

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

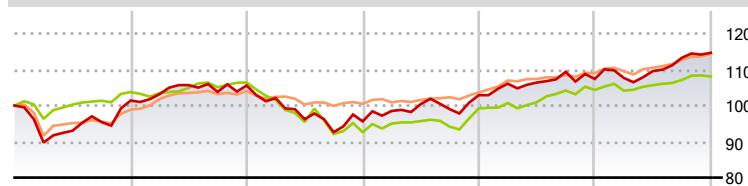
Morningstar Rating™

★★★

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.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-12
1,40	4,13	-9,44	7,61	4,36	6,78
3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58
-1,13	4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,91	3Y Sharpe Ratio	0,64
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	5,04
3Y R-Squared	66,58	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,33	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	2,92	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,91	0,94
6-Mesi	6,09	3,40
1-Anno	7,45	4,50
3-Anni Ann.ti	5,95	4,76
5-Anni Ann.ti	2,71	0,97
10-Anni Ann.ti	2,54	2,21

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

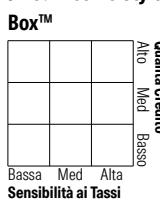
	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	0,28	1,76	3,37	1,23
2024	3,10	0,28	2,81	-1,82
2023	3,02	1,92	-1,39	3,93
2022	-3,31	-5,76	-3,73	3,23

Portafoglio 31/10/2025



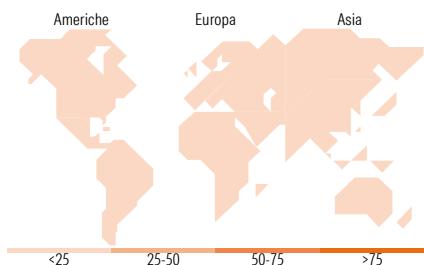
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	0,00
• Obbligazioni	26,02
• Liquidità	73,98
• Altro	0,00

Fixed Income Style



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Farm Credit Banks...	—	4,36
United States Treasury Notes...	—	3,53
United States Treasury Notes...	—	2,68
United States Treasury Bills...	—	2,55
United States Treasury Bills...	—	2,24
United States Treasury Notes...	—	2,20
United States Treasury Bills...	—	2,06
Federal Farm Credit Banks...	—	1,82
United States Treasury Bills...	—	1,45
United States Treasury Notes...	—	1,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		24,10
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	42	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Governativo	33,69
Societario	0,00	
Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
Liquidità ed equivalenti	66,31	
Derivati	0,00	

Fondo	Coupon Range %
0 coupon	21,03
Da 0 a 4 cedole	40,35
Da 4 a 6 cedole	38,62
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		-
Fondo	Europa	0,00
Regno Unito		-
Europa Occidentale - Euro		-
Europa Occidentale - Non Euro		-
Europa dell'Est		-
Africa		-
Medio Oriente		-
Fondo	Asia	0,00
Giappone		-
Australasia		-
Asia - Paesi Sviluppati		-
Asia - Emergenti		-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	2,83 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(16/01/2026)	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 (16/01/2026)	EUR 11,68				
Patrimonio Netto (Mln)	1.195,41 USD				
(31/10/2025)					