

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Base Acc USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

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

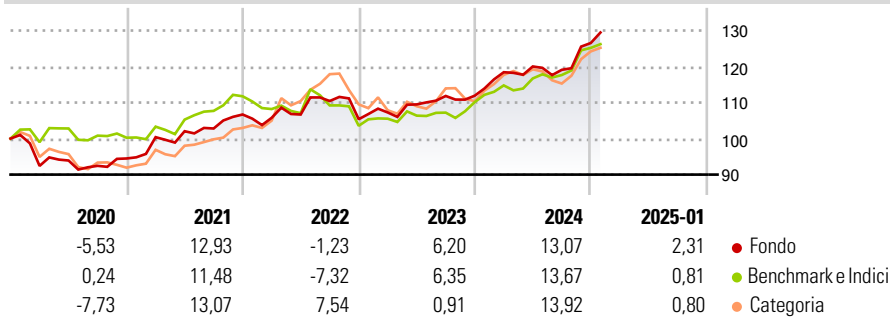
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). The Portfolio seeks to approximate this beta component in a relatively liquid, transparent, and cost efficient manner. Absolute returns are not guaranteed.

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,64	3Y Sharpe Ratio	0,72
3Y Beta	0,72	3Y Std Dev	6,51
3Y R-Squared	82,01	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,68	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,54	10Y Risk	+Med

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	6,42	5,33	6,98	2025	-	-	-	-
6-Mesi	13,60	9,97	10,99	2025	-	-	-	-
1-Anno	12,16	12,19	12,58	2024	5,82	1,34	-0,78	6,26
3-Anni Ann.ti	7,93	5,81	9,81	2023	1,79	2,08	2,15	0,07
5-Anni Ann.ti	4,77	4,06	6,51	2022	-0,87	0,86	3,52	-4,58
10-Anni Ann.ti	4,13	4,80	4,22	2021	6,27	1,65	0,74	3,79

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



Fixed Income

Style Box™

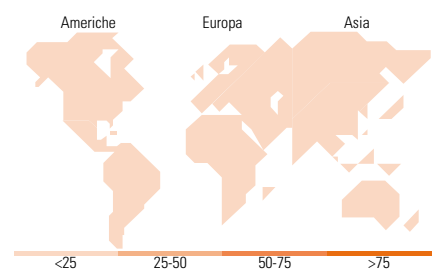


Sensibilità ai Tassi

Fondo

- Duration Effettiva -
- Maturity effettiva -
- Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Notes...	-	6,99
United States Treasury Notes...	-	4,91
United States Treasury Bills...	-	3,46
United States Treasury Bills...	-	2,57
United States Treasury Bills...	-	2,16
United States Treasury Notes...	-	1,99
United States Treasury Notes...	-	1,76
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,71
United States Treasury Bills...	-	1,63
United States Treasury Bills...	-	1,41
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		28,59
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		106

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	57,79
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	42,21
Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	43,74
Da 0 a 4 cedole	2,43
Da 4 a 6 cedole	53,83
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

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)	2,64 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	1,50%
Data di Partenza	13/01/2015	UCITS	Si	Spese correnti	1,54%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103307317		
NAV (07/02/2025)	USD 12,91				
Patrimonio Netto (Mln)	1.088,04 USD				

(31/12/2024)