

# Goldman Sachs Alternative Beta - I Cap PLN (hedged i)

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001011

## Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

## Morningstar Rating™

Senza 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	-	3Y Sharpe Ratio	0,83
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,62
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

### Rend. Cumulati %

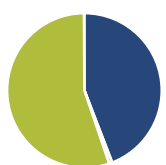
Periodo	Rendimento (%)
3-Mesi	7,50
6-Mesi	11,74
1-Anno	15,75
3-Anni Ann.ti	10,90
5-Anni Ann.ti	8,62
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	3,37	1,58	3,92	0,69
2023	2,92	8,88	-4,22	11,13
2022	-0,82	-7,46	-1,25	7,71
2021	0,93	7,91	-2,99	1,80

### Portafoglio 30/11/2024



### Asset Allocation %

Azioni	44,74
Obbligazioni	-0,67
Liquidità	55,84
Altro	0,09

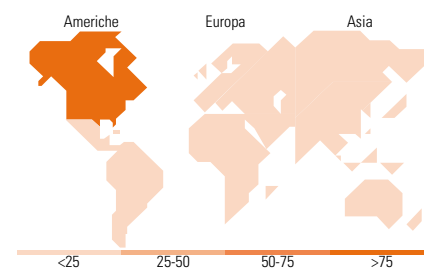
### Fixed Income

#### Style Box™



Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### 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 %

Range	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 %

Regione	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 Sviluppati	0,14
Asia - Emergente	0,06

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,62 USD	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	PLN	T.E.R.	0,73%
Data di Partenza	14/08/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,73%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU2016011004		
NAV (04/02/2025)	PLN 31.063,59				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)