

Goldman Sachs Global Absolute Return Portfolio R Inc 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

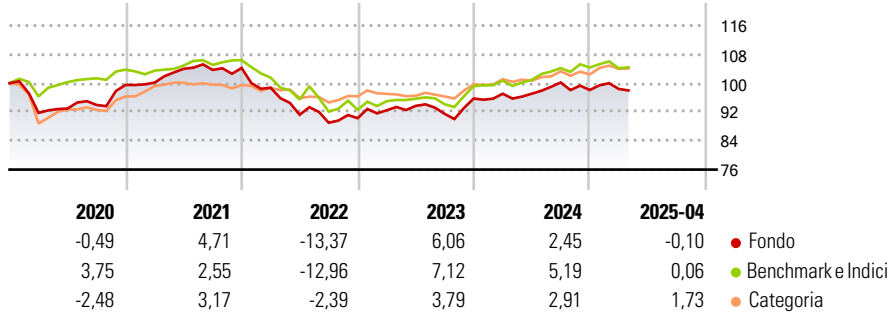
The Portfolio will seek to achieve absolute returns over a rolling three-year period from a portfolio of investments in equity, equity-related securities, fixed income securities, fixed income-related securities, and financial derivative or other instruments on interest rates, credit, currencies and 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	5,80
3Y R-Squared	83,31	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 %

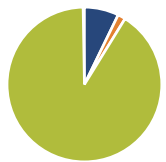
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-1,58	-0,95	0,18
6-Mesi	-0,42	0,07	1,84
1-Anno	1,63	3,99	3,91
3-Anni Ann.ti	1,99	2,23	1,26
5-Anni Ann.ti	1,16	1,11	1,94
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 23/05/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	0,29	-	-	-
2024	1,39	0,00	3,21	-2,09
2023	2,43	1,31	-2,36	4,67
2022	-5,25	-7,62	-2,42	1,41
2021	0,63	3,84	-0,30	0,52

Portafoglio 30/06/2024



Asset Allocation %

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

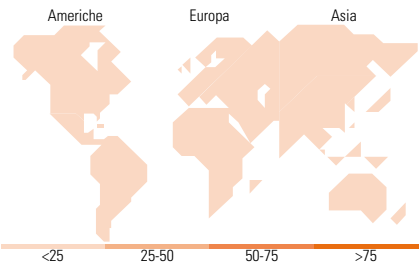
Fixed Income

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 Sviluppati	-
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	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	27/08/2015	ISIN	LU1236805534		
NAV (23/05/2025)	EUR 86,55				
Patrimonio Netto (Mln)	227,04 USD				

(30/06/2024)