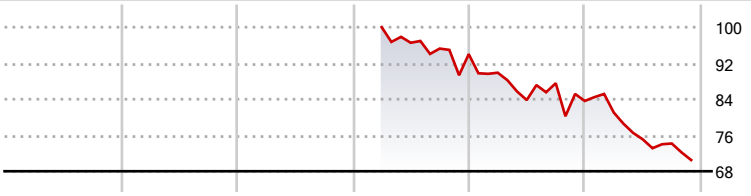
Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio I Acc JPY-Hedged

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001013	Not Categorized Usato nel Report	ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD	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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
-	-	-	-	-11,06	-15,69	● Fondo

Misure di Rischio

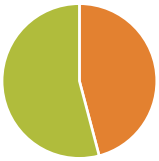
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	-4,23
6-Mesi	-7,53
1-Anno	-16,99
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-3,08	-7,35	-1,24	-
2024	-4,38	-6,76	4,46	-4,50
2023	-	-3,46	-1,33	-1,30
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

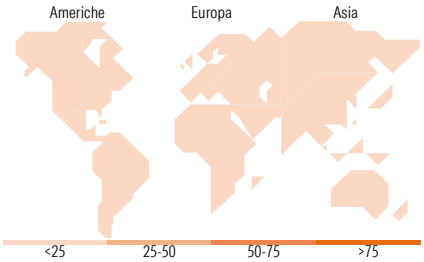
Portafoglio 30/09/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	45,89
Liquidità	54,11
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	—	14,46
Federal Home Loan Banks 0%	—	9,91
Federal Home Loan Banks 0%	—	9,19
Federal Home Loan Banks 0%	—	8,25
Federal Home Loan Banks 0%	—	8,03
Federal Home Loan Banks 0%	—	5,69
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,98
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,97
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,69
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,59
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		72,76
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		32

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	45,89
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	54,11
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	80,85
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	19,15
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	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	23/03/2023
Nome del Gestore	James Park
Data Inizio Gestione	01/11/2020
NAV (05/12/2025)	JPY 891,67
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	431,36 USD

Patrimonio Classe (Mln) (05/12/2025)	13,87 JPY
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	JPY
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2591850412

Investimento Min. Ingresso	100.000.000 JPY
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,76%
Spese correnti	0,76%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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 prodotto; (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.