

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

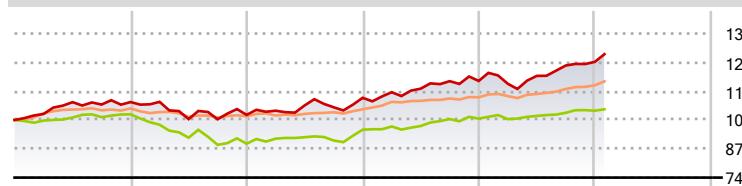
Morningstar Rating™

★★★★

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01
8,08	-5,37	7,56	6,91	7,31	2,75
2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	0,62
4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99	1,53

Misure di Rischio

3Y Alpha	2,51	3Y Sharpe Ratio	0,70
3Y Beta	1,14	3Y Std Dev	6,32
3Y R-Squared	48,26	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,60	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,59	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,24	0,59
6-Mesi	7,90	2,44
1-Anno	6,73	3,24
3-Anni Ann.ti	7,26	4,47
5-Anni Ann.ti	4,65	0,93
10-Anni Ann.ti	4,83	2,13

Rendimenti Trimestrali %

Q1	Q2	Q3	Q4
-	-	-	-
-1,07	3,04	3,91	1,31
2,29	1,43	2,96	0,08
1,86	2,29	-0,78	4,04
0,09	-7,21	-0,08	1,97

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Portafoglio 30/11/2025

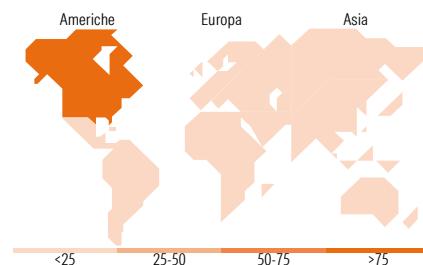


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	47,83
• Obbligazioni	0,62
• Liquidità	54,25
• Altro	-2,70

Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
	Maturity effettiva	-
	Qualità Credito Media	-
Alto	-	-
Med	-	-
Basso	-	-

Sensibilità ai Tassi



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	2,09
• Cartolarizzazioni	0,00
• Enti Locali	0,00
• Liquidità ed equivalenti	107,91
• Derivati	-33,71

Coupon Range %

Fondo	0 coupon
• Da 0 a 4 cedole	75,81
• Da 4 a 6 cedole	2,79
• Da 6 a 8 cedole	21,40
• Da 8 a 10 cedole	0,00
• Da 10 a 12 cedole	0,00
• Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

Fondo	America
• Stati Uniti	90,28
• Canada	0,27
• America Latina e Centrale	0,61
Fondo	Europa
• Regno Unito	8,83
• Europa Occidentale - Euro	0,15
• Europa Occidentale - Non Euro	0,24
• Europa dell'Est	0,00
• Africa	0,09
• Medio Oriente	0,00
Fondo	Asia
• Giappone	0,00
• Australasia	0,02
• Asia - Paesi Sviluppati	0,77
• Asia - Emergenti	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	4,19 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
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 (04/02/2026)	EUR 7.778,30				
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 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.