

# Goldman Sachs Global Absolute Return Portfolio E 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

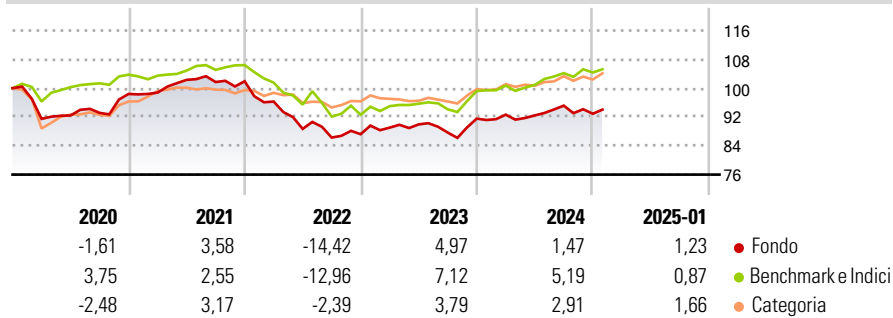
The Portfolio will seek to achieve absolute returns over a rolling three-year period from a portfolio of investments in equity, equity-related securities, fixed income securities, fixed income-related securities, and financial derivative or other instruments on interest rates, credit, currencies and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

### Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,86	3Y Sharpe Ratio	-0,58
3Y Beta	0,85	3Y Std Dev	6,04
3Y R-Squared	82,49	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,58	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,64	10Y Risk	-

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

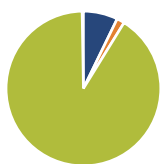
### Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,50	2,13	2,10	2025	-	-	-	-
6-Mesi	1,03	2,92	3,16	2025	-	-	-	-
1-Anno	2,79	6,10	5,36	2024	1,19	-0,23	2,94	-2,36
3-Anni Ann.ti	-1,52	0,70	0,37	2023	2,10	1,01	-2,54	4,44
5-Anni Ann.ti	-1,45	0,78	1,44	2022	-5,53	-7,89	-2,72	1,09
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	0,37	3,58	-0,58	0,21

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 30/06/2024



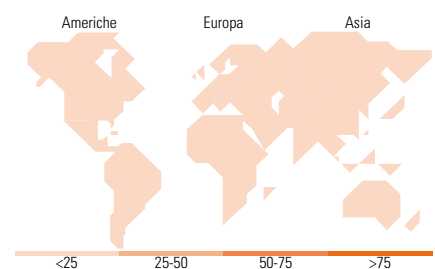
Asset Allocation %	Netta
● Azioni	7,19
● Obbligazioni	1,62
● Liquidità	90,92
● Altro	0,27

### Fixed Income

#### Style Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
Alta				

Fondo  
Duration Effettiva -  
Maturità 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
<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
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	1.500 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	27/08/2015	UCITS	Si	Spese correnti	2,01%
Nome del Gestore	David Copsey	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	27/08/2015	ISIN	LU1240744109		
NAV (04/02/2025)	EUR 86,62				
Patrimonio Netto (Mln)	227,04 USD				

(30/06/2024)