

Goldman Sachs Multi Factor

dawniej NN (L) Multi Factor

INFORMACJE O FUNDUSZU

| | | | |
|----------------------------------|---------------------|---------------------------------|---|
| Typ funduszu | alternatywny | Benchmark | brak |
| Kategoria jednostki uczestnictwa | A | Opłata za zarządzanie | 1,50% |
| Początek działalności funduszu | 15.10.2010 | Opłata za wyniki | brak |
| Aktywa (30.06.2023) | 69 mln PLN | Maksymalna opłata dystrybucyjna | 3,00% |
| Wartość jednostki uczestnictwa | 173,95 PLN | Klasyfikacja SFDR | Artykuł 6 |
| Minimalna pierwsza wpłata | 200 PLN | Fundusz źródłowy | Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities |
| Minimalna kolejna wpłata | 50 PLN | | |

O FUNDUSZU

Goldman Sachs Multi Factor inwestuje do 100% środków w źródłowy fundusz zagraniczny Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities. Aktywa funduszu źródłowego są inwestowane z wykorzystaniem tzw. czynników (z ang. factors), takich jak dynamika, wartość, czynnik „carry” i zmienność (ang. momentum, value, carry, volatility). Te czynniki generują sygnały inwestycyjne do zajmowania zarówno długich jak i krótkich pozycji (długich nastawionych na wzrost kursów, krótkich - na spadek) na rynkach wielu klas aktywów - akcji, obligacji, walut oraz indeksów towarowych i surowcowych.

JAK ZARZĄDZAMY

- Do realizacji strategii fundusz źródłowy wykorzystuje różne instrumenty finansowe, w szczególności instrumenty pochodne,
- fundusz źródłowy może w całości składać się z gotówki lub jej ekwiwalentów w celu finansowania instrumentów pochodnych,
- fundusz źródłowy jest aktywnie zarządzany, a jego benchmarkiem jest indeks Secured Overnight Financing Rate (SOFR). Celem funduszu źródłowego nie jest odzwierciedlenie tego benchmarku. Inwestycje funduszu źródłowego mogą istotnie odbiegać od benchmarku,
- obok funduszu źródłowego, na zasadach określonych w prospekcie, mamy możliwość inwestowania aktywów również w inne instrumenty finansowe.

RYZIKO INWESTYCYJNE

Niższe ryzyko

potencjalnie niższy zysk

Wyższe ryzyko

potencjalnie wyższy zysk



Profil ryzyka został wskazany na podstawie metodologii użytej w Dokumencie Zawierającym Kluczowe Informacje (KID) i jest aktualny na dzień sporządzenia Karty Funduszu. Na podstawie danych historycznych użytych do przypisania kategorii ryzyka, nie można przewidzieć przyszłego profilu ryzyka Funduszu. Celem Funduszu nie jest osiągnięcie danej kategorii ryzyka. Profil ryzyka i zysku może w przyszłości ulegać zmianom. Najniższa kategoria ryzyka [1] nie oznacza, że inwestycja jest pozbawiona ryzyka.

REKOMENDOWANY MINIMALNY HORYZONT INWESTYCYJNY



DLA KOGO?

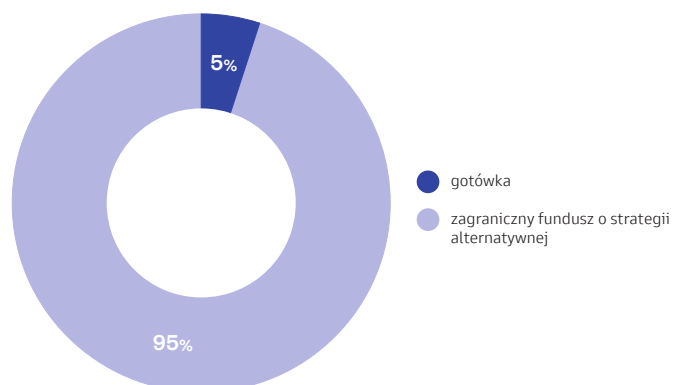
Ten fundusz jest dla osób, które:

- chcą inwestować nie krócej niż 5 lat,
- oczekują zysków wyższych niż w przypadku depozytów bankowych,
- akceptują średnio niską klasę ryzyka funduszu.

Warto wiedzieć: więcej o funduszu Goldman Sachs Multi Factor przeczytasz w prospekcie informacyjnym i kluczowych informacjach. Obydwa dokumenty publikujemy na stronie www.gstfi.pl.

Do dnia 19 lipca 2020 r. fundusz działał pod nazwą NN (L) Dynamiczny Globalnej Alokacji. Wyniki osiągnięte do tego dnia są efektem realizowania innej strategii inwestycyjnej niż obecnie.

MODELOWA STRUKTURA PORTFELA



ALTERNATYWNY

AKCJI

OBLIGACJI

MIESZANY

KRÓTKOTERM. DŁUŻNY

ZDEFIN. DATY (PPK)

CYKLU ŻYCIA

ZMIANA WARTOŚCI JEDNOSTKI UCZESTNICTWA

za okres od 15.10.2010 do 30.06.2023



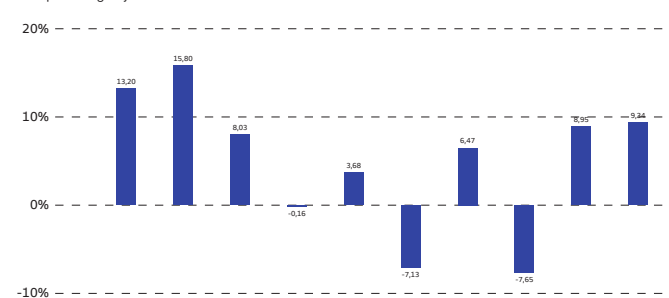
WYNIKI FUNDUSZU

% na dzień 30.06.2023

| | 1 m | 3 m | 6 m | 12 m | 36 m | 60 m | 120 m | od pocz. roku | max |
|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|---------------|-------|
| ● fundusz | -1,16 | -3,83 | -2,08 | -1,22 | 13,58 | 9,24 | 47,79 | -2,08 | 73,95 |

WYNIKI ROCZNE FUNDUSZU

% dla poszczególnych lat



| | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 |
|-----------|-------|-------|------|-------|------|-------|------|-------|------|------|
| ● fundusz | 13,20 | 15,80 | 8,03 | -0,16 | 3,68 | -7,13 | 6,47 | -7,65 | 8,95 | 9,34 |

SKŁAD PORTFELA

NAJWIĘKSZE POZYCJE W PORTFELU

dane na dzień 30.06.2023

| NAZWA | UDZIAŁ W PORTFELU |
|-----------------------|-------------------|
| TRSWAP: BCOMPBC | 32,49% |
| TREASURY BILL | 31,66% |
| TRSWAP: BCOMZSC INDEX | 20,79% |
| TRSWAP: BCOMSYC INDEX | 19,50% |
| TRSWAP: BCOMSMC INDEX | 19,03% |
| CAN 10YR BOND SEP 23 | -23,64% |
| TRSWAP: BCOMLCC INDEX | -23,64% |
| TRSWAP: BCOMSIC INDEX | -24,90% |
| US 10YR NOTE SEP 23 | -38,79% |
| TRSWAP: BCOMGCC INDEX | -63,98% |

OTWARTE POZYCJE WALUTOWE

dane na dzień 30.06.2023

| NAZWA | UDZIAŁ W PORTFELU |
|-------|-------------------|
| SEK | 23,24% |
| GBP | 22,35% |
| NZD | 13,73% |
| JPY | 13,64% |
| EUR | 2,16% |
| Inne | 24,88% |

FUNDUSZ

„Fundusz” jest powszechnym terminem używanym do określenia różnego rodzaju form zbiorowego inwestowania, w tym „subfunduszy”, które wchodzi w skład naszych funduszy parasolowych.

JEDNOSTKA UCZESTNICTWA

Fundusz „emituje” jednostki uczestnictwa dla inwestorów. Potwierdzają one prawo do określonej części majątku funduszu oraz wykonywania innych praw wynikających z uczestnictwa w funduszu. Wartość jednostki uczestnictwa ustala się dzieląc wartość aktywów funduszu przez liczbę jednostek będących w posiadaniu wszystkich uczestników.

KLASYFIKACJA SFDR

SFDR to rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2019/2088 w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych. SFDR obejmuje m.in. system klasyfikacji produktów inwestycyjnych do jednej z trzech kategorii w zależności od podejścia do kwestii zrównoważonego rozwoju. W Goldman Sachs TFI produkty klasyfikowane zgodnie z art. 6 integrują ryzyka dla zrównoważonego rozwoju w procesie inwestycyjnym, a te z art. 8 promują aspekty środowiskowe i społeczne, natomiast produkty zaklasyfikowane zgodnie z art. 9 za swój cel mają zrównoważone inwestycje.

Czytaj więcej na: www.gstfi.pl/o-nas/zrownowazony-rozwoj

OPŁATY ZA ZARZĄDZANIE

Stała opłata za zarządzanie to podstawowe wynagrodzenie pobierane przez towarzystwo funduszy inwestycyjnych za zarządzanie funduszem. Ustalana jest jako procent pobierany od aktywów zarządzanego funduszu w skali roku. Część towarzystw może pobierać również opłatę zmienną w przypadku spełnienia się warunków w postaci osiągnięcia przez zarządzającego określonego poziomu wyników mierzonych w relacji do określonego punktu odniesienia (np. benchmarku).

BENCHMARK

Wzorzec stanowiący punkt odniesienia do oceny wyników zarządzania funduszem. Jako benchmark mogą służyć między innymi: indeks giełdowy, rentowność określonych instrumentów skarbowych lub ich kombinacje.

KATEGORIA JEDNOSTKI UCZESTNICTWA

Jednostki uczestnictwa naszych funduszy mogą być dostępne w różnych kategoriach. Różnią się one między sobą sposobem i wielkością pobieranych opłat. Podstawową jest kategoria „A”, ale są też takie, które są zbywane w ramach pracowniczych programów czy indywidualnych kont emerytalnych.

RATING ANALIZ ONLINE

Kompleksowa ocena funduszu, której dokonuje niezależna firma analityczna. Na ocenę składają się zarówno parametry ilościowe (np. efektywność funduszu, powtarzalność wyników, maksymalne obsunięcie kapitału), jak i jakościowe (np. pozycja rynkowa firmy, transparentność czy kapitał ludzki). Efektem tej analizy są gwiazdki (od jednej do pięciu). Im jest ich więcej, tym lepiej oceniona jakość funduszu.

OPŁATA DYSTRYBUCYJNA

Ta opłata jest wynagrodzeniem dystrybutora za pośrednictwo w sprzedaży jednostek uczestnictwa. Podaje się ją jako procent pobierany od wpłaconej przez inwestorów kwoty. Wysokość opłaty dystrybucyjnej waha się w zależności od dystrybutora i zazwyczaj maleje wraz z rosnącą sumą środków wpłaconych do funduszu.

**CHCESZ WIEDZIEĆ
WIĘCEJ?**



ZOBACZ SKŁAD
PORTFELA



WEJDŹ NA GSTFI.PL
LUB ZAPYTAJ SWOJEGO
DORADCĘ

Niniejszy materiał został przygotowany przez Goldman Sachs Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. (Goldman Sachs TFI) i posiada charakter reklamowy. Goldman Sachs TFI posiada zezwolenie Komisji Nadzoru Finansowego na prowadzenie działalności. Podany w niniejszym dokumencie profil ryzyka funduszu jest oparty na metodologii stosowanej w Dokumencie Zawierającym Kluczowe Informacje (KID). Największe pozycje, alokacja sektorowa, geograficzna, walutowa oraz wskaźniki ryzyka - dane dotyczą funduszu źródłowego Goldman Sachs Multi Asset Factor Opportunities. Stopy zwrotu mają charakter historyczny. Goldman Sachs TFI i Fundusze Inwestycyjne Goldman Sachs nie gwarantują osiągnięcia celów inwestycyjnych funduszy i subfunduszy ani uzyskania podobnych wyników w przyszłości.

Inwestycje w Fundusze Inwestycyjne Goldman Sachs są obarczone ryzykiem inwestycyjnym, a Uczestnik musi liczyć się z istnieniem możliwości utraty części zainwestowanych środków. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji nie jest tożsama z wynikiem inwestycyjnym Subfunduszu i jest uzależniona od wartości jednostki uczestnictwa w momencie jej zbycia i odkupienia przez Subfundusz oraz od wysokości pobranych opłat manipulacyjnych i należnych podatków. Tabele Opłat znajdują się na stronie www.gstfi.pl.

Niniejszy materiał nie jest dokumentem informacyjnym wymaganym na mocy przepisów prawa nie zawiera informacji wystarczających do podjęcia decyzji inwestycyjnej. Informacje o Funduszach Inwestycyjnych zarządzanych przez Goldman Sachs TFI oraz o ich ryzyku inwestycyjnym sporządzone w języku polskim zawarte są w Prospektach Informacyjnych dostępnych w siedzibie Goldman Sachs TFI i na stronie www.gstfi.pl oraz w Dokumencie Zawierającym Kluczowe Informacje (KID) i Informacjach dla klienta alternatywnego funduszu inwestycyjnego dostępnych w siedzibie Goldman Sachs TFI, u Dystrybutorów i na stronie www.gstfi.pl (<https://www.gstfi.pl/informacje-i-dokumenty/dokumenty-funduszy/prospekty-informacyjne>). Informacje odnośnie praw inwestorów sporządzone w języku polskim znajdują się w Prospektach Informacyjnych dostępnych w siedzibie Goldman Sachs TFI u Dystrybutorów i na stronie www.gstfi.pl (<https://www.gstfi.pl/informacje-i-dokumenty/dokumenty-funduszy/prospekty-informacyjne>).

Wartość aktywów netto wszystkich Subfunduszy Goldman Sachs SFIO może się cechować dużą zmiennością, ze względu na inwestowanie aktywów Subfunduszy w jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych lub w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych lokujących w akcje lub instrumenty dłużne o podwyższonym ryzyku. Subfundusze Goldman Sachs SFIO lokują wszystkie swoje aktywa w tytuły uczestnictwa funduszy zagranicznych zarządzanych przez podmiot z grupy kapitałowej Goldman Sachs TFI oraz w jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych zarządzanych przez Goldman Sachs TFI.

Należy pamiętać, że dla celów europejskiego rozporządzenia w sprawie ujawniania informacji związanych ze zrównoważonym rozwojem w sektorze usług finansowych ("SFDR") ten produkt nie jest produktem zgodnym z Artykułami 8 lub 9. Należy pamiętać również, że materiały te zawierają pewne informacje na temat praktyk i doświadczeń Goldman Sachs w zakresie zrównoważonego rozwoju na poziomie organizacji i zespołu inwestycyjnego, które niekoniecznie muszą znaleźć swoje odzwierciedlenie w portfelach produktów, w które inwestujesz. Przed dokonaniem inwestycji należy zapoznać się z dokumentami informacyjnymi dla każdego z produktów, aby uzyskać szczegółowe informacje na temat tego, w jaki sposób i w jakim zakresie produkty uwzględniają kwestie ESG w sposób wiążący lub niewiążący.

Kod nadzoru zgodności: 320652-TMPL-05/2023-1806259