

Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio R Inc GBP-Hedged

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

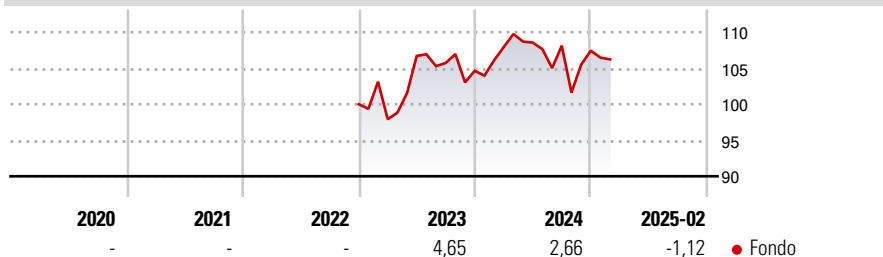
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Portfolio is to seek returns from persistent price trends in multiple asset classes and markets. The Portfolio aims to systematically measure the direction and strength of price trends and invest short, via financial derivatives only, or long, accordingly.

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,36
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,05
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

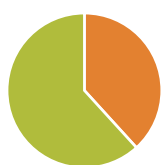
Rend. Cumulati %

Termine	Fondo
3-Mesi	-4,23
6-Mesi	-1,92
1-Anno	-3,37
3-Anni Ann.ti	3,67
5-Anni Ann.ti	3,56
10-Anni Ann.ti	-0,68

Rendimenti aggiornati al 12/03/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	3,14	0,58	-0,40	-0,64
2023	-2,08	8,96	-0,90	-1,02
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 31/12/2024

Asset Allocation %

Azioni	38,24
Obbligazioni	61,76
Liquidità	0,00
Altro	0,00

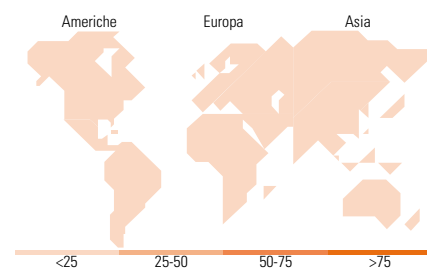
Fixed Income
Style Box™

		Quantità Credito	
		Alto	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa		
	Med		
		Bassa	Alta
		Med	Alta

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

-
-


Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	10,31
Federal Home Loan Banks 0%	-	8,98
Federal Home Loan Banks 0%	-	8,93
Federal Home Loan Banks 0%	-	8,85
Federal Home Loan Banks 0%	-	7,83
Federal Home Loan Banks 0%	-	7,38
Federal Home Loan Banks 0%	-	6,97
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	6,81
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,46
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,12
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,65
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		66

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	38,24
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	61,76
Derivati	0,00

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	72,10
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	27,90
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 %

Regione	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	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	1,01 GBP	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	0,85%
Data di Partenza	21/01/2015	UCITS	Si	Spese correnti	0,85%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/11/2020	ISIN	LU1103308638		
NAV (12/03/2025)	GBP 10,37				
Patrimonio Netto (Mln)	415,75 USD				

(31/12/2024)