

Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio I Acc JPY-Hedged

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

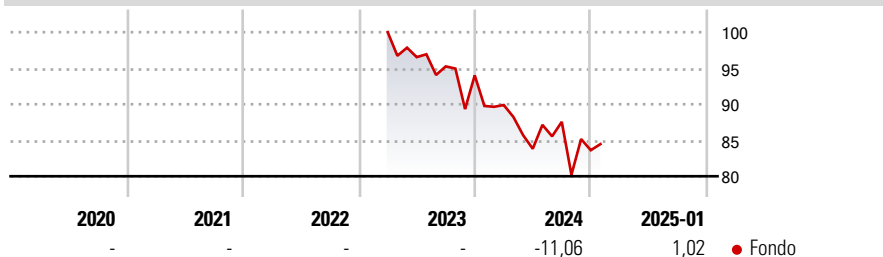
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

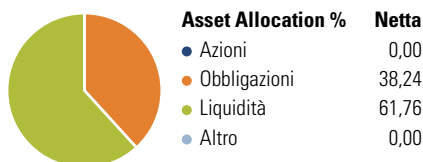
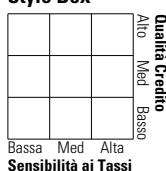
Rend. Cumulati %

Termine	Fondo
3-Mesi	5,19
6-Mesi	-3,14
1-Anno	-5,89
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

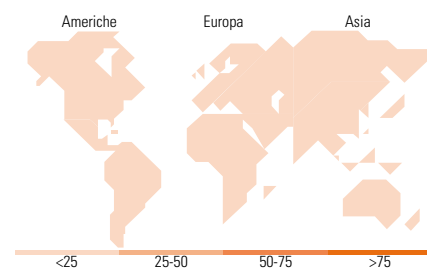
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	-4,38	-6,76	4,46	-4,50
2023	-	-3,46	-1,33	-1,30
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 31/12/2024

Fixed Income
Style Box™


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 %

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

Coupon Range %

Coupon 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 %

Region	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)	3.775,67 JPY	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 JPY
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	JPY	T.E.R.	0,77%
Data di Partenza	23/03/2023	UCITS	Si	Spese correnti	0,77%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/11/2020	ISIN	LU2591850412		
NAV (04/02/2025)	JPY 941,80				
Patrimonio Netto (Mln)	415,75 USD				

(31/12/2024)