

Goldman Sachs Alternative Trend Portfolio Other Currency Acc EUR-Hedged

Categoria Morningstar™
Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

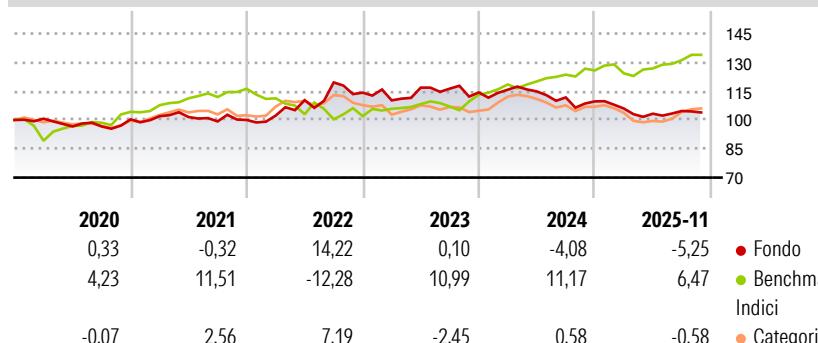
Benchmark Dichiarato
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar 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 | -5,34 | 3Y Sharpe Ratio | -0,73 |
| 3Y Beta | -0,05 | 3Y Std Dev | 7,60 |
| 3Y R-Squared | 0,17 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | -1,08 | 5Y Risk | -Med |
| 3Y Tracking Error | 10,14 | 10Y Risk | -Med |

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

| 3-Mesi | -0,10 |
|----------------|-------|
| 6-Mesi | 1,69 |
| 1-Anno | -4,86 |
| 3-Anni Ann.ti | -2,76 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,14 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,09 |

| Fondo | Bmk | Cat |
|-------|------|-----|
| 2,55 | 1,99 | |
| 4,31 | 5,18 | |
| 2,73 | 4,39 | |
| 1,88 | 8,27 | |
| 2,82 | 5,22 | |
| 0,95 | 5,28 | |

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2025 | -3,37 | -2,56 | 1,37 | - |
| 2024 | 1,23 | -0,75 | -2,74 | -1,85 |
| 2023 | -3,52 | 6,01 | -0,46 | -1,68 |
| 2022 | 2,28 | 7,86 | 8,37 | -4,45 |
| 2021 | 1,62 | -0,43 | -2,25 | 0,77 |

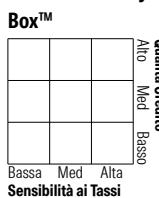
Rendimenti aggiornati al 12/12/2025

Portafoglio 30/09/2025



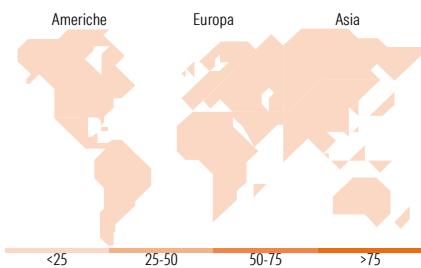
| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| • Azioni | 0,00 |
| • Obbligazioni | 45,89 |
| • Liquidità | 54,11 |
| • Altro | 0,00 |

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



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 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari | 0 | |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari | 32 | |

Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo | Governativo |
|-------|--------------------------|
| | 45,89 |
| | Societario |
| | Cartolarizzazioni |
| | Enti Locali |
| | Liquidità ed equivalenti |
| | Derivati |

Ripartizione Geografica %

| Fondo | America |
|-------|-------------------------------|
| | 0,00 |
| | Stati Uniti |
| | Canada |
| | America Latina e Centrale |
| Fondo | Europa |
| | Regno Unito |
| | Europa Occidentale - Euro |
| | Europa Occidentale - Non Euro |
| | Europa dell'Est |
| | Africa |
| | Medio Oriente |
| Fondo | Asia |
| | 0,00 |
| | Giappone |
| | Australasia |
| | Asia - Paesi Sviluppati |
| | Asia - Emergenti |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,72 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 1,53% |
| Data di Partenza | 21/01/2015 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,53% |
| Nome del Gestore | James Park | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/11/2020 | ISIN | LU1103308554 | | |
| NAV (12/12/2025) | EUR 9,60 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 431,36 USD | | | | |
| (30/09/2025) | | | | | |