

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

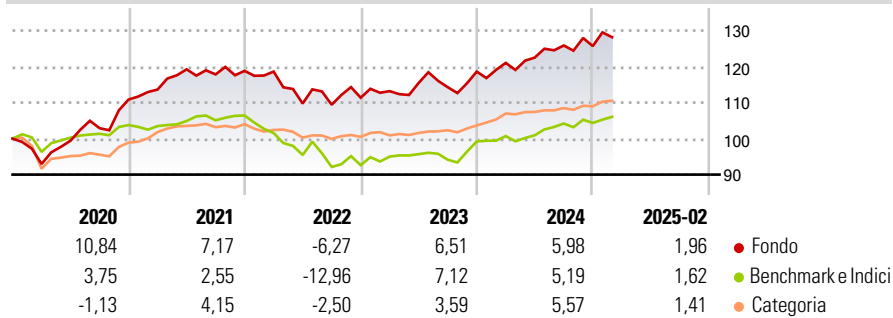
Morningstar Rating™

★★★★

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	1,79	3Y Sharpe Ratio	0,10
3Y Beta	0,92	3Y Std Dev	7,26
3Y R-Squared	64,89	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,44	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,27	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	-3,94	-2,02	0,16	2025	-	-	-	-
6-Mesi	2,24	-0,26	2,19	2025	-	-	-	-
1-Anno	3,82	3,38	4,81	2024	2,04	1,22	2,74	-0,14
3-Anni Ann.ti	2,11	0,70	3,14	2023	1,64	2,04	-1,05	3,79
5-Anni Ann.ti	5,51	0,98	3,08	2022	-0,16	-7,48	-0,30	1,78
10-Anni Ann.ti	2,31	1,40	1,38	2021	2,50	4,94	-1,18	0,83

Rendimenti aggiornati al 11/03/2025

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	48,74
Obbligazioni	-4,61
Liquidità	56,08
Altro	-0,21

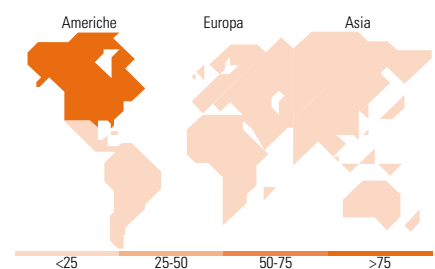
Fixed Income

Style Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
Alta				

Fondo
Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	-	22,95
Euro Stoxx 50 Mar 25	-	18,64
E-mini S&P 500 Future Mar 25	-	13,05
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	8,52
United States Treasury Bills...	-	3,79
United States Treasury Notes...	-	3,12
United States Treasury Bills...	-	2,41
United States Treasury Bills...	-	1,91
FTSE 100 Index Future Mar 25	-	1,69
United States Treasury Notes...	-	1,28
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		77,35
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		25

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	9,92
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	59,73
Derivati	30,34

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	41,06
Da 0 a 4 cedole	52,47
Da 4 a 6 cedole	6,47
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	95,10
Stati Uniti	94,73
Canada	0,06
America Latina e Centrale	0,31
Europa	4,71
Regno Unito	4,28
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,06
Asia	0,19
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,13
Asia - Emergente	0,06

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,14 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	11/11/2013	UCITS	Si	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0953789194		
NAV (11/03/2025)	EUR 353,21				
Patrimonio Netto (Mln)	240,88 USD				

(31/12/2024)