

# 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	9,91
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

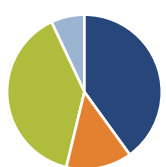
**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,51
6-Mesi	6,48
1-Anno	19,92
3-Anni Ann.ti	13,07
5-Anni Ann.ti	8,65
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 14/04/2026

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-2,43	-	-	-
2025	1,47	2,22	3,99	2,74
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

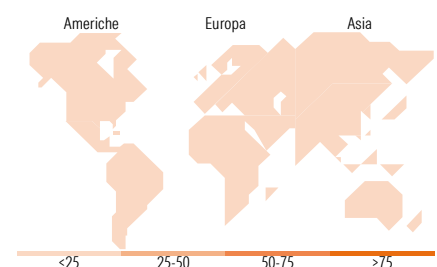
**Portafoglio 31/01/2026**

**Asset Allocation %**

Azioni	46,54
Obbligazioni	15,97
Liquidità	45,63
Altro	-8,14

**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

 Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
F/C E-Mini Russ 2000 Mar26	-	24,30
E-mini S&P 500 Future Mar 26	-	8,33
Eurx/Eurx Er Stx 50 3/2026	-	7,96
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	7,19
Cmrc/Imm Emimi Nsdq 3/2026	-	6,11
United States Treasury Bills...	-	5,34
10 Year Treasury Note Future...	-	4,50
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,41
United States Treasury Bills...	-	3,72
United States Treasury Bills...	-	3,24
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,10
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		7

**Fixed Income Sector Weightings %**

Settore	Fondo
Governativo	40,60
Societario	0,72
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	77,50
Derivati	-18,82

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	96,13
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	3,87
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>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

**Anagrafica**

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	1,43 USD	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.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 (14/04/2026)	PLN 34.123,79				
Patrimonio Netto (Mln)	262,45 USD				

(31/01/2026)