

Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio I Acc JPY-Hedged

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

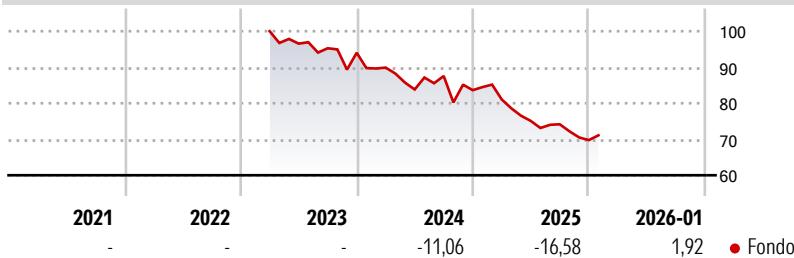
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

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 %

| | Fondo |
|----------------|--------|
| 3-Mesi | -0,23 |
| 6-Mesi | -2,46 |
| 1-Anno | -16,92 |
| 3-Anni Ann.ti | - |
| 5-Anni Ann.ti | - |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

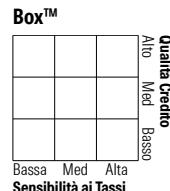
Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 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 30/11/2025

Asset Allocation %

| | |
|----------------|-------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 33,68 |
| ● Liquidità | 66,32 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style Box™

Fondo

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media



<25

25-50

50-75

>75

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 20,11 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 13,69 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 9,18 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 7,99 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 6,41 |
| GS USD Treasury Liq Res X Inc | — | 5,74 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 5,38 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 4,99 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 4,98 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 3,68 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | 82,15 | |
| Numeri Complessivi di Titoli Azionari | 0 | |
| Numeri Complessivi di Titoli Obbligazionari | 26 | |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 33,68 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 66,32 |
| Derivati | 0,00 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 76,45 |
| Da 0 a 4 cedole | 4,92 |
| Da 4 a 6 cedole | 18,63 |
| 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 - Emergenti | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|------------------|----------------------------|------------------------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 14,07 JPY | Investimento Min. Ingresso | 100.000.000 JPY |
| Telefono | +31-703781781 | (12/02/2026) | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo |
| Web | https://am.gs.com/ | | Valuta del Fondo | JPY | T.E.R. |
| Data di Partenza | 23/03/2023 | | UCITS | Si | Spese correnti |
| Nome del Gestore | James Park | | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo |
| Data Inizio Gestione | 01/11/2020 | | ISIN | LU2591850412 | |
| NAV (11/02/2026) | JPY 910,12 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 431,17 USD | | | | |
| (30/11/2025) | | | | | |