Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio R Inc GBP-Hedged

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

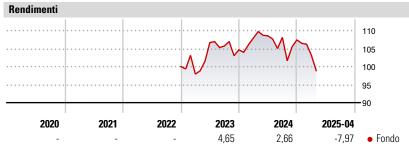
Benchmark DichiaratoICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,13
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,11
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

		,	, -			
Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	01	02	03	Q4
3-Mesi	-7,88	Trimestrali %				
6-Mesi	-7,25	2025	-3,99	-	-	-
1-Anno	-8,18	2024	3,14	0,58	-0,40	-0,64
3-Anni Ann.ti	0,44	2023	-2,08	8,96	-0,90	-1,02
5-Anni Ann.ti	2,95	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 08/05/2025	-0,51	2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/04/2025





Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	3,15
Euro Bobl Future June 25	_	3,01
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	2,58
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	2,58
Us 5yr Note (Cbt) Jun25 Xcbt	_	2,55
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	2,54
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,26
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	1,64
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		20,31
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazi	onari	76

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	77,52
Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	22,51
■ Derivati	-0,03
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	95,77
Da 0 a 4 cedole	2,11
Da 4 a 6 cedole	2,12
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

<25	25-50	50-75	>75
Ripartizione	e Geografica	%	Fondo
America			0,00
Stati Uniti			-
Canada			-
America Lati	na e Centrale		-
Europa			0,00
Regno Unito			-
Europa Occid	entale - Euro		-
Europa Occid	entale - Non E	Euro	-
Europa dell'E	st		-
Africa			-
Medio Orient	te		-
Asia			0,00
Giappone			-
Australasia			-
Asia - Paesi	Sviluppati		-
Asia - Emerg	ente		-

Anagrafica	
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	21/01/2015
Nome del Gestore	James Park
Data Inizio Gestione	01/11/2020
NAV (08/05/2025)	GBP 9,96
Patrimonio Netto (MIn)	1.276,48 USD
(30/04/2025)	

Patrimonio Cla	asse (MIn)	0,89 GBF
(08/05/2025)		
Domicilio		LUSSEMBURGO
Valuta del For	ndo	GBF
UCITS		S
Inc/Acc		Inc
ISIN		LU1103308638

Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,85%
Spese correnti	0,85%
Commissione di incentivo	-