

Goldman Sachs Global Absolute Return Portfolio Base Inc USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001007

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

★★

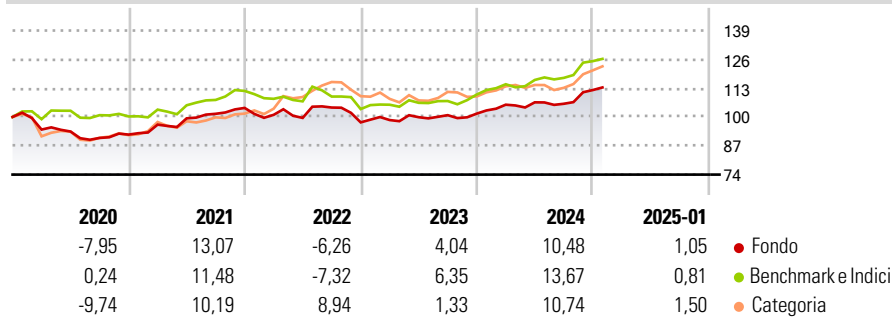
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

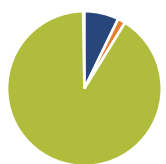
3Y Alpha	-1,56	3Y Sharpe Ratio	0,25
3Y Beta	0,69	3Y Std Dev	6,34
3Y R-Squared	88,58	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,25	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,21	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,18	6,68	7,48	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,51	8,29	9,30	2025	-	-	-	-
1-Anno	9,24	12,02	11,07	2024	3,98	1,01	-0,61	5,84
3-Anni Ann.ti	4,29	5,64	7,16	2023	1,07	1,30	0,94	0,68
5-Anni Ann.ti	1,93	4,17	4,87	2022	-2,99	-1,39	4,71	-6,42
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	4,88	2,95	2,06	2,61

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/06/2024


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	7,19
● Obbligazioni	1,62
● Liquidità	90,92
● Altro	0,27

Fixed Income
Style Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
		Bassa	Med	Alta

Sensibilità ai Tassi

Fondo	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	-


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 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	27/08/2015	UCITS	Si	Spese correnti	1,51%
Nome del Gestore	David Copsey	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	27/08/2015	ISIN	LU1236796444		
NAV (04/02/2025)	USD 101,68				
Patrimonio Netto (Mln)	227,04 USD				

(30/06/2024)