

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

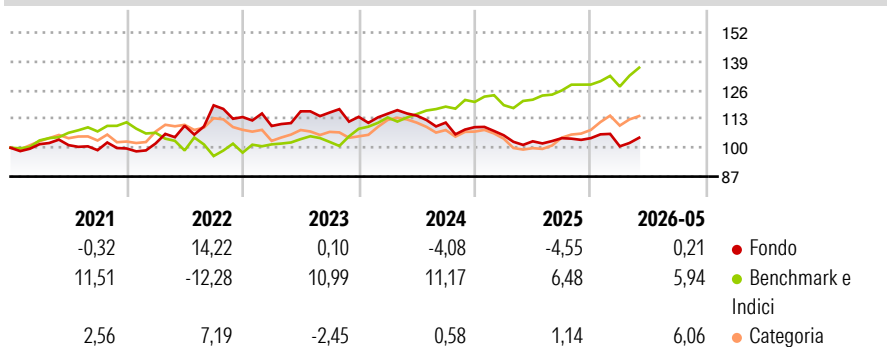
Morningstar Rating™

★★★

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	-6,92	3Y Sharpe Ratio	-0,60
3Y Beta	0,33	3Y Std Dev	7,73
3Y R-Squared	7,76	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-1,39	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	8,59	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,28	6,05	5,55
6-Mesi	2,09	7,32	8,72
1-Anno	4,27	13,39	13,32
3-Anni Ann.ti	-2,68	9,65	6,03
5-Anni Ann.ti	1,14	5,30	2,55
10-Anni Ann.ti	0,90	5,99	1,37

Rendimenti aggiornati al 18/06/2026

Rendimenti

Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-3,53	-	-	-
2025	-3,37	-2,56	1,37	0,00
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

Portafoglio 28/02/2026



Asset Allocation %

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

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa	Med	Alta

Fondo
Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



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 %

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

Coupon 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 %

	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)	0,65 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.	-
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 (18/06/2026)	EUR 9,77				
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.