

Goldman Sachs Global Absolute Return Portfolio Base Acc 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

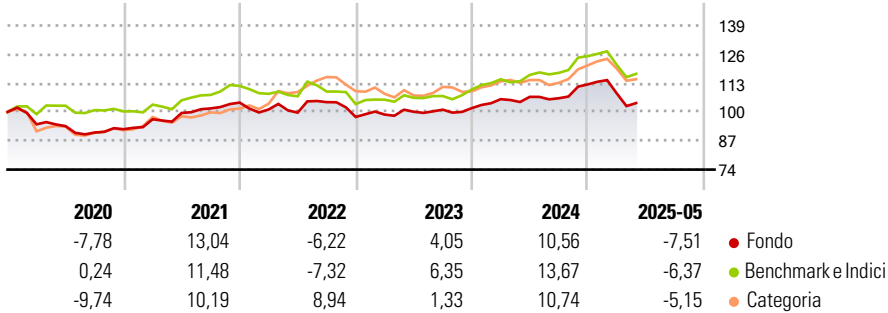
Morningstar Rating™

★★

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.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,79	3Y Sharpe Ratio	-0,18
3Y Beta	0,71	3Y Std Dev	7,39
3Y R-Squared	90,57	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,64	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,83	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

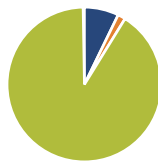
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-9,82	-7,85	-7,55
6-Mesi	-8,41	-5,86	-5,07
1-Anno	-1,30	2,77	0,93
3-Anni Ann.ti	0,77	3,09	2,33
5-Anni Ann.ti	1,86	2,65	3,45
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 02/06/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-3,63	-	-	-
2024	3,98	1,01	-0,59	5,89
2023	1,08	1,31	0,92	0,68
2022	-3,00	-1,40	4,75	-6,39
2021	4,87	2,94	2,05	2,60

Portafoglio 30/06/2024



Asset Allocation %

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

Fixed Income

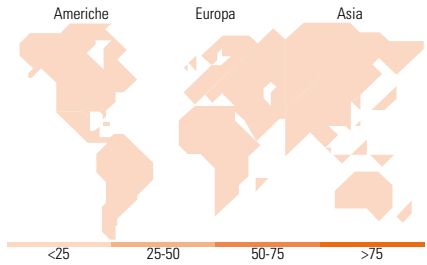
Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturity 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)	0,00 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.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	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	27/08/2015	ISIN	LU1236796873		
NAV (02/06/2025)	USD 109,10				
Patrimonio Netto (Mln)	227,04 USD				

(30/06/2024)