

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio P 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

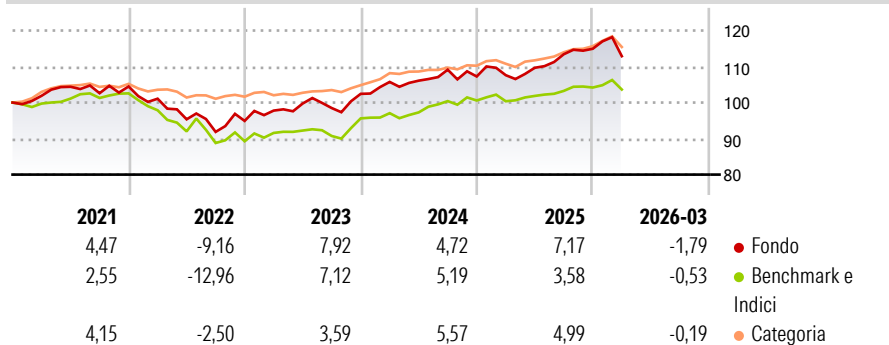
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). 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	0,59	3Y Sharpe Ratio	0,36
3Y Beta	1,12	3Y Std Dev	5,59
3Y R-Squared	67,81	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,22	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,21	10Y Risk	+Med

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

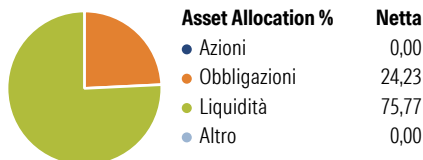
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,08	-0,09	0,37
6-Mesi	3,98	1,02	3,21
1-Anno	12,49	5,72	9,23
3-Anni Ann.ti	5,95	4,69	5,66
5-Anni Ann.ti	2,56	0,95	4,06
10-Anni Ann.ti	2,62	1,91	2,17

Rendimenti aggiornati al 13/04/2026

Rendimenti

Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,79	-	-	-
2025	0,33	1,91	3,43	1,34
2024	3,23	0,34	2,87	-1,72
2023	3,02	2,01	-1,26	4,00
2022	-3,25	-5,66	-3,66	3,31

Portafoglio 31/01/2026



Fixed Income Style

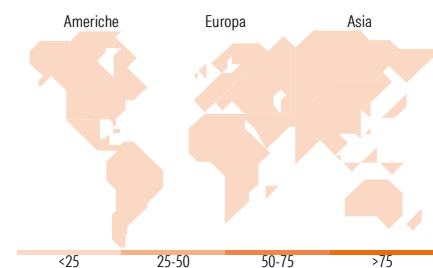
Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alto			
Med			
Basso			

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	6,09
Federal Farm Credit Banks...	—	4,33
United States Treasury Notes...	—	3,55
United States Treasury Notes...	—	2,69
United States Treasury Bills...	—	2,67
United States Treasury Bills...	—	2,21
Federal Farm Credit Banks...	—	1,80
United States Treasury Bills...	—	1,42
United States Treasury Bills...	—	1,35
United States Treasury Notes...	—	1,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		27,34
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		39

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	33,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	67,00
Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	34,76
Da 0 a 4 cedole	62,74
Da 4 a 6 cedole	2,50
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

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	6,54 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/01/2015	UCITS	Si	Spese correnti	1,19%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103308042		
NAV (13/04/2026)	EUR 13,06				
Patrimonio Netto (Mln)	1.246,44 USD				

(31/01/2026)

© 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.