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

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001011

**Benchmark Morningstar** 

**Benchmark Dichiarato** Not Categorized Not Benchmarked Usato nel Report

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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,99
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,12
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,84	Trimestrali %				
6-Mesi	8,49	2025	1,47	2,22	3,99	-
1-Anno	7,97	2024	3,37	1,58	3,92	0,69
3-Anni Ann.ti	13,02	2023	2,92	8,88	-4,22	11,13
5-Anni Ann.ti	8,67	2022	-0,82	-7,46	-1,25	7,71
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 05/12/2025	-	2021	0,93	7,91	-2,99	1,80

## **Portafoglio** 30/09/2025





**Fondo Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Set	ttore	%
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 Obbligaziona	ari	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

Fondo		
91,35		
90,48		
0,23		
0,63		
7,85		
7,35		
0,14		
0,26		
0,00		
0,10		
0,01		
0,80		
0,00		
0,02		
0,68		
0,11		

Anagrafica	
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	14/08/2019
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (05/12/2025)	PLN 32.770,78
Patrimonio Netto (MIn)	246,62 USD
(30/09/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	1,41 USD
(05/12/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	PLN
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2016011004

Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,73%
Commissione di incentivo	-