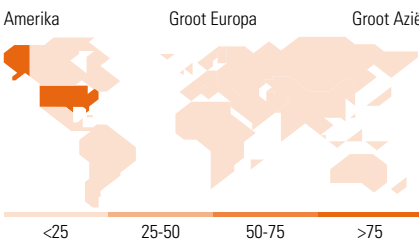
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	11.15	-	-	-
2023	1.56	5.90	-1.53	7.91
2022	-5.30	-11.03	2.36	-1.01
2021	18.45	5.42	-0.91	6.16
2020	-30.97	21.92	-2.03	19.88

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	98.78	0.00	98.78
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	2.28	1.06	1.22
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	0.00
Groot	1.92
Midden	5.73
Klein	49.15
Micro	43.20
Gem Mkt Cap (mln)	USD 2633



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Super Micro Computer Inc	Computer	1.88
CME...	—	1.06
Comfort Systems USA Inc	Industrie	1.04
MicroStrategy Inc Class A	Computer	0.89
HealthEquity Inc	Gezondheidszorg	0.87
Ryman Hospitality Properties Inc	Horeca	0.83
Atkore Inc	Industrie	0.82
M/I Homes Inc	Woningbouw	0.79
ExlService Holdings Inc	Computer	0.77
Parsons Corp	Industrie	0.77
Totaal Aantal Aandelen		475
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van vermogen in top 10 posities		9.73

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	39.42
Basismaterialen	3.77
Cyclische consumentenproducten	13.29
Financiële dienstverlening	14.01
Vastgoed	8.35
Licht Cyclisch	42.44
Communicatiediensten	1.28
Energie	6.95
Industrie	13.77
Technologie	20.45
Defensief	18.13
Defensieve consumptiegoederen	3.74
Gezondheidszorg	13.14
Nutsbedrijven	1.26

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	98.85
Verenigde Staten	96.90
Canada	0.58
Latijns Amerika	1.37
Groot Europa	0.22
Verenigd Koninkrijk	0.00
West Europa – Euro	0.10
West Europa – Niet Euro	0.00
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.12
Groot Azië	0.93
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.00
Azië - Emerging	0.93

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	1.25%
Oprichtingsdatum	5 dec 2005	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Len Ioffe	ISIN	LU0234576444		
Aanvangsdatum	1 jan 2011				
Koers (17 mei 2024)	USD 34.45				
Fondsvermogen (mln)	USD 121.39				