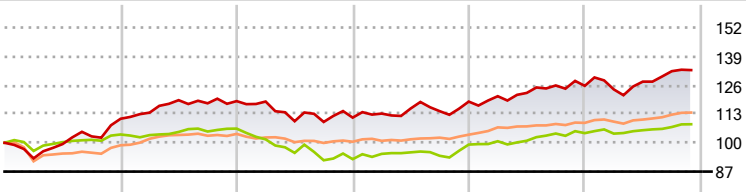
Goldman Sachs Alternative Beta - N Cap EUR (hedged i)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Multistrategy	Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	Not Benchmarked	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il presente comparto mira a replicare i rendimenti realizzati da un indice hedge fund, attraverso la combinazione di un numero ristretto di asset class di tipo tradizionale e liquide, avvalendosi di sofisticate tecniche di elaborazione di modelli finanziari e di una gestione dinamica dell'asset allocation.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
10,84	7,17	-6,27	6,51	5,98	5,66	● Fondo
3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,85	● Benchmark e Indici
-1,13	4,15	-2,50	3,59	5,57	4,26	● Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,64	3Y Sharpe Ratio	0,35
3Y Beta	1,09	3Y Std Dev	6,50
3Y R-Squared	54,80	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,16	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,39	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,60	1,28	2,37
6-Mesi	5,66	2,70	3,20
1-Anno	4,03	2,28	4,22
3-Anni Ann.ti	5,63	4,30	4,74
5-Anni Ann.ti	4,18	0,91	4,02
10-Anni Ann.ti	3,32	1,97	1,83

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

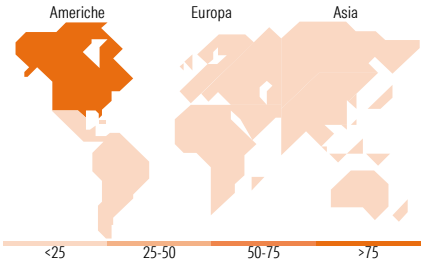
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-1,28	2,83	3,69	-
2024	2,04	1,22	2,74	-0,14
2023	1,64	2,04	-1,05	3,79
2022	-0,16	-7,48	-0,30	1,78
2021	2,50	4,94	-1,18	0,83

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	39,58
● Obbligazioni	2,30
● Liquidità	57,92
● Altro	0,20

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	22,00
E-mini S&P 500 Future Dec 25	—	8,68
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,47
Euro Stoxx 50 Dec 25	—	7,23
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,67
United States Treasury Bills...	—	4,23
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	—	3,48
United States Treasury Notes...	—	2,78
FTSE 100 Index Future Dec 25	—	2,77
United States Treasury Bills...	—	2,23
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		66,53
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		13

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	13,31
Societario	2,36
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	117,43
Derivati	-33,10

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,92
Da 0 a 4 cedole	50,91
Da 4 a 6 cedole	48,18
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	**91,35**
Stati Uniti	90,48
Canada	0,23
America Latina e Centrale	0,63
Europa	**7,85**
Regno Unito	7,35
Europa Occidentale - Euro	0,14
Europa Occidentale - Non Euro	0,26
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,10
Medio Oriente	0,01
Asia	**0,80**
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,68
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	11/11/2013
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (05/12/2025)	EUR 380,59
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	246,62 USD

Patrimonio Classe (Mln) (05/12/2025)	0,16 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0953789194

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,88%
Commissione di incentivo	-

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR