

# Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio I Acc JPY-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	-1,34
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,38
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

**Rend. Cumulati %**

Periodo	Rend. Cumulati %
3-Mesi	1,39
6-Mesi	-1,69
1-Anno	-8,40
3-Anni Ann.ti	-10,31
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-3,24	-	-	-
2025	-3,08	-7,35	-1,24	-5,94
2024	-4,38	-6,76	4,46	-4,50
2023	-	-3,46	-1,33	-1,30
2022	-	-	-	-

**Portafoglio 28/02/2026**

**Asset Allocation %**

Azioni	34,84
Obbligazioni	65,16
Liquidità	0,00
Altro	0,00

**Netta**

Azioni	0,00
Obbligazioni	65,16
Liquidità	34,84
Altro	0,00

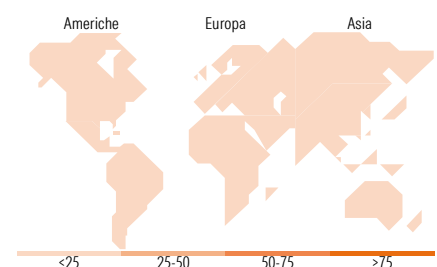
**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

 Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-


**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	10,60
Federal Home Loan Banks 0%	-	8,16
Federal Home Loan Banks 0%	-	7,48
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,82
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,81
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,69
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,55
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,50
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,22
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,69
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		64,52
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		66

**Fixed Income Sector Weightings %**

Settore	Fondo
Governativo	65,83
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	34,17
Derivati	0,00

**Coupon Range %**

Range	Fondo
0 coupon	85,01
Da 0 a 4 cedole	14,66
Da 4 a 6 cedole	0,33
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
<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

**Anagrafica**

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	13,73 JPY	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 JPY
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	JPY	T.E.R.	0,76%
Data di Partenza	23/03/2023	UCITS	Si	Spese correnti	0,76%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/11/2020	ISIN	LU2591850412		
NAV (26/06/2026)	JPY 882,50				
Patrimonio Netto (Mln)	392,49 USD				

(28/02/2026)

[See disclosures for more details](#)

© 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 prodotte; (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.