

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio Other Currency 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

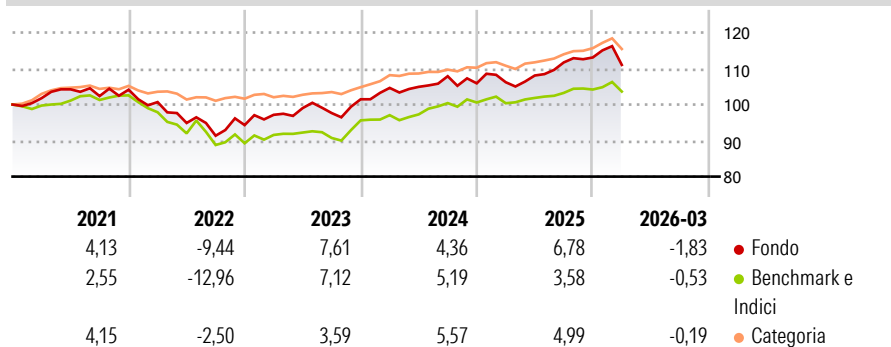
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). The Portfolio seeks to approximate this beta component in a relatively liquid, transparent, and cost efficient manner. Absolute returns are not guaranteed.

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 0,25 | 3Y Sharpe Ratio | 0,30 |
| 3Y Beta | 1,12 | 3Y Std Dev | 5,58 |
| 3Y R-Squared | 67,33 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,10 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 3,22 | 10Y Risk | +Med |

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

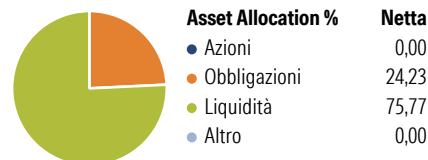
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|------|-------|
| 3-Mesi | 0,34 | 0,13 | -0,10 |
| 6-Mesi | 2,61 | 0,35 | 3,01 |
| 1-Anno | 10,89 | 4,59 | 8,04 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,02 | 4,53 | 5,73 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,26 | 0,94 | 4,09 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,36 | 1,93 | 2,24 |

Rendimenti aggiornati al 28/04/2026

Rendimenti

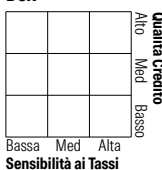
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | -1,83 | - | - | - |
| 2025 | 0,28 | 1,76 | 3,37 | 1,23 |
| 2024 | 3,10 | 0,28 | 2,81 | -1,82 |
| 2023 | 3,02 | 1,92 | -1,39 | 3,93 |
| 2022 | -3,31 | -5,76 | -3,73 | 3,23 |

Portafoglio 31/01/2026



Fixed Income Style

Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva

-

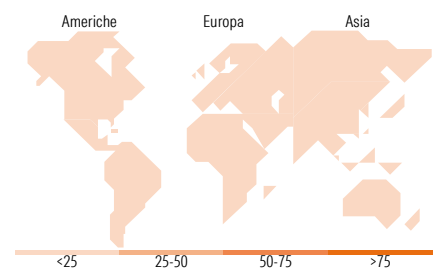
Maturità effettiva

-

Qualità Credito Media

-

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| United States Treasury Bills... | - | 6,09 |
| Federal Farm Credit Banks... | - | 4,33 |
| United States Treasury Notes... | - | 3,55 |
| United States Treasury Notes... | - | 2,69 |
| United States Treasury Bills... | - | 2,67 |
| United States Treasury Bills... | - | 2,21 |
| Federal Farm Credit Banks... | - | 1,80 |
| United States Treasury Bills... | - | 1,42 |
| United States Treasury Bills... | - | 1,35 |
| United States Treasury Notes... | - | 1,21 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 27,34 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 39 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 33,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 67,00 |
| Derivati | 0,00 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 34,76 |
| Da 0 a 4 cedole | 62,74 |
| Da 4 a 6 cedole | 2,50 |
| 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) | 3,13 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 13/01/2015 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,53% |
| Nome del Gestore | James Park | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2022 | ISIN | LU1103307408 | | |
| NAV (28/04/2026) | EUR 11,81 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.246,44 USD | | | | |

(31/01/2026)

© 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.