

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Other Currency Acc CHF-

Categoria Morningstar™
Hedged
Fondo 01011

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

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 | 0,25 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 7,77 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti



Rend. Cumulati %

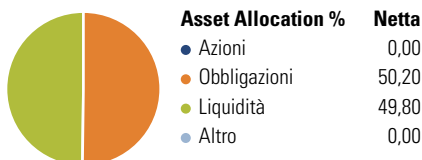
| | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 2,14 |
| 6-Mesi | 3,53 |
| 1-Anno | 3,05 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,60 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,44 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

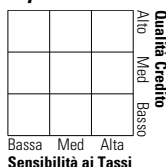
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | -1,97 | 0,62 | 4,57 | -2,23 |
| 2023 | 2,07 | 3,13 | -1,04 | 7,57 |
| 2022 | - | - | - | - |
| 2021 | - | - | - | - |

Portafoglio 31/12/2024

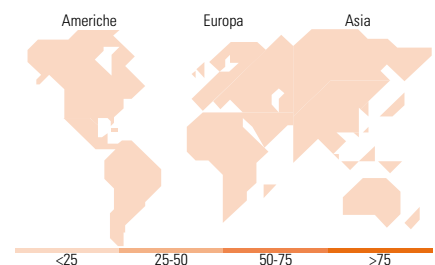


Fixed Income

Style Box™



| | |
|-----------------------|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturità effettiva | - |
| Qualità Credito Media | - |



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 Sviluppati | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 1,51 CHF | Investimento Min. Ingresso | 5.000 CHF |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://www.gsam.com | Valuta del Fondo | CHF | T.E.R. | 1,50% |
| Data di Partenza | 18/08/2017 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,54% |
| Nome del Gestore | James Park | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2022 | ISIN | LU1662089983 | | |
| NAV (04/02/2025) | CHF 10,56 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.088,04 USD | | | | |

(31/12/2024)