

Goldman Sachs Alternative Beta - I Dis(HY) JPY (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	-0,66
3Y Beta	-	3Y Std Dev	11,65
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

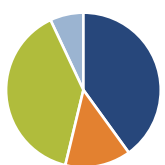
Rend. Cumulati %

Termine	Rend. Cumulati %
3-Mesi	-1,15
6-Mesi	-2,26
1-Anno	-0,84
3-Anni Ann.ti	-3,92
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 14/04/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,04	-	-	-
2025	-1,10	-2,29	0,95	-5,06
2024	-3,76	-4,88	10,25	-2,78
2023	-1,54	-7,14	-2,07	4,15
2022	-	-11,68	-0,14	2,19

Portafoglio 31/01/2026

Asset Allocation %

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

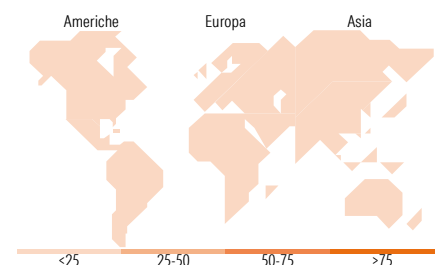
Fixed Income Style
Box™

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 %	
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
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	4,62 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	JPY	T.E.R.	0,73%
Data di Partenza	18/03/2022	UCITS	Si	Spese correnti	0,73%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU2434802489		
NAV (14/04/2026)	JPY 10.503,00				
Patrimonio Netto (Mln)	262,45 USD				

(31/01/2026)