

# 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

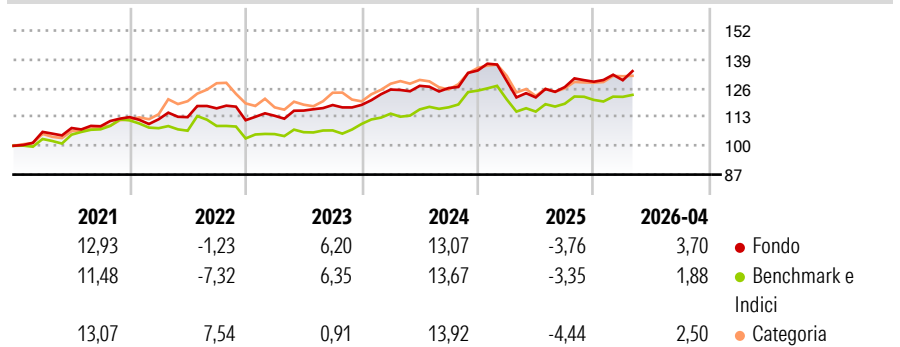
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). 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	0,66	3Y Sharpe Ratio	0,43
3Y Beta	0,91	3Y Std Dev	7,50
3Y R-Squared	69,38	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,11	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,44	10Y Risk	+Med

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

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

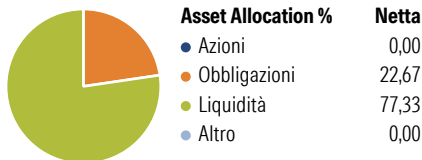
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,09	2,48	2,67
6-Mesi	2,51	0,61	3,04
1-Anno	9,73	6,53	7,56
3-Anni Ann.ti	6,00	5,62	6,59
5-Anni Ann.ti	4,85	3,78	8,29
10-Anni Ann.ti	4,19	4,31	4,09

Rendimenti aggiornati al 30/04/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,52	-	-	-
2025	-3,53	-5,72	3,84	1,91
2024	5,82	1,34	-0,78	6,26
2023	1,79	2,08	2,15	0,07
2022	-0,87	0,86	3,52	-4,58

### Portafoglio 28/02/2026



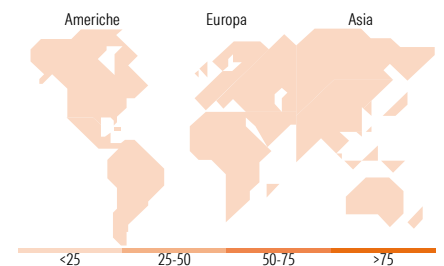
### Fixed Income Style

#### 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)	10,89 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/01/2015	UCITS	Si	Spese correnti	1,54%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1103307317		
NAV (30/04/2026)	USD 14,20				
Patrimonio Netto (Mln)	1.256,94 USD				

(28/02/2026)