

Goldman Sachs Alternative Beta - R 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

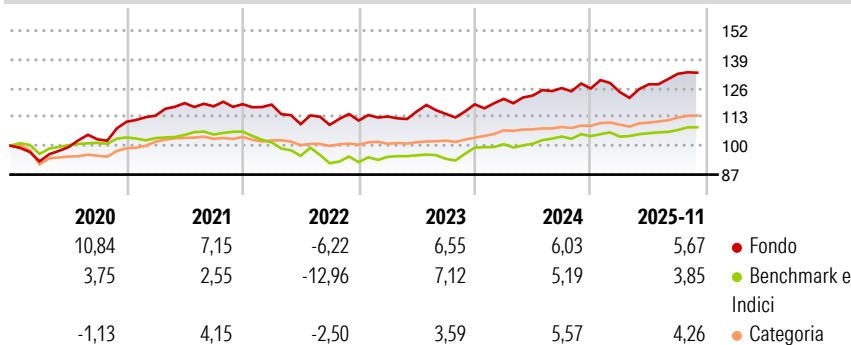
Morningstar Rating™

★★★★

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	0,68	3Y Sharpe Ratio	0,36
3Y Beta	1,08	3Y Std Dev	6,49
3Y R-Squared	54,34	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,17	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,39	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

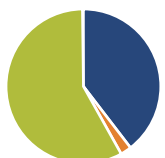
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,60	1,28	2,37
6-Mesi	5,66	2,70	3,20
1-Anno	4,03	2,28	4,22
3-Anni Ann.ti	5,67	4,30	4,74
5-Anni Ann.ti	4,21	0,91	4,02
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-1,27	2,83	3,70	-
2024	2,07	1,25	2,75	-0,14
2023	1,63	1,99	-0,91	3,74
2022	-0,16	-7,42	-0,30	1,78
2021	2,50	4,96	-1,22	0,83

Portafoglio 30/09/2025



Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

Netta

Azioni	39,58
Obbligazioni	2,30
Liquidità	57,92
Altro	0,20

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi			
Bassa			
Med			
Alta			

Duration Effettiva

Maturità effettiva

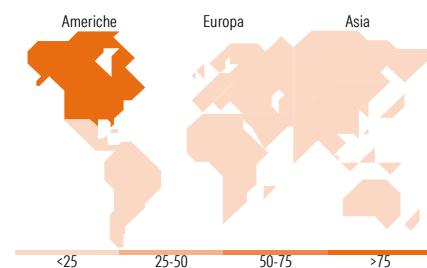
Qualità Credito Media

Fondo

-

-

-



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	-	22,00
E-mini S&P 500 Future Dec 25	-	8,68
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	8,47
Euro Stoxx 50 Dec 25	-	7,23
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,67
United States Treasury Bills...	-	4,23
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	-	3,48
United States Treasury Notes...	-	2,78
FTSE 100 Index Future Dec 25	-	2,77
United States Treasury Bills...	-	2,23
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		66,53
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		13

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	13,31
Societario	2,36
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	117,43
Derivati	-33,10

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	0,92
Da 0 a 4 cedole	50,91
Da 4 a 6 cedole	48,18
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	91,35
Stati Uniti	90,48
Canada	0,23
America Latina e Centrale	0,63
Europa	7,85
Regno Unito	7,35
Europa Occidentale - Euro	0,14
Europa Occidentale - Non Euro	0,26
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,10
Medio Oriente	0,01
Asia	0,80
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,68
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,66 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	21/08/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU1673808165		
NAV (05/12/2025)	EUR 329,63				
Patrimonio Netto (Mln)	246,62 USD				

(30/09/2025)