Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Other Currency Acc CHF-Hedged

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001011

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

Senza 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	-	3Y Sharpe Ratio	0,30
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,88
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



Rend. Cumulati % Fondo		Rendimenti		Q2	Q3	
nellu. Gulliulati 70	rolluo	Renamenti	Q1	Q2	ŲS	Q4
3-Mesi	2,12	Trimestrali %				
6-Mesi	4,75	2025	-2,09	3,67	2,72	-
1-Anno	1,76	2024	-1,97	0,62	4,57	-2,23
3-Anni Ann.ti	5,13	2023	2,07	3,13	-1,04	7,57
5-Anni Ann.ti	4,21	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	=	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 05/12/2025						

Portafoglio 30/09/2025





Prondo

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
United States Treasury Bills	_	7,94
United States Treasury Bills	_	4,25
Federal Farm Credit Banks	_	3,82
United States Treasury Notes	_	3,12
US Treasury Bill 0%	-	2,49
United States Treasury Bills	_	2,44
United States Treasury Notes	_	2,37
United States Treasury Bills	_	2,23
United States Treasury Bills	_	1,96
United States Treasury Bills	-	1,96
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,57
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	zionari	65

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	54,72
Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	45,28
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	27,02
Da 0 a 4 cedole	14,92
Da 4 a 6 cedole	58,06
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

<25	25-50	50-75	>/5
Ripartizione Geografica %			Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Latii	na e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occio	lentale - Euro		-
Europa Occio	lentale - Non E	uro	-
Europa dell'E	st		-
Africa			-
Medio Orient	e		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi S	Sviluppati		-
Asia - Emerg	ente		-

Anagrafica	
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	18/08/2017
Nome del Gestore	James Park
Data Inizio Gestione	01/07/2022
NAV (05/12/2025)	CHF 10,80
Patrimonio Netto (MIn)	1.340,24 USD
(30/00/303E)	

Patrimonio Classe (MIn)	1,27 CHF
(05/12/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	CHF
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1662089983

Investimento Min. Ingresso	5.000 CHF
Investimento Min. Successivo	5.000 OIII
T.E.R.	1,50%
Spese correnti	1,54%
Commissione di incentivo	-