GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity IndexTotal Return

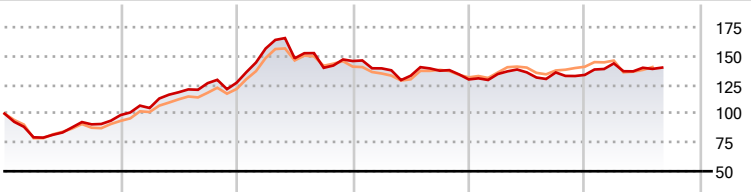
Portfolio A EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Trading Fund - Commodities	Not Categorized Usato nel Report	Bloomberg Commodity TR USD	Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Portfolio's investment objective is to replicate the performance of the Goldman Sachs Modified Strategy D266 on the Bloomberg Commodity Index Total Return (the "Strategy") which seeks to outperform the Bloomberg Commodity Index Total Return (the "Benchmark Index") while keeping the same sector weights. The Strategy is a "financial index" in the meaning of applicable UCITS Regulations. This implies that the Strategy will, at all times, satisfy the diversification, benchmark and publication criteria as applicable to financial indices under UCITS Regulations. Financial indices may make use of increased diversification limits: each component of a financial index may represent up to 20% of the index, except that one single component may...

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-08	
-1,25	28,43	14,83	-10,96	3,02	4,76	Fondo
-5,69	30,18	14,71	-6,92	6,76	-0,29	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,49
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,50
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Cat
3-Mesi	1,47	1,06
6-Mesi	0,88	-3,07
1-Anno	7,03	2,17
3-Anni Ann.ti	-3,57	-5,38
5-Anni Ann.ti	8,59	7,84
10-Anni Ann.ti	2,49	2,19

Rendimenti aggiornati al 28/08/2025

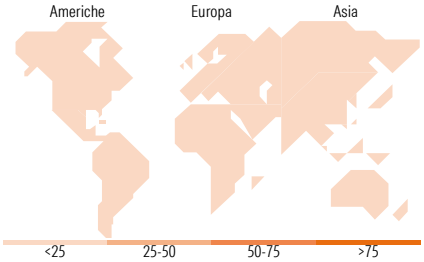
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	7,46	-2,62	-	-
2024	3,59	1,09	-0,06	-1,57
2023	-4,37	-4,58	3,27	-5,51
2022	23,39	-5,43	-5,57	4,22
2021	6,21	13,02	6,67	0,30

Portafoglio -

Asset Allocation %	Netta

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari		-
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		-

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	0,00
Derivati	0,00

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	**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	Amundi Luxembourg S.A.
Telefono	+352 47 676667
Web	www.amundi.com
Data di Partenza	19/05/2009
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	05/03/2009
NAV (28/08/2025)	EUR 9,46
Patrimonio Classe (Mln) (28/08/2025)	10,58 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0397155978
Investimento Min. Ingresso	1.000 EUR
Investimento Min. Successivo	1.000 EUR
T.E.R.	1,15%
Spese correnti	1,15%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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 prodotto; (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.

GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity IndexTotal Return

Patrimonio Netto (Mln) -

Portfolio A EUR

© 2025 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 prodotto; (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.