

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Other Currency 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

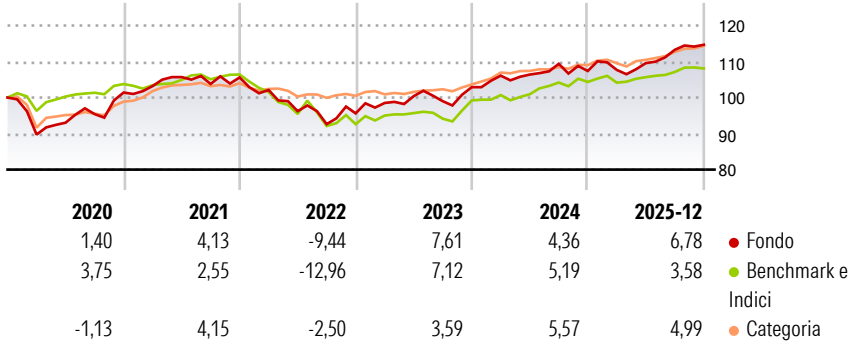
Morningstar Rating™

★★★

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.

Rendimenti



Misure di Rischio

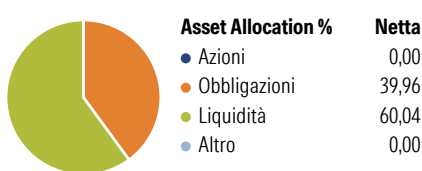
3Y Alpha	0,91	3Y Sharpe Ratio	0,64
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	5,04
3Y R-Squared	66,58	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,33	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	2,92	10Y Risk	+Med

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

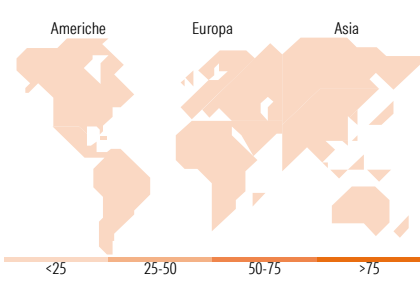
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,00	0,39	3,28	2026	-	-	-	-
6-Mesi	6,24	2,53	6,16	2025	0,28	1,76	3,37	1,23
1-Anno	6,43	3,75	7,06	2024	3,10	0,28	2,81	-1,82
3-Anni Ann.ti	5,91	4,63	5,57	2023	3,02	1,92	-1,39	3,93
5-Anni Ann.ti	3,01	1,05	4,44	2022	-3,31	-5,76	-3,73	3,23
10-Anni Ann.ti	2,51	2,07	2,28					

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	-
Qualità Credito	
Alto	
Med	
Basso	
Sensibilità ai Tassi	
Bassa	
Med	
Alta	



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	7,74
Federal Farm Credit Banks...	—	4,31
United States Treasury Notes...	—	3,53
United States Treasury Bills...	—	2,90
United States Treasury Notes...	—	2,67
United States Treasury Bills...	—	2,65
United States Treasury Bills...	—	2,57
United States Treasury Notes...	—	2,20
United States Treasury Bills...	—	2,05
Federal Farm Credit Banks...	—	1,79
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,41
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		45

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
■ Governativo	44,62
■ Societario	0,00
■ Cartolarizzazioni	0,00
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	55,38
■ Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	54,10
Da 0 a 4 cedole	25,80
Da 4 a 6 cedole	20,10
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)	2,79 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(29/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/01/2015	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,53%
Nome del Gestore	James Park	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	Inc/Acc	Acc		
NAV (29/01/2026)	EUR 11,75	ISIN	LU1103307408		
Patrimonio Netto (Mln)	1.190,46 USD				

(30/11/2025)