

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio E Acc EUR-Hedged

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

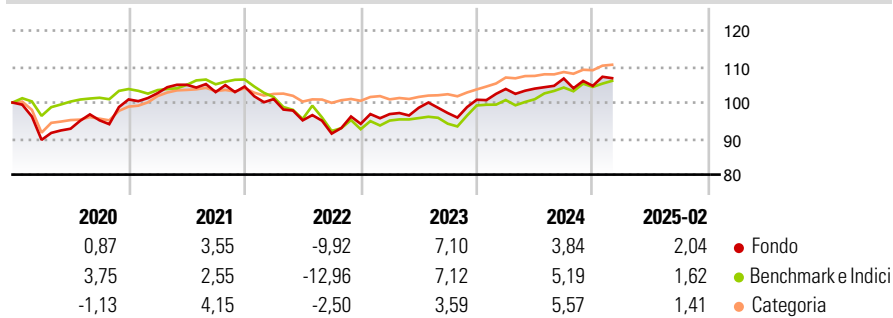
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). 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	0,94	3Y Sharpe Ratio	-0,01
3Y Beta	0,87	3Y Std Dev	6,45
3Y R-Squared	72,77	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,32	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,42	10Y Risk	Med

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,73	-2,02	0,16	2025	-	-	-	-
6-Mesi	1,12	-0,26	2,19	2025	-	-	-	-
1-Anno	1,88	3,38	4,81	2024	2,98	0,09	2,70	-1,91
3-Anni Ann.ti	2,22	0,70	3,14	2023	2,88	1,80	-1,47	3,79
5-Anni Ann.ti	2,42	0,98	3,08	2022	-3,34	-5,85	-3,87	2,97
10-Anni Ann.ti	0,64	1,40	1,38	2021	1,73	2,26	-1,94	1,51

Rendimenti aggiornati al 11/03/2025

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	50,20
Liquidità	49,80
Altro	0,00

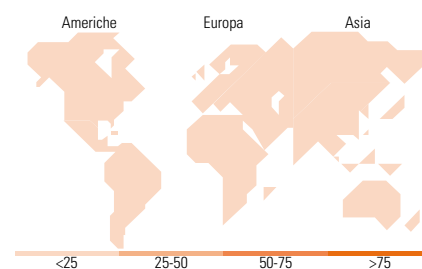
Fixed Income

Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Fondo

- Duration Effettiva -
- Maturity 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 Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,23 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.500 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,50%
Data di Partenza	14/01/2015	UCITS	Si	Spese correnti	2,04%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103308125		
NAV (11/03/2025)	EUR 10,82				
Patrimonio Netto (Mln)	1.088,04 USD				

(31/12/2024)