

Goldman Sachs Global Absolute Return Portfolio R Acc EUR-Hedged

Categoria Morningstar™

Alt - Global Macro

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

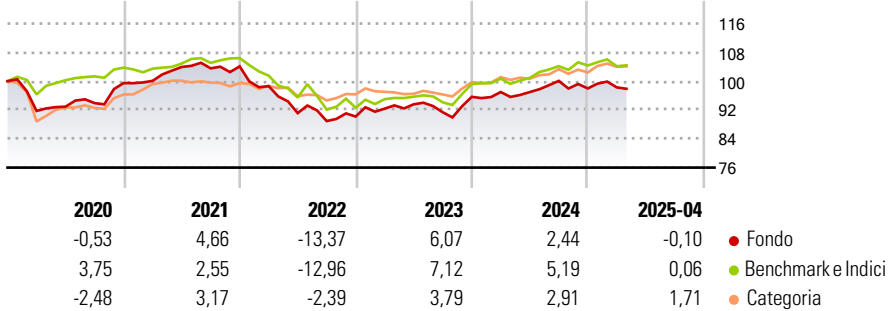
The Portfolio will seek to achieve absolute returns over a rolling three-year period from a portfolio of investments in equity, equity-related securities, fixed income securities, fixed income-related securities, and financial derivative or other instruments on interest rates, credit, currencies and commodity indices, and other Permitted Investments. Absolute returns are not guaranteed.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,22	3Y Sharpe Ratio	-0,29
3Y Beta	0,85	3Y Std Dev	5,81
3Y R-Squared	83,36	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,45	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,51	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-0,66	-0,78	0,28
6-Mesi	0,69	1,27	2,07
1-Anno	3,49	4,92	4,99
3-Anni Ann.ti	1,00	1,99	0,67
5-Anni Ann.ti	1,31	1,21	2,04
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 02/05/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	0,29	-	-	-
2024	1,39	-0,01	3,21	-2,10
2023	2,43	1,31	-2,35	4,68
2022	-5,26	-7,61	-2,42	1,42
2021	0,62	3,85	-0,36	0,52

Portafoglio 30/06/2024



Asset Allocation %

● Azioni	7,19
● Obbligazioni	1,62
● Liquidità	90,92
● Altro	0,27

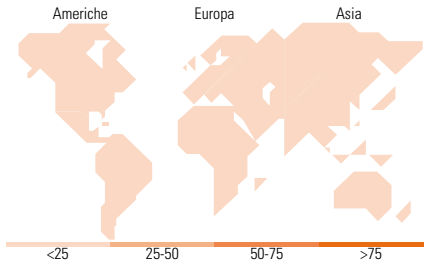
Fixed Income

Style Box™



Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,98
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,73
10 YR JGB,09/24	—	3,32
Future on Ultra US Treasury...	—	3,04
E-mini S&P 500 Future Sept 24	—	2,75
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,59
IMM EMINI NSDQ,IDX,09/24	—	1,99
Long Gilt Future Sept 24	—	1,92
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,87
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,54
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		27,72
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		581

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛 Governativo	-25,31
🏢 Societario	34,30
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
👥 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	97,97
📄 Derivati	-6,96

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	16,78
Da 0 a 4 cedole	22,17
Da 4 a 6 cedole	51,43
Da 6 a 8 cedole	6,93
Da 8 a 10 cedole	2,70
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,01 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	27/08/2015	UCITS	Si	Spese correnti	0,84%
Nome del Gestore	David Copsey	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	27/08/2015	ISIN	LU1236805880		
NAV (02/05/2025)	EUR 96,28				
Patrimonio Netto (Mln)	227,04 USD				

(30/06/2024)