

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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

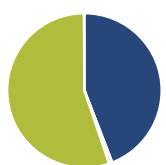
Rend. Cumulati %

Periodo	Rend. Cumulati %
3-Mesi	5,98
6-Mesi	6,62
1-Anno	6,65
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
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
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/11/2024


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	44,74
● Obbligazioni	-0,67
● Liquidità	55,84
● Altro	0,09

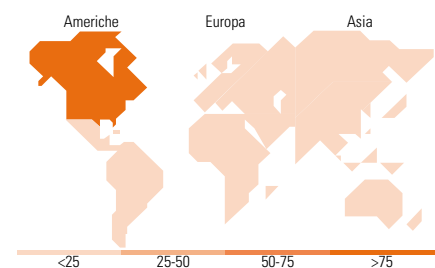
Fixed Income
Style Box™


Fondo

Duration Effettiva -

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media


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
America	95,19
Stati Uniti	94,64
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,47
Europa	4,61
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
Asia	0,20
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)	4,61 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.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	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU2434802489		
NAV (04/02/2025)	JPY 10.226,00				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)