# **GSSI GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity Index Total Return**

### Categoria Morningstar™ Paoretfolio nGcGBP

Benchmark Morningstar

Not Categorized

#### **Benchmark Dichiarato**

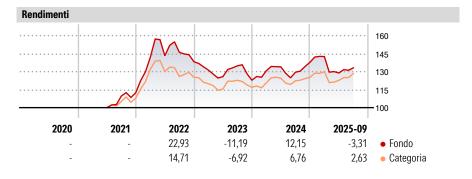
Bloomberg Commodity TR USD

## Morningstar Rating™

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...



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,54
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,16
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,54	4,97	Trimestrali %				
6-Mesi	2,47	7,63	2025	3,49	-9,57	3,33	-
1-Anno	3,61	6,99	2024	6,50	2,39	-3,34	6,40
3-Anni Ann.ti	-2,79	-0,42	2023	-5,03	-4,22	7,19	-8,91
5-Anni Ann.ti	-	-	2022	26,23	0,84	1,99	-5,31
10-Anni Ann.ti	-	=	2021	=	-	9,64	2,59

Fondo

#### Portafoglio

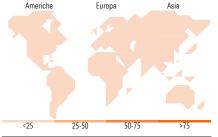
Asset	Allocation 9	% Nett

Box™	1	
		Qualità Alto I
		Med Med

Alta

Fixed Income Style

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 Obbligaz	ionari	-

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.	Patrimonio Classe (MIn)	26,66 GBP	Investimento Min. Ingresso	10.000 GBP
Telefono	+352 47 676667	(16/10/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.amundi.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,45%
Data di Partenza	08/06/2021	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	05/03/2009	Inc/Acc	Acc		
NAV (17/10/2025)	GBP 13,99	ISIN	LU0729061019		

## **GSSI GSQuartix Modified Strategy on the Bloomberg Commodity Index Total Return**

Patrimonio Netto (Mln)
Portfolio C GBP