

Goldman Sachs Absolute Return Tracker Portfolio IO 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

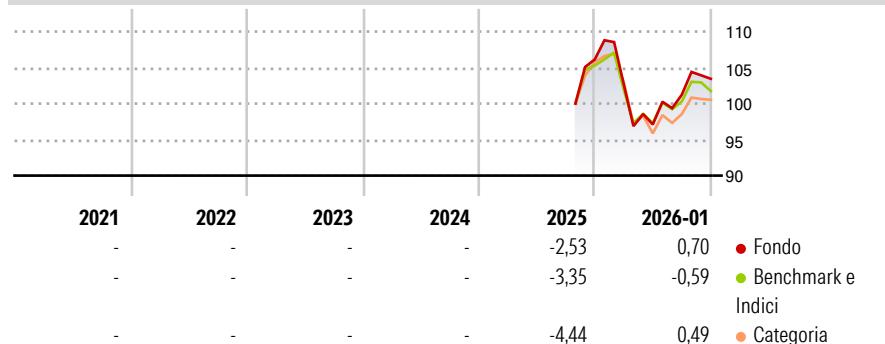
Morningstar Rating™

Senza 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



Misure di Rischio

	3Y Alpha	3Y Sharpe Ratio	-
	3Y Beta	3Y Std Dev	-
	3Y R-Squared	3Y Risk	-
	3Y Info Ratio	5Y Risk	-
	3Y Tracking Error	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,75	-0,92	0,59
6-Mesi	6,73	2,83	6,40
1-Anno	-3,32	-3,82	-2,85
3-Anni Ann.ti	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-3,27	-5,41	4,26	2,18
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/11/2025



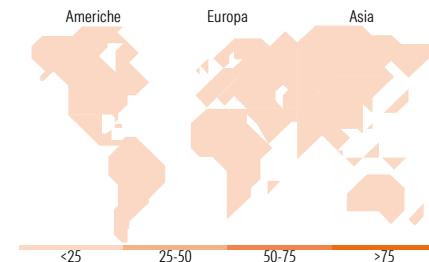
	Asset Allocation %	Netta
• Azioni	0,00	-
• Obbligazioni	39,96	-
• Liquidità	60,04	-
• Altro	0,00	-

Fixed Income Style



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	-	7,74
Federal Farm Credit Banks...	-	4,31
United States Treasury Notes...	-	3,53
United States Treasury Bills...	-	2,90
United States Treasury Notes...	-	2,67
United States Treasury Bills...	-	2,65
United States Treasury Bills...	-	2,57
United States Treasury Notes...	-	2,20
United States Treasury Bills...	-	2,05
Federal Farm Credit Banks...	-	1,79
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,41
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	-
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	45	-

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	44,62
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	55,38
Derivati	0,00

	Fondo
0 coupon	54,10
Da 0 a 4 cedole	25,80
Da 4 a 6 cedole	20,10
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 - Emergenti	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	4,98 USD	Investimento Min. Ingresso
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.
Data di Partenza	16/10/2024	UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU2911681240	0,14%
NAV (02/02/2026)	USD 11,23			
Patrimonio Netto (Mln)	1.190,46 USD			

(30/11/2025)

© 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 produttori; (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.