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

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Usato nel Report

Morningstar Euro Cautious Global Target ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD Allocation NR EUR

Benchmark Dichiarato

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.

1,37 3Y Sharpe Ratio

1,02 3Y Std Dev

71,18 3Y Risk

0,49 5Y Risk 2,97 10Y Risk

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

ιυ		
	0,67	
	5,50	
	+Med	
	+Med	

Rendimenti						
						120
	~~~					110
		~~~				100
						90
						-80
2020	2021	2022	2023	2024	2025-10	
2020 1,40	2021 4,13	2022 -9,44	2023 7,61	2024 4,36	2025-10 6,59	Fondo
						FondoBenchmark e
1,40	4,13	-9,44	7,61	4,36	6,59	

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,93	2,28	2,74	Trimestrali %				
6-Mesi	6,88	3,67	3,75	2025	0,28	1,76	3,37	-
1-Anno	7,38	4,99	5,80	2024	3,10	0,28	2,81	-1,82
3-Anni Ann.ti	7,04	5,43	5,51	2023	3,02	1,92	-1,39	3,93
5-Anni Ann.ti	3,68	1,30	4,95	2022	-3,31	-5,76	-3,73	3,23
10-Anni Ann.ti	1,91	1,96	1,41	2021	1,77	2,42	-1,79	1,73
Rendimenti aggiornati al 03/11/	2025							

Portafoglio 30/09/2025

Misure di Rischio

3Y Alpha

3Y Beta

applicabile)

(30/09/2025)

3Y R-Squared

3Y Info Ratio

3Y Tracking Error

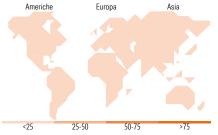




Fixed Income Sector Weightings %

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



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 Aziona	ri	0
Numero Complessivo di Titoli Obbliga:	zionari	65

₩ 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

\2)	23-30	30-73	/13
Ripartizione	Geografica %	ı	Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Latii	na e Centrale		=
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occio	lentale - Euro		-
'	lentale - Non E	uro	-
Europa dell'E	st		-
Africa			-
Medio Orient	e		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi S			-
Asia - Emerg	ente		-

Anagrafica					
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (MIn) (03/11/2025)	2,45 EUR	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	5.000 EUF
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,50%
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,53%
Data di Partenza	13/01/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo	=
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103307408		
NAV (03/11/2025)	EUR 11,49				
Patrimonio Netto (MIn)	1.340,24 USD				