

# Goldman Sachs Emerging Markets Total Return Bond Portfolio Other Currency

**Categoria Morningstar™**  
**Inc. EUR-Hedged**

**Benchmark Morningstar**

Morningstar Emerging Markets Sovereign

Bond GR Hedged EUR

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

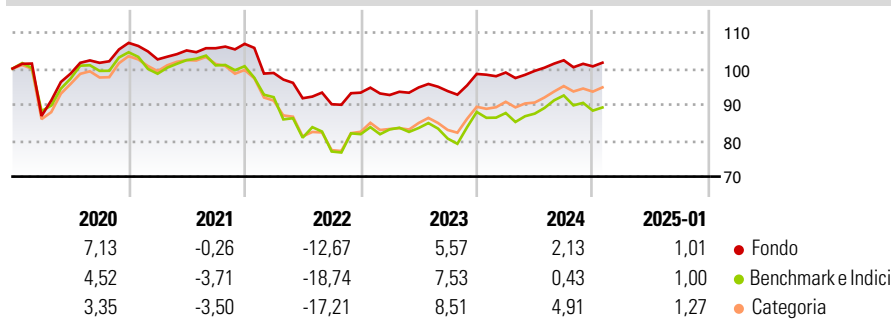
**Morningstar Rating™**

★★★★

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Portfolio seeks to achieve total returns through both capital appreciation and income generation from a portfolio of investments primarily in Emerging Markets fixed income securities and currency. The Portfolio will mainly invest in currencies and publicly traded securities of Emerging Markets as well as financial derivative instruments.

## Rendimenti



## Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -0,90 | 3Y Sharpe Ratio | -0,50 |
| 3Y Beta           | 0,54  | 3Y Std Dev      | 6,99  |
| 3Y R-Squared      | 74,25 | 3Y Risk         | -Med  |
| 3Y Info Ratio     | 0,26  | 5Y Risk         | -Med  |
| 3Y Tracking Error | 6,12  | 10Y Risk        | -     |

Basati su Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged EUR (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 1,22  | -0,37 | 1,86  | 2025                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 0,73  | -0,54 | 3,36  | 2024                     | 0,39  | 0,47  | 2,96  | -1,65 |
| 1-Anno           | 3,15  | 3,38  | 7,24  | 2023                     | -0,70 | 2,27  | -1,07 | 5,08  |
| 3-Anni Ann.ti    | -1,40 | -2,73 | -0,46 | 2022                     | -7,55 | -7,11 | -1,81 | 3,56  |
| 5-Anni Ann.ti    | -0,02 | -2,53 | -0,99 | 2021                     | -4,28 | 2,43  | 0,58  | 1,14  |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -     |                          |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

## Portafoglio 31/12/2024



| Asset Allocation % | Netta  |
|--------------------|--------|
| ● Azioni           | 0,00   |
| ● Obbligazioni     | 195,80 |
| ● Liquidità        | -96,61 |
| ● Altro            | 0,81   |

## Fixed Income

### Style Box™

|                      |       | Qualità Credito |     |       |
|----------------------|-------|-----------------|-----|-------|
|                      |       | Alto            | Med | Basso |
| Sensibilità ai Tassi | Alto  |                 |     |       |
|                      | Med   |                 |     |       |
|                      | Basso |                 |     |       |

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Credit Quality %

Fond

Credit Quality %

Fond

0

0

## Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| GS USD Treasury Liq Res X Inc               | —       | 9,39  |
| US Treasury Bond Future Mar 25              | —       | 4,31  |
| Ultra US Treasury Bond...                   | —       | 3,73  |
| Colombia (Republic Of) 7%                   | —       | 3,04  |
| Turkey (Republic of) 36%                    | —       | 2,09  |
| Indonesia (Republic of) 6.5%                | —       | 1,84  |
| South Africa (Republic of)...               | —       | 1,59  |
| South Africa (Republic of) 9%               | —       | 1,59  |
| South Africa (Republic of)...               | —       | 1,57  |
| Joint Stock Commercial...                   | —       | 1,56  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 30,70 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 211   |

## Fixed Income Sector Weightings %

|                            | Fondo   |
|----------------------------|---------|
| 🏛️ Governativo             | 147,84  |
| 🏢 Societario               | 47,10   |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 0,00    |
| 🏘️ Enti Locali             | 0,00    |
| 🏡 Liquidità ed equivalenti | -100,02 |
| 📄 Derivati                 | 5,08    |

| Coupon Range %    | Fondo |
|-------------------|-------|
| 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   | 12,73 |
| da 3 a 5   | 7,07  |
| da 5 a 7   | 10,22 |
| da 7 a 10  | 4,98  |
| da 10 a 15 | 3,91  |
| da 15 a 20 | 1,83  |
| da 20 a 30 | 1,75  |
| oltre 30   | 0,15  |

## Anagrafica

|                        |                                     |                         |              |                              |           |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione    | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,02 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 5.000 EUR |
| Telefono               | +31-703781781                       | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -         |
| Web                    | https://www.gsam.com                | Valuta del Fondo        | EUR          | T.E.R.                       | -         |
| Data di Partenza       | 21/11/2017                          | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 1,45%     |
| Nome del Gestore       | Angus Bell                          | Inc/Acc                 | Inc          | Commissione di incentivo     | 15,00%    |
| Data Inizio Gestione   | 21/11/2017                          | ISIN                    | LU1706948723 |                              |           |
| NAV (04/02/2025)       | EUR 74,75                           |                         |              |                              |           |
| Patrimonio Netto (Mln) | 138,51 USD                          |                         |              |                              |           |

(31/12/2024)