

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

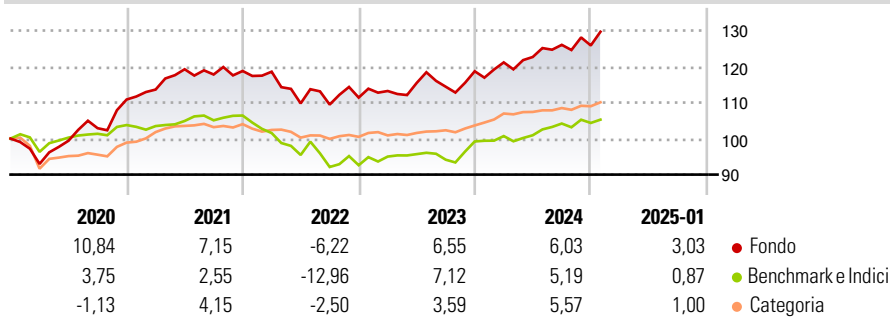
Morningstar Rating™

★★★★

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	2,94	3Y Sharpe Ratio	0,18
3Y Beta	0,91	3Y Std Dev	7,19
3Y R-Squared	65,44	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,74	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,21	10Y Risk	-

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	3,44	2,13	2,07	2025	-	-	-	-
6-Mesi	8,28	2,92	2,82	2024	2,07	1,25	2,75	-0,14
1-Anno	10,35	6,10	5,95	2023	1,63	1,99	-0,91	3,74
3-Anni Ann.ti	3,45	0,70	2,84	2022	-0,16	-7,42	-0,30	1,78
5-Anni Ann.ti	5,37	0,78	2,51	2021	2,50	4,96	-1,22	0,83
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/11/2024



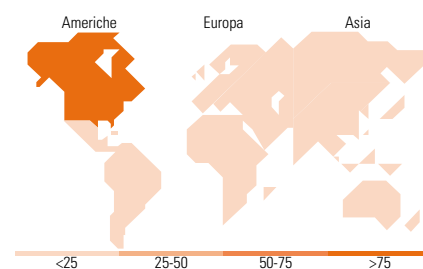
Asset Allocation %	Netta
Azioni	44,74
Obbligazioni	-0,67
Liquidità	55,84
Altro	0,09

Fixed Income

Style Box™

		Qualità Credito		
		Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi	Bassa			
	Med			
Alta				

Fondo
Duration Effettiva -
Maturity 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 %

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

Coupon Range %

Fondo	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 %

Fondo	Fondo
America	95,19
Stati Uniti	94,64
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,47
Europa	4,61
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
Asia	0,20
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)	0,54 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,86%
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 (04/02/2025)	EUR 319,75				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)