

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

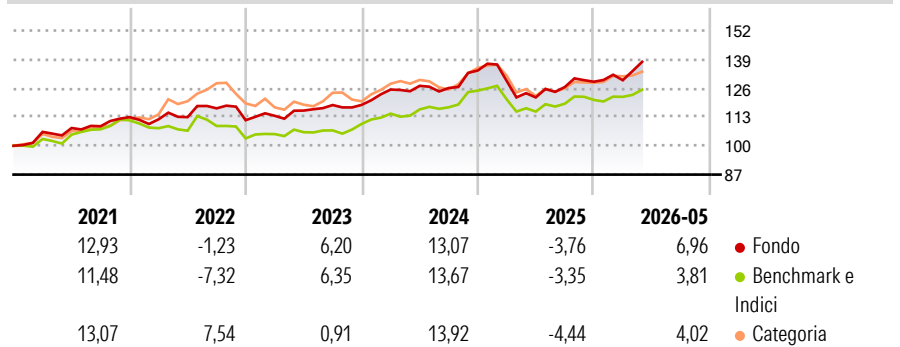
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). 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	0,97	3Y Sharpe Ratio	0,43
3Y Beta	0,92	3Y Std Dev	7,49
3Y R-Squared	68,73	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,20	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,50	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	8,78	6,14	6,72
6-Mesi	9,61	6,58	10,08
1-Anno	15,25	11,04	15,72
3-Anni Ann.ti	6,85	6,66	8,44
5-Anni Ann.ti	5,61	4,30	9,29
10-Anni Ann.ti	4,53	4,43	4,76

Rendimenti aggiornati al 24/06/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,52	-	-	-
2025	-3,53	-5,72	3,84	1,91
2024	5,82	1,34	-0,78	6,26
2023	1,79	2,08	2,15	0,07
2022	-0,87	0,86	3,52	-4,58

Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %

	Netta
Azioni	2,39
Obbligazioni	81,34
Liquidità	12,77
Altro	3,51

Fixed Income Style

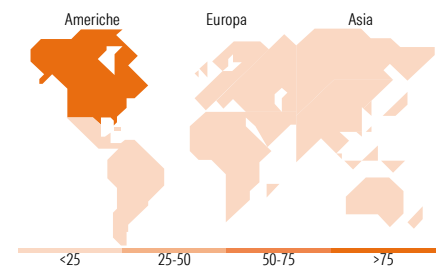
Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alto			
Med			
Basso			

Sensibilità ai Tassi

Fondo

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



Titoli principali

Nome	Settore	%
10 Year Treasury Note Future...	-	17,55
US Treasury Bond Future June...	-	11,06
GS Alternative Trend IO Inc...	-	5,99
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	5,46
Goldman Sachs Institutional...	-	3,44
Ultra US Treasury Bond...	-	3,18
E-mini S&P 500 Future June 26	-	2,39
Euro Schatz Future June 26	-	1,77
Euro Bund Future June 26	-	1,57
Ultra US Treasury Bond...	-	1,44
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		53,85
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		510

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	50,28
Societario	55,27
Cartolarizzazioni	16,14
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	9,81
Derivati	-31,50

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

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	99,45
Stati Uniti	99,45
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	0,44
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,28
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,11
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	11,83 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.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 (24/06/2026)	USD 14,48				
Patrimonio Netto (Mln)	1.138,70 USD				

(31/03/2026)

[See disclosures for more details](#)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.