

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 Trsry 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.



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	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,81	2026	-	-	-	-
6-Mesi	-2,93	2025	-3,08	-7,35	-1,24	-5,94
1-Anno	-16,07	2024	-4,38	-6,76	4,46	-4,50
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-3,46	-1,33	-1,30
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-					

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	-

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo 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 - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	14,09 JPY	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 JPY
Telefono	+31-703781781	(02/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	23/03/2023	Valuta del Fondo	JPY	Spese correnti	0,76%
Nome del Gestore	James Park	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/11/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (02/02/2026)	JPY 906,03	ISIN	LU2591850412		
Patrimonio Netto (Mln)	431,17 USD				

(30/11/2025)