

Goldman Sachs Global Strategic Macro Bond Portfolio RS Inc EUR-Hedged

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

Senza 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 | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,07 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 3,03 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti

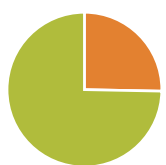
Rend. Cumulati %

| Periodo | Rend. Cumulati % |
|----------------|------------------|
| 3-Mesi | 3,16 |
| 6-Mesi | 3,69 |
| 1-Anno | 6,46 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,80 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,61 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 10/02/2025

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | 0,31 | 1,34 | 2,50 | 0,00 |
| 2023 | 1,07 | 0,25 | 2,18 | 2,33 |
| 2022 | -2,16 | -0,63 | -0,64 | -0,44 |
| 2021 | -3,04 | -0,25 | -0,08 | 0,34 |

Portafoglio 31/12/2024

Asset Allocation %

| Categoria | Netta |
|--------------|-------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 25,31 |
| Liquidità | 74,69 |
| Altro | 0,00 |

Fixed Income
Style Box™

| Qualità Credito | | Sensibilità ai Tassi | |
|-----------------|-------|----------------------|------|
| Alto | Basso | Bassa | Alta |
| | | | |
| | | | |
| | | | |

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
Credit Quality %

| Fond | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % |
|------|------------------|------|------------------|
| 0 | 0 | 0 | 0 |

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 %

| Settore | Fondo |
|--------------------------|--------------|
| Governativo | 83,34 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 18,65 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -9,55 |
| Derivati | 7,56 |
| 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 %

| Scadenza | 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) | 0,09 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | (10/02/2025) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://www.gsam.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 01/10/2019 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,60% |
| Nome del Gestore | Bradley Miller | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/05/2022 | Inc/Acc | Inc | | |
| NAV (10/02/2025) | EUR 96,72 | ISIN | LU2018824602 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 157,17 USD | | | | |

(31/12/2024)