

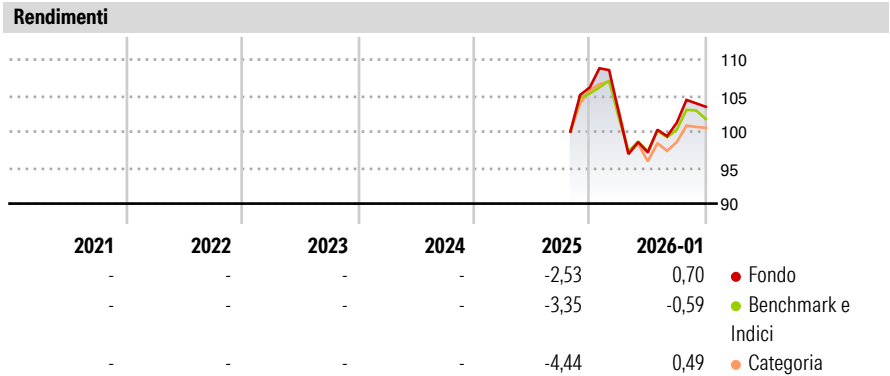
Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio IO Acc USD

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	Senza 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	- 3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	- 3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)		



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,56	-1,35	0,64	2026	-	-	-	-
6-Mesi	6,17	2,24	5,70	2025	-3,27	-5,41	4,26	2,18
1-Anno	-3,30	-4,27	-3,36	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Portafoglio 30/11/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	39,96
Liquidità	60,04
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Qualità Credito: Alto, Med, Basso

Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alto

Duration Effettiva: -

Maturità effettiva: -

Qualità Credito Media: -

Fondo

<25 25-50 50-75 >75

Titoli principali		
Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	7,74
Federal Farm Credit Banks...	—	4,31
United States Treasury Notes...	—	3,53
United States Treasury Bills...	—	2,90
United States Treasury Notes...	—	2,67
United States Treasury Bills...	—	2,65
United States Treasury Bills...	—	2,57
United States Treasury Notes...	—	2,20
United States Treasury Bills...	—	2,05
Federal Farm Credit Banks...	—	1,79
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,41
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		45

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	44,62
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	55,38
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	54,10
Da 0 a 4 cedole	25,80
Da 4 a 6 cedole	20,10
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)	4,98 USD	Investimento Min. Ingresso	-
		(04/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,14%
Data di Partenza	16/10/2024	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU2911681240		
NAV (04/02/2026)	USD 11,23				
Patrimonio Netto (Mln)	1.190,46 USD				
(30/11/2025)					

© 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.