

Goldman Sachs Alternative Beta - I Cap USD (LU0370038837)

KAG: Goldman Sachs AM BV

ISIN: LU0370038837

Rücknahmepreis: 8387,43 USD

Stand: 27.05.2024

Auflagedatum	16.06.08
Ausgabeaufschlag	2,00%
Konditionsdetails auf www.easybank.at	
Fondsvolumen	227.27 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Hedgefonds Multi Strategies
Fondsmanager	David Koops, Daan van...

Kapitalanlagegesellschaft

Goldman Sachs AM BV
Schenkkade 65
2509 LL Den Haag
Niederlande
www.gsam.com



Wertentwicklung*

	IJ	3J p.a.	5J p.a.
Performance vor AGA	+11,13%	+3,65%	+6,96%
Performance nach max. AGA	+8,95%	+2,97%	+6,54%

Kennzahlen*

	IJ	3J	5J
Sharpe Ratio	1,33	-0,02	0,41
Volatilität	+5,54%	+6,58%	+7,66%

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

Fondsstrategie

Der Teilfonds wird aktiv verwaltet und strebt ein langfristiges Kapitalwachstum an, indem er in eine Reihe liquider Finanzmarkt-Betas investiert, wobei die Allokation von unseren proprietären, komplexen quantitativen Modellen bestimmt wird. Diese hoch entwickelten Modelle zielen darauf ab, die wichtigsten Renditetreiber innerhalb von Themen mit guter Performance in alternativen Märkten wie etwa der Hedgefondsbranche zu erfassen, die unabhängig von den herrschenden Marktbedingungen nach positiven Renditen strebt.

Zu diesem Zweck wird ein Engagement in den entsprechenden Märkten hauptsächlich (d. h. zu mindestens 2/3 des Nettovermögens) über ein breites Spektrum von Indizes eingegangen, indem in lineare (z. B. Total Return Swaps, Futures, Forwards) und nicht lineare derivative Finanzinstrumente (z. B. Optionen), Kassainstrumente, festverzinsliche Instrumente (z. B. Barmittel, Geldmarkt, Anleihen, Einlagen) investiert wird. Der Teilfonds hat keinen Referenzwert. Für das Risikomanagement des Fonds sind strenge Risikokontrollen vorhanden. Anteile können an jedem (Geschäfts-)Tag verkauft werden, an dem der Wert der Anteile berechnet wird, im Falle dieses Fonds also täglich.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des Goldman Sachs Alternative Beta - I Cap USD wurden durch die FMA bewilligt. Der Goldman Sachs Alternative Beta - I Cap USD kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: Member State of the European Union or the Organisation for Economic Cooperation and Development (OECD), by local public authorities of an Member State of the European Union, or by international public bodies to which one or more Member States of the European Union belong.

Anlagearten



Größte Positionen



Länderverteilung



Branchenverteilung



Historische Daten: 05/2024

Erstellt: 28.05.2024 22:44