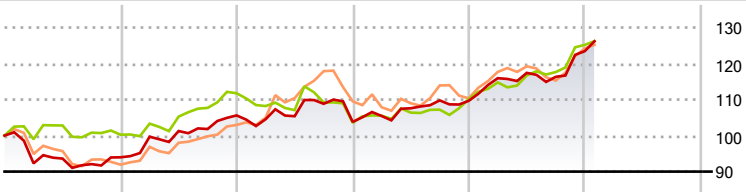
Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio A Acc USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001010	Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report	ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD	★★★

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-01	
-6,04	12,39	-1,70	5,64	12,57	2,22	Fondo
0,24	11,48	-7,32	6,35	13,67	0,81	Benchmark e Indici
-7,73	13,07	7,54	0,91	13,92	0,80	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,12	3Y Sharpe Ratio	0,65
3Y Beta	0,71	3Y Std Dev	6,45
3Y R-Squared	81,49	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,52	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,59	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	6,21	5,33	6,98
6-Mesi	13,36	9,97	10,99
1-Anno	11,64	12,19	12,58
3-Anni Ann.ti	7,39	5,81	9,81
5-Anni Ann.ti	4,25	4,06	6,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

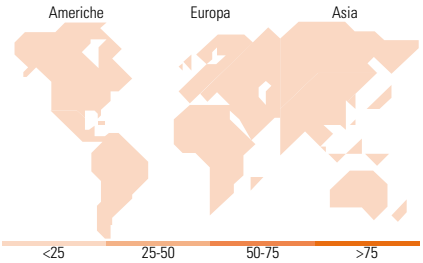
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	5,73	1,27	-0,94	6,13
2023	1,57	2,04	2,04	-0,10
2022	-1,00	0,79	3,27	-4,61
2021	6,09	1,58	0,54	3,72

Portafoglio 31/12/2024

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

Fixed Income Style Box™

	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 Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://www.gsam.com
Data di Partenza	26/05/2017
Nome del Gestore	James Park
Data Inizio Gestione	01/07/2022
NAV (07/02/2025)	USD 12,56
Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2024)	1.088,04 USD

Patrimonio Classe (Mln) (07/02/2025)	1,45 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1613235511

Investimento Min. Ingresso	1.500 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	2,00%
Spese correnti	2,04%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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 prodotto; (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.