

# 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	1,14
3Y Beta	- 3Y Std Dev	9,06
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

### Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	5,69
6-Mesi	10,40
1-Anno	8,66
3-Anni Ann.ti	13,38
5-Anni Ann.ti	8,47
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

### Rendimenti Trimestrali %

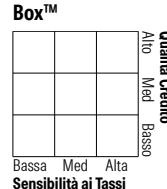
	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	1,47	2,22	3,99	2,74
2024	3,37	1,58	3,92	0,69
2023	2,92	8,88	-4,22	11,13
2022	-0,82	-7,46	-1,25	7,71

### Portafoglio 30/11/2025



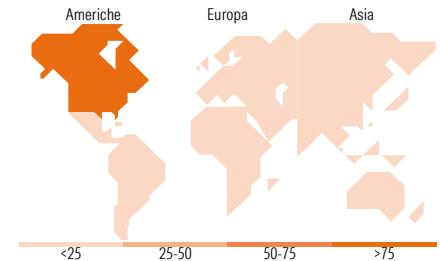
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	47,83
• Obbligazioni	0,62
• Liquidità	54,25
• Altro	-2,70

### Fixed Income Style



### Fondo

Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media



### Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	-	23,34
Euro Stoxx 50 Dec 25	-	9,12
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	8,48
E-mini S&P 500 Future Dec 25	-	8,33
United States Treasury Bills...	-	6,05
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	-	4,83
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,62
United States Treasury Bills...	-	4,22
FTSE 100 Index Future Dec 25	-	3,43
United States Treasury Bills...	-	2,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	75,13	
Numero Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	9	

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	23,70
Societario	2,09
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	107,91
Derivati	-33,71

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	75,81
Da 0 a 4 cedole	2,79
Da 4 a 6 cedole	21,40
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	90,28
Stati Uniti	89,39
Canada	0,27
America Latina e Centrale	0,61
Europa	8,83
Regno Unito	8,35
Europa Occidentale - Euro	0,15
Europa Occidentale - Non Euro	0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,09
Medio Oriente	0,00
Asia	0,89
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,77
Asia - Emergenti	0,11

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	1,42 USD	Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(04/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	<a href="https://am.gs.com/">https://am.gs.com/</a>	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	14/08/2019	Valuta del Fondo	PLN	Spese correnti	0,73%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	Inc/Acc	Acc		
NAV (04/02/2026)	PLN 33.768,60	ISIN	LU2016011004		
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				
(30/11/2025)					