

# Goldman Sachs Global Strategic Macro Bond Portfolio P Acc USD

**Categoria Morningstar™**

Obbligazionari Flessibili USD

**Benchmark Morningstar**

Morningstar US Core Bond TR USD

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

**Morningstar Rating™**

★★★★

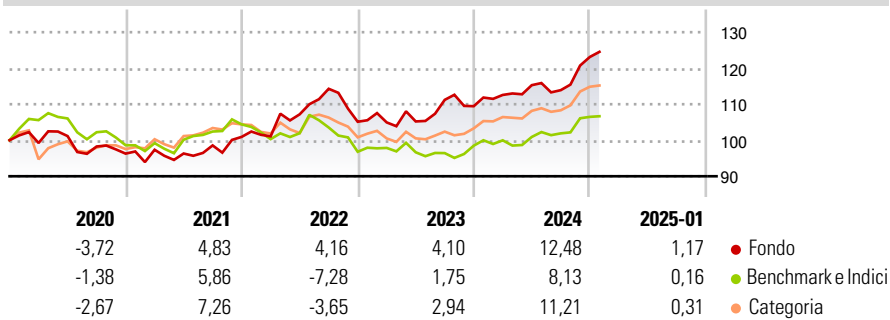
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Il Comparto intende fornire un reddito e una crescita del capitale nel lungo termine. Il Comparto investirà prevalentemente in titoli quotati in borsa, valute e strumenti finanziari derivati, negoziati in genere nei mercati obbligazionari e valutari di tutto il mondo. Il Comparto adotterà strategie d'investimento differenti che tengono conto di durata (tassi d'interesse), paesi, valute, governi e swap, debito dei mercati emergenti e ipoteche. Il Comparto potrà anche attuare una copertura a livello di portafoglio complessivo per eliminare rischi direzionali di mercato non desiderati.

**Misure di Rischio**

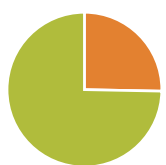
|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | 0,71  | 3Y Sharpe Ratio | 0,57  |
| 3Y Beta           | 0,17  | 3Y Std Dev      | 7,84  |
| 3Y R-Squared      | 20,05 | 3Y Risk         | Basso |
| 3Y Info Ratio     | 0,84  | 5Y Risk         | Basso |
| 3Y Tracking Error | 6,70  | 10Y Risk        | Basso |

Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

**Rendimenti**


| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat   | Rendimenti           | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|-------|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 7,76  | 4,20 | 4,86  | <b>Trimestrali %</b> |       |       |       |       |
| 6-Mesi           | 10,42 | 5,67 | 7,69  | 2025                 | -     | -     | -     | -     |
| 1-Anno           | 12,65 | 8,41 | 10,17 | 2024                 | 2,86  | 2,41  | -1,21 | 8,08  |
| 3-Anni Ann.ti    | 8,12  | 2,69 | 5,06  | 2023                 | -0,18 | 0,26  | 5,69  | -1,58 |
| 5-Anni Ann.ti    | 4,05  | 0,59 | 2,69  | 2022                 | 0,16  | 6,04  | 6,62  | -8,01 |
| 10-Anni Ann.ti   | 3,51  | 2,28 | 3,49  | 2021                 | 1,11  | -1,07 | 2,33  | 2,41  |

Rendimenti aggiornati al 10/02/2025

**Portafoglio 31/12/2024**


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 0,00  |
| ● Obbligazioni     | 25,31 |
| ● Liquidità        | 74,69 |
| ● Altro            | 0,00  |

**Fixed Income**
**Style Box™**

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**
**Credit Quality %**

Fond Credit Quality % Fond

**Titoli principali**

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Japan (Government Of) 0%                    | —       | 9,50  |
| Japan (Government Of) 0%                    | —       | 9,23  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 9,03  |
| Japan (Government Of) 0%                    | —       | 8,90  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 8,14  |
| Federal National Mortgage...                | —       | 7,71  |
| CBOT/CBT 5-YR TNOTE 3/2025                  | —       | 5,76  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 5,20  |
| Goldman Sachs US\$ Std VNAV X...            | —       | 5,09  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 5,03  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 73,60 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 159   |

**Fixed Income Sector Weightings %**

|                            | Fondo        |
|----------------------------|--------------|
| 🏛️ Governativo             | 83,34        |
| 🏢 Societario               | 0,00         |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 18,65        |
| 🏛️ Enti Locali             | 0,00         |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | -9,55        |
| 📄 Derivati                 | 7,56         |
| <b>Coupon Range %</b>      | <b>Fondo</b> |
| 0 coupon                   | 0,00         |
| Da 0 a 4 cedole            | 0,00         |
| Da 4 a 6 cedole            | 0,00         |
| Da 6 a 8 cedole            | 0,00         |
| Da 8 a 10 cedole           | 0,00         |
| Da 10 a 12 cedole          | 0,00         |
| Oltre 12 cedole            | 0,00         |

**Scadenze %**

|            | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 44,34 |
| da 3 a 5   | 14,70 |
| da 5 a 7   | 10,20 |
| da 7 a 10  | 11,45 |
| da 10 a 15 | 8,69  |
| da 15 a 20 | 1,45  |
| da 20 a 30 | 6,50  |
| oltre 30   | 0,99  |

**Anagrafica**

|                        |                                     |                         |              |                              |            |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione    | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,60 USD     | Investimento Min. Ingresso   | 50.000 EUR |
| Telefono               | +31-703781781                       | (10/02/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | -          |
| Web                    | https://www.gsam.com                | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -          |
| Data di Partenza       | 22/10/2014                          | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | 1,00%      |
| Nome del Gestore       | Bradley Miller                      | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 10,00%     |
| Data Inizio Gestione   | 01/05/2022                          | Inc/Acc                 | Acc          |                              |            |
| NAV (10/02/2025)       | USD 126,06                          | ISIN                    | LU1111996127 |                              |            |
| Patrimonio Netto (Mln) | 157,17 USD                          |                         |              |                              |            |

(31/12/2024)