

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio P 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

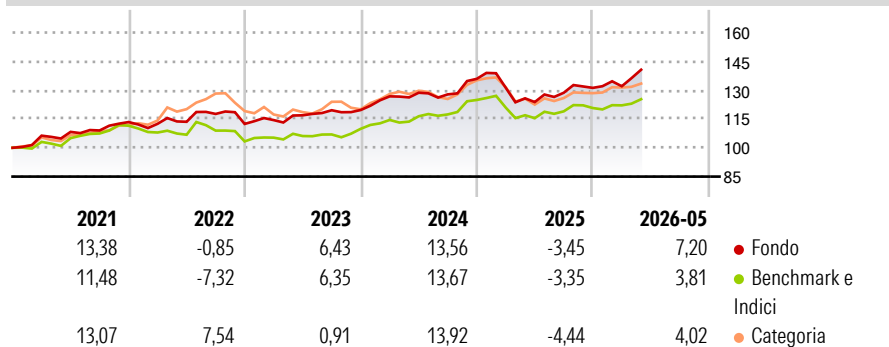
The investment objective of the Portfolio is to implement a trading strategy that seeks to approximate the return pattern characteristic of hedge funds as a broad asset class. Returns of hedge funds can be viewed as being composed of both "beta" (or varying market exposures) and "alpha" (or manager skill). 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 | 1,34 | 3Y Sharpe Ratio | 0,48 |
| 3Y Beta | 0,92 | 3Y Std Dev | 7,53 |
| 3Y R-Squared | 68,45 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 0,31 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 3,53 | 10Y Risk | - |

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

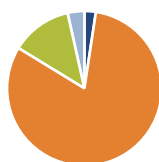
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 8,08 | 5,73 | 5,80 |
| 6-Mesi | 9,14 | 6,15 | 9,27 |
| 1-Anno | 15,52 | 11,09 | 15,80 |
| 3-Anni Ann.ti | 7,24 | 6,59 | 8,35 |
| 5-Anni Ann.ti | 5,86 | 4,28 | 9,08 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2026 | 0,65 | - | - | - |
| 2025 | -3,40 | -5,67 | 3,91 | 1,98 |
| 2024 | 5,96 | 1,48 | -0,66 | 6,31 |
| 2023 | 1,77 | 2,18 | 2,26 | 0,09 |
| 2022 | -0,79 | 0,92 | 3,61 | -4,43 |

Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %

| | Netta |
|--------------|-------|
| Azioni | 2,39 |
| Obbligazioni | 81,34 |
| Liquidità | 12,77 |
| Altro | 3,51 |

Fixed Income Style

Box™

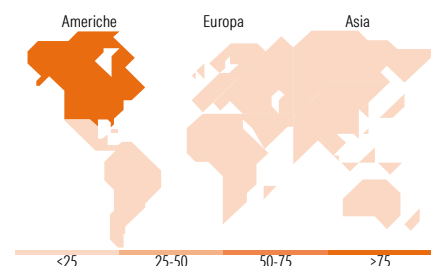
| Qualità Credito | Alto | Med | Basso |
|-----------------|------|-----|-------|
| Alto | | | |
| Med | | | |
| Basso | | | |

Sensibilità ai Tassi

Fondo

- Duration Effettiva -
- Maturity effettiva -
- Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| 10 Year Treasury Note Future... | - | 17,55 |
| US Treasury Bond Future June... | - | 11,06 |
| GS Alternative Trend IO Inc... | - | 5,99 |
| GS USD Treasury Liq Res X Inc | - | 5,46 |
| Goldman Sachs Institutional... | - | 3,44 |
| Ultra US Treasury Bond... | - | 3,18 |
| E-mini S&P 500 Future June 26 | - | 2,39 |
| Euro Schatz Future June 26 | - | 1,77 |
| Euro Bund Future June 26 | - | 1,57 |
| Ultra US Treasury Bond... | - | 1,44 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 53,85 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 510 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|--------|
| Governativo | 50,28 |
| Societario | 55,27 |
| Cartolarizzazioni | 16,14 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 9,81 |
| Derivati | -31,50 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 0,00 |
| 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 | 99,45 |
| Stati Uniti | 99,45 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| Europa | 0,44 |
| Regno Unito | 0,03 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,13 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,28 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| Asia | 0,11 |
| Giappone | 0,00 |
| Australasia | 0,00 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,00 |
| Asia - Emergente | 0,11 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 19,26 USD | Investimento Min. Ingresso | 50.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 1,15% |
| Data di Partenza | 26/05/2017 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,19% |
| Nome del Gestore | James Park | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2022 | ISIN | LU1613238705 | | |
| NAV (26/06/2026) | USD 15,10 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.138,70 USD | | | | |

(31/03/2026)

[See disclosures for more details](#)

© 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.