## **Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Base Acc USD**

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001010

**Benchmark Morningstar** 

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report **Benchmark Dichiarato** 

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

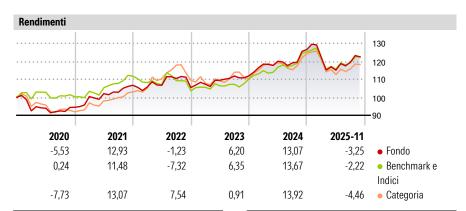
Morningstar Rating™

\*\*\*

## **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	0,04	3Y Sharpe Ratio	0,08
3Y Beta	0,77	3Y Std Dev	7,98
3Y R-Squared	74,86	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,24	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,97	10Y Risk	Med
Basati su Morningstar US applicabile)	Conservat	tive Target Allocation NR	USD (dove



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,50	1,77	2,94	Trimestrali %				
6-Mesi	4,39	4,23	3,63	2025	-3,53	-5,72	3,84	-
1-Anno	-4,71	-3,56	-3,67	2024	5,82	1,34	-0,78	6,26
3-Anni Ann.ti	4,36	4,47	4,27	2023	1,79	2,08	2,15	0,07
5-Anni Ann.ti	5,12	3,75	8,79	2022	-0,87	0,86	3,52	-4,58
10-Anni Ann.ti	3,24	3,87	3,31	2021	6,27	1,65	0,74	3,79
Rendimenti aggiornati al 16/12/2	2025							

## Portafoglio 30/09/2025



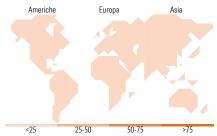


Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
United States Treasury Bills	_	7,94
United States Treasury Bills	_	4,25
Federal Farm Credit Banks	_	3,82
United States Treasury Notes	_	3,12
US Treasury Bill 0%	=	2,49
United States Treasury Bills	_	2,44
United States Treasury Notes	_	2,37
United States Treasury Bills	_	2,23
United States Treasury Bills	_	1,96
United States Treasury Bills	=	1,96
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,57
Numero Complessivo di Titoli Azionari	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	65

(30/09/2025)

₩ Governativo	54,72
Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	45,28
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	27,02
Da 0 a 4 cedole	14,92
Da 4 a 6 cedole	58,06
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

<25	25-50	50-75	>/5
Ripartizione	Fondo		
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Lati	na e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occio	dentale - Euro		-
Europa Occio	dentale - Non E	uro	-
Europa dell'E	st		-
Africa			-
Medio Orient	te		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi S	Sviluppati		-
Asia - Emerg	ente		-

				- iona - iona gonto
Anagrafica				
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset	Patrimonio Classe (MIn)	6,57 USD	Investimento Min. Ingresso
	Management B.V.	(16/12/2025)		Investimento Min. Successivo
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti
Data di Partenza	13/01/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103307317	
NAV (16/12/2025)	USD 13,61			
Patrimonio Netto (MIn)	1 340 24 HSD			

5.000 EUR

1,50% 1,54%