

# GS Alternative Tr.Portf.I SEK H (LU2426088105)

KAG: Goldman Sachs AM BV    ISIN: LU2426088105    Rücknahmepreis: 119,82 SEK    Stand: 26.06.2024

|  |                            |
|--|----------------------------|
| Auflagedatum   | 31.01.22                   |
| Ausgabeaufschlag   | -                          |
| Konditionsdetails auf <a href="http://www.easybank.at">www.easybank.at</a> |                            |
| Fondsvolumen   | 4.209.40 Mio.              |
| Ertragstyp   | thesaurierend              |
| Letzte Ausschüttung  | keine                      |
| Anlageregion   | weltweit                   |
| Fondstyp   | AI Managed Futures         |
| Fondsmanager   | James Park, Oliver Bunn... |



|  |  |
|--|--|
| <b>Kapitalanlagegesellschaft</b>               |  |
| Goldman Sachs AM BV                            |  |
| Schenkkade 65                                  |  |
| 2509 LL Den Haag                               |  |
| Niederlande                                    |  |
| <a href="http://www.gsam.com">www.gsam.com</a> |  |

| <b>Wertentwicklung*</b>   |  | <b>1J</b> | <b>3J p.a.</b> | <b>5J p.a.</b> |
|---------------------------|--|-----------|----------------|----------------|
| Performance vor AGA       |  | +1,49%    | -              | -              |
| Performance nach max. AGA |  | +1,49%    | -              | -              |

  

| <b>Kennzahlen*</b> |  | <b>1J</b> | <b>3J</b> | <b>5J</b> |
|--------------------|--|-----------|-----------|-----------|
| Sharpe Ratio       |  | -0,28     | -         | -         |
| Volatilität        |  | +7,89%    | -         | -         |

\* Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

## Fondsstrategie

Das Anlageziel des Portfolios besteht darin, eine Handelsstrategie (die "Strategie") umzusetzen, die auf die Erzielung einer ähnlichen Renditen wie ein Portfolio (bzw. Korb) von Investmentfonds, die Trend-Strategien ("Trend-Strategien") nutzen, ausgerichtet ist. Trend-Strategien streben üblicherweise danach, aus Aufwärts- oder Abwärtsbewegungen verschiedener Märkte durch Long-Positionen (Kaufpositionen) bzw. Short-Positionen (Verkaufpositionen) an den jeweiligen Märkten in Abhängigkeit von den direktionalen Trends in diesen Märkten Gewinne zu erwirtschaften. Trends werden durch Beobachtung historischer Preise in den Märkten über mehrere Zeiträume hinweg identifiziert.

Der Anlageberater beabsichtigt, bei der Umsetzung der Strategie anhand einer mathematischen Formel Trends in bestimmten Märkten zu erkennen und festzulegen, wann und in welcher Höhe das Portfoliovermögen jedem Markt zugeteilt werden soll. Zu diesen Märkten können Märkte für Zinssätze, Staatsanleihen, Aktien, Rohstoffe und Währungen zählen. Der Anlageberater kann Märkte und/oder Sektoren von Zeit zu Zeit in seinem alleinigen Ermessen entfernen oder neue Märkte und/oder Sektoren hinzufügen.

## Kommentar:

## Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des GS Alternative Tr.Portf.I SEK H wurden durch die FMA bewilligt. Der GS Alternative Tr.Portf.I SEK H kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by a Member State, its local authorities, a member state of the OECD or the Group of twenty (G20), by the Republic of Singapore, by the Hong Kong Special Administrative Region of the People's Republic of China or public international bodies of which one or more Member States are members.

### Anlagearten



### Größte Positionen



### Länderverteilung



### Branchenverteilung



Historische Daten: 06/2024

Erstellt: 30.06.2024 15:14