

Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities - Z Cap EUR (hedged

KAG: Goldman Sachs AM BV

ISIN: LUI365052544

Rücknahmepreis: 5501,21 EUR

Stand: 22.11.2024

Auflagedatum	29.03.16
Ausgabeaufschlag	-
Konditionsdetails auf www.bawag.at	
Fondsvolumen	13.83 Mio.
Ertragstyp	thesaurierend
Letzte Ausschüttung	keine
Anlageregion	weltweit
Fondstyp	AI Hedgefonds Multi Strategies
Fondsmanager	David Koops, Stan Verhoeven...
Kapitalanlagegesellschaft	
Goldman Sachs AM BV	
Schenkade 65	
2509 LL Den Haag	
Niederlande	
www.gsam.com	



Wertentwicklung*		1J	3J p.a.	5J p.a.
Performance	vor AGA	-9,97%	-	-
Performance	nach max. AGA	-9,97%	-	-
Kennzahlen*		1J	3J	5J
Sharpe Ratio		-1,65	-	-
Volatilität		+7,89%	-	-

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

Fondsstrategie

Ziel des Teilfonds ist die Erwirtschaftung eines langfristigen Kapitalzuwachses durch Anlage in einer Reihe von Faktoren (wie Momentum, Value, Carry und Volatilität), die von regelbasierten Long/Short-Strategien erfasst werden. Die Faktoren weisen bestimmte Merkmale auf, die bei der Erklärung des Zustandekommens ihrer Erträge eine Rolle spielen. Mit Momentum soll von der Tendenz profitiert werden, dass sich die relative Wertentwicklung eines Vermögenswerts in nächster Zeit fortsetzt. Mit Value soll von Bewertungen profitiert werden, die als unangemessen erachtet werden, und zwar durch den Kauf von unterbewerteten und den Verkauf von überbewerteten Vermögenswerten. Mit Carry soll von der Tendenz profitiert werden, dass Instrumente mit höheren Renditen meist eine bessere Wertentwicklung aufweisen als Instrumente mit niedrigeren Renditen. Mit Volatilität soll davon profitiert werden, dass die Volatilität tendenziell auf höherem Niveau notiert als die letztlich tatsächlich realisierte Volatilität.

Der Fonds ist bestrebt, sein Anlageziel primär durch den Einsatz von Derivaten zu erreichen. Der Fonds kann auch zu Absicherungszwecken Derivate einsetzen. Eine Exponierung gegenüber Rohstoffen kann über die Nutzung von Rohstoffindizes erreicht werden. Dieser Fonds ist bestrebt, den 1-Monats-SOFR-Zinssatz über einen Zeitraum von fünf Jahren zu übertreffen. Der Fonds wird aktiv gemanagt. Der Referenzwert, der 1-Monats-SOFR, wird nicht zum Aufbau des Portfolios herangezogen, sondern dient lediglich als Maßstab zur Messung der Wertentwicklung. Bei dieser Anteilsklasse, die gegenüber dem britischen Pfund abgesichert ist, dient der 1-Monats-Sonia als Referenzwert zur Messung der Wertentwicklung.

Kommentar:

Fondsspezifische Information

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Aufgrund der Zusammensetzung des Fonds oder der verwendeten Managementtechniken weist der Fonds eine erhöhte Volatilität auf, d.h. die Anteilswerte sind auch innerhalb kurzer Zeiträume großen Schwankungen nach oben und nach unten ausgesetzt, wobei auch Kapitalverluste nicht ausgeschlossen werden können. Die Fondsbestimmungen des Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities - Z Cap EUR (hedged i) wurden durch die FMA bewilligt. Der Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities - Z Cap EUR (hedged i) 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: 12/2024

Erstellt: 03.12.2024 20:53