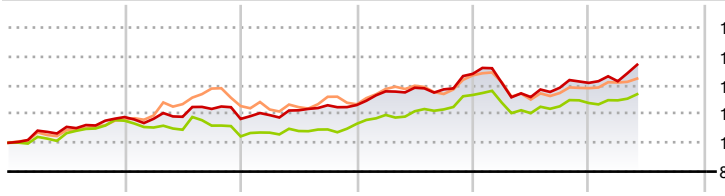
Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio P Acc USD

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-05
Fondo	13,38	-0,85	6,43	13,56	-3,45	7,20
Benchmark e Indici	11,48	-7,32	6,35	13,67	-3,35	3,81
Categoria	13,07	7,54	0,91	13,92	-4,44	4,02

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,34	3Y Sharpe Ratio	0,48
3Y Beta	0,92	3Y Std Dev	7,53
3Y R-Squared	68,45	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,31	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,53	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,66	2,09	2,92
6-Mesi	6,01	2,87	6,66
1-Anno	10,98	7,13	9,54
3-Anni Ann.ti	6,06	5,39	8,23
5-Anni Ann.ti	5,76	4,15	10,05
10-Anni Ann.ti	-	-	-

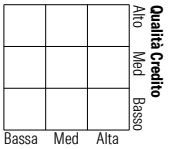
Rendimenti aggiornati al 10/06/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,65	-	-	-
2025	-3,40	-5,67	3,91	1,98
2024	5,96	1,48	-0,66	6,31
2023	1,77	2,18	2,26	0,09
2022	-0,79	0,92	3,61	-4,43

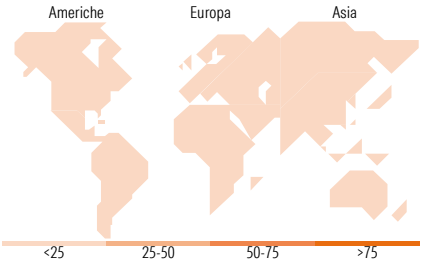
Portafoglio 28/02/2026

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	22,67
Liquidità	77,33
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	4,96
Federal Farm Credit Banks...	—	4,17
United States Treasury Notes...	—	3,42
United States Treasury Notes...	—	2,59
United States Treasury Bills...	—	2,15
Federal Farm Credit Banks...	—	1,74
United States Treasury Bills...	—	1,65
United States Treasury Bills...	—	1,39
United States Treasury Bills...	—	1,32
United States Treasury Notes...	—	1,17
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		24,56
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		37

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	32,17
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	67,83
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	32,73
Da 0 a 4 cedole	64,68
Da 4 a 6 cedole	2,59
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) (10/06/2026)	18,04 USD	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	26/05/2017	UCITS	Si	Spese correnti	1,19%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1613238705		
NAV (10/06/2026)	USD 14,98				
Patrimonio Netto (Mln) (28/02/2026)	1.256,94 USD				

See disclosures for more details

© 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 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.

MORNINGSTAR