

# 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™**

★★★

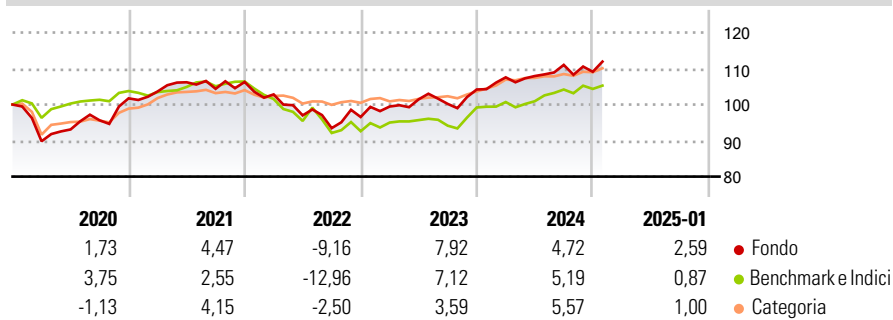
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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	2,13	3Y Sharpe Ratio	0,07
3Y Beta	0,89	3Y Std Dev	6,57
3Y R-Squared	75,10	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,72	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,29	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	2,93	2,13	2,07	2025	-	-	-	-
6-Mesi	5,31	2,92	2,82	2024	3,23	0,34	2,87	-1,72
1-Anno	6,59	6,10	5,95	2023	3,02	2,01	-1,26	4,00
3-Anni Ann.ti	2,51	0,70	2,84	2022	-3,25	-5,66	-3,66	3,31
5-Anni Ann.ti	2,21	0,78	2,51	2021	1,88	2,46	-1,71	1,83
10-Anni Ann.ti	1,76	1,76	1,54					

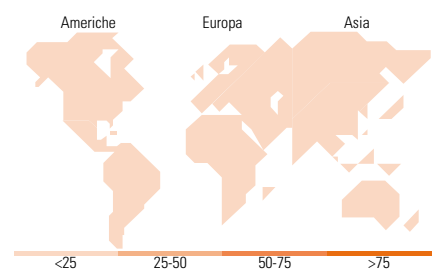
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

**Portafoglio 31/12/2024**


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

**Fixed Income**
**Style Box™**


Fondo  
Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media

**Fondo**

**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 %**

Settore	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 %**

Geografia	Fondo
<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppatori	-
Asia - Emergente	-

**Anagrafica**

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	5,81 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,15%
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 (04/02/2025)	EUR 12,29				
Patrimonio Netto (Mln)	1.088,04 USD				

(31/12/2024)