Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio R Acc EUR-Hedged

Categoria Morningstar™
Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

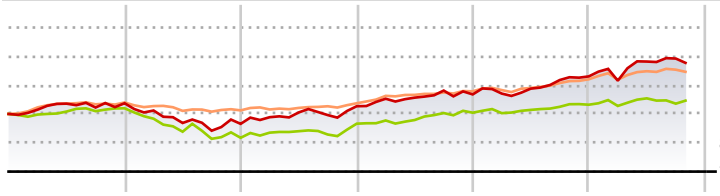
Benchmark Dichiarato
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	4,84	-8,87	8,32	5,15	7,48	5,22
Benchmark e Indici	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	1,77
Categoria	4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99	2,66

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,96	3Y Sharpe Ratio	0,83
3Y Beta	1,05	3Y Std Dev	5,96
3Y R-Squared	53,20	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,52	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,08	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-1,47	-0,84	-0,79
6-Mesi	0,47	0,72	0,76
1-Anno	6,08	1,85	4,43
3-Anni Ann.ti	7,28	5,13	6,00
5-Anni Ann.ti	3,06	0,63	4,29
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 13/11/2026

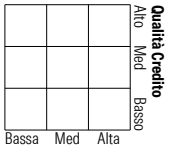
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,66	7,50	1,10	-
2025	0,36	2,04	3,48	1,43
2024	3,28	0,45	2,98	-1,58
2023	3,14	2,16	-1,15	3,99
2022	-3,14	-5,53	-3,64	3,35

Portafoglio 30/06/2026

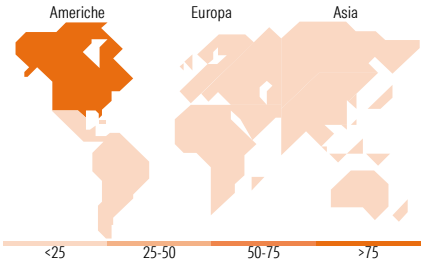


Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,32
Obbligazioni	40,07
Liquidità	53,86
Altro	5,74

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
CBOT/CBT T-BONDS 9/2026	—	14,06
Goldman Sachs Institutional...	—	5,68
GS Alternative Trend IO Inc...	—	5,45
France (Republic Of) 0%	—	4,64
Ultra US Treasury Bond...	—	4,34
Euro Schatz Future Sept 26	—	2,57
Euro Bobl Future Sept 26	—	2,46
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	2,41
Euro Bund Future Sept 26	—	2,22
Long Gilt Future Sept 26	—	1,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		45,55
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		748

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	9,32
Societario	50,05
Cartolarizzazioni	20,81
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	46,78
Derivati	-26,96

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
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	**99,59**
Stati Uniti	99,50
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,09
Europa	**0,32**
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,04
Europa Occidentale - Non Euro	0,25
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,09**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,09

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	23/08/2018
Nome del Gestore	James Park
Data Inizio Gestione	01/07/2022
NAV (13/11/2026)	EUR 12,73
Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2026)	1.372,20 USD

Patrimonio Classe (Mln) (10/11/2026)	80,18 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1865323098

Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,80%
Spese correnti	0,84%
Commissione di incentivo	-

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.