

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

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

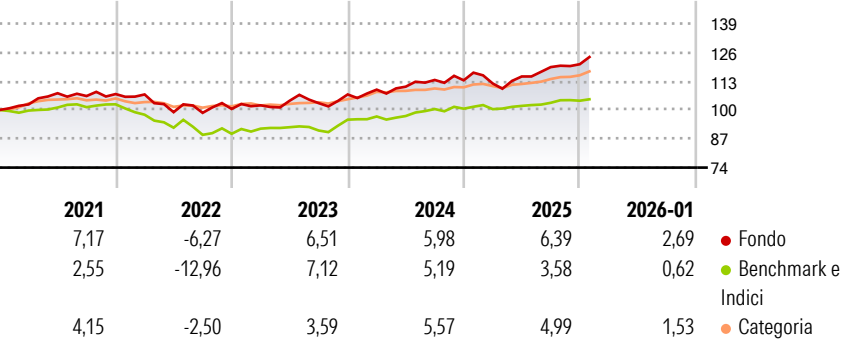
Morningstar Rating™

★★★★

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



Misure di Rischio

3Y Alpha	1,59	3Y Sharpe Ratio	0,55
3Y Beta	1,14	3Y Std Dev	6,30
3Y R-Squared	48,64	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,39	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,56	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,99	0,59	2,78	2026	-	-	-	-
6-Mesi	7,41	2,44	5,76	2025	-1,28	2,83	3,69	1,07
1-Anno	5,82	3,24	6,35	2024	2,04	1,22	2,74	-0,14
3-Anni Ann.ti	6,29	4,47	5,50	2023	1,64	2,04	-1,05	3,79
5-Anni Ann.ti	3,71	0,93	4,27	2022	-0,16	-7,48	-0,30	1,78
10-Anni Ann.ti	3,98	2,13	2,25					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



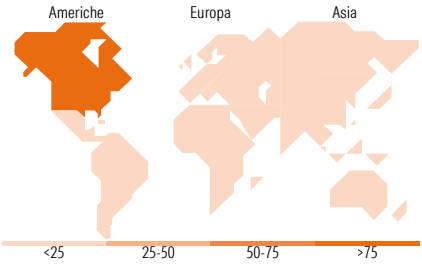
Fixed Income Style

Box™



Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	23,34
Euro Stoxx 50 Dec 25	—	9,12
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,48
E-mini S&P 500 Future Dec 25	—	8,33
United States Treasury Bills...	—	6,05
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	—	4,83
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,62
United States Treasury Bills...	—	4,22
FTSE 100 Index Future Dec 25	—	3,43
United States Treasury Bills...	—	2,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,13
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		9

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	23,70
Societario	2,09
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	107,91
Derivati	-33,71

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	75,81
Da 0 a 4 cedole	2,79
Da 4 a 6 cedole	21,40
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	90,28
Stati Uniti	89,39
Canada	0,27
America Latina e Centrale	0,61
Europa	8,83
Regno Unito	8,35
Europa Occidentale - Euro	0,15
Europa Occidentale - Non Euro	0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,09
Medio Oriente	0,00
Asia	0,89
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,77
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,16 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	(04/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	11/11/2013	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	Inc/Acc	Acc		
NAV (04/02/2026)	EUR 390,68	ISIN	LU0953789194		
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				

(30/11/2025)