

# Goldman Sachs Alternative Beta - Zz 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

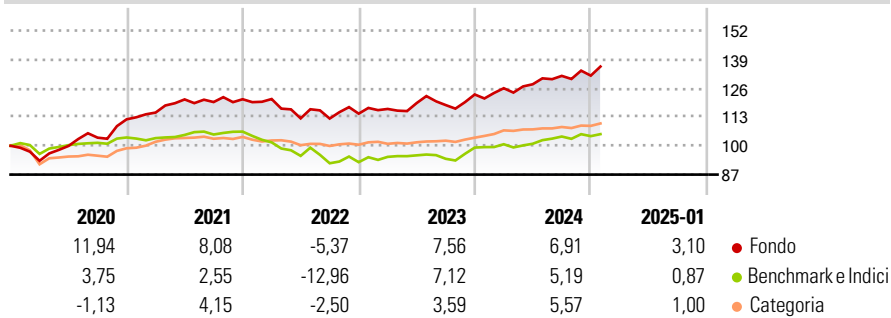
## Morningstar Rating™

★★★★★

### 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	3,83	3Y Sharpe Ratio	0,30
3Y Beta	0,92	3Y Std Dev	7,23
3Y R-Squared	65,23	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,95	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,24	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	3,66	2,13	2,07	2025	-	-	-	-
6-Mesi	8,77	2,92	2,82	2024	2,29	1,43	2,96	0,08
1-Anno	11,29	6,10	5,95	2023	1,86	2,29	-0,78	4,04
3-Anni Ann.ti	4,37	0,70	2,84	2022	0,09	-7,21	-0,08	1,97
5-Anni Ann.ti	6,33	0,78	2,51	2021	2,72	5,17	-0,99	1,06
10-Anni Ann.ti	3,61	1,76	1,54					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 30/11/2024

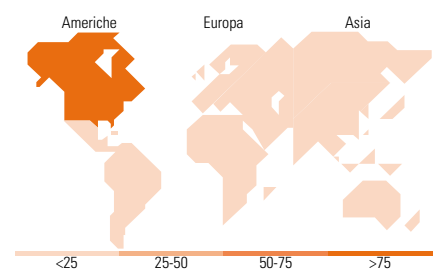


### Fixed Income

#### Style Box™



Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-



### Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	21,59
Euro Stoxx 50 Dec 24	—	16,07
E-mini S&P 500 Future Dec 24	—	9,12
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,49
United States Treasury Bills...	—	7,52
United States Treasury Notes...	—	3,05
United States Treasury Bills...	—	1,79
FTSE 100 Index Future Dec 24	—	1,41
United States Treasury Bills...	—	1,14
United States Treasury Bills...	—	1,02
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		71,20
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		25

### Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	8,77
Societario	0,38
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	77,33
Derivati	13,52

### Coupon Range %

Categoria	Fondo
0 coupon	62,85
Da 0 a 4 cedole	27,60
Da 4 a 6 cedole	9,55
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 %

Continento	Fondo
<b>America</b>	<b>95,19</b>
Stati Uniti	94,64
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,47
<b>Europa</b>	<b>4,61</b>
Regno Unito	4,18
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,23
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,06
<b>Asia</b>	<b>0,20</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppatti	0,14
Asia - Emergente	0,06

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	7,04 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,01%
Data di Partenza	02/09/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,01%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU1473481007		
NAV (04/02/2025)	EUR 7.287,95				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)