

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

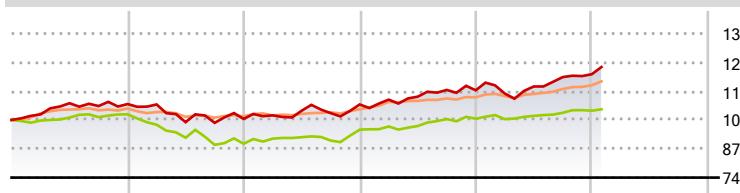
Morningstar Rating™

★★★

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	
7,17	-6,27	6,51	5,98	6,39	2,69	Fondo
2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	0,62	Benchmark e Indici
4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99	1,53	Categoria

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)

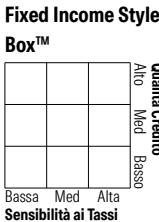
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,99	0,59	2,78	2026	-	-	-	-
6-Mesi	7,41	2,44	5,76	2025	-1,28	2,83	3,69	1,07
1-Anno	5,82	3,24	6,35	2024	2,04	1,22	2,74	-0,14
3-Anni Ann.ti	6,29	4,47	5,50	2023	1,64	2,04	-1,05	3,79
5-Anni Ann.ti	3,71	0,93	4,27	2022	-0,16	-7,48	-0,30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

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

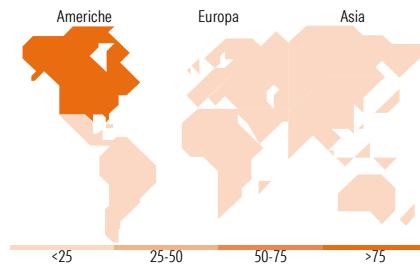
Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	47,83
• Obbligazioni	0,62
• Liquidità	54,25
• Altro	-2,70



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	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	9	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo
Governativo
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

Ripartizione Geografica %

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

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
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)

© 2026 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 produttori; (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.