

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Other Currency Acc SGD-

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	0,48
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,29
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

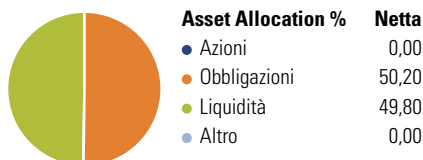
	Fondo
3-Mesi	5,14
6-Mesi	8,28
1-Anno	9,62
3-Anni Ann.ti	6,25
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

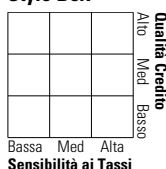
	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	3,10	0,51	4,43	-0,73
2023	2,46	-0,09	0,93	3,01
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 31/12/2024



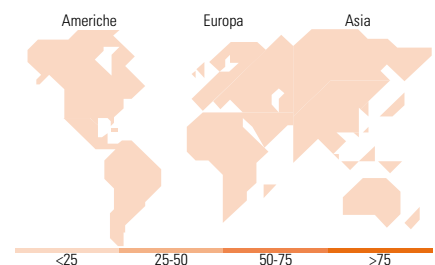
Fixed Income

Style Box™



Sensibilità ai Tassi

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)	0,18 SGD	Investimento Min. Ingresso	5.000 SGD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	SGD	T.E.R.	1,50%
Data di Partenza	22/04/2020	UCITS	Si	Spese correnti	1,54%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU2147132760		
NAV (04/02/2025)	SGD 12,60				
Patrimonio Netto (Mln)	1.088,04 USD				

(31/12/2024)