

Goldman Sachs Alternative Beta - I Dis(HY) JPY (hedged i)

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001011

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

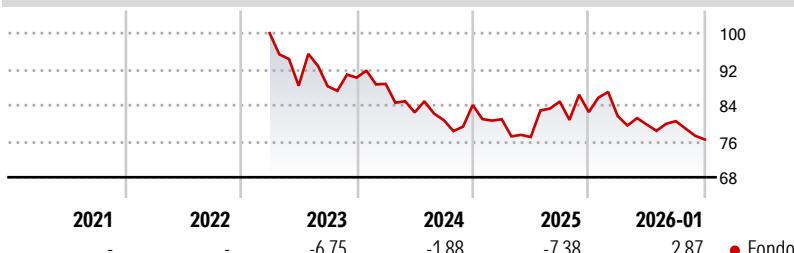
Not Benchmarked

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	-0,64
3Y Beta	-	3Y Std Dev	11,60
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	-1,19
6-Mesi	-1,76
1-Anno	-9,38
3-Anni Ann.ti	-5,14
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

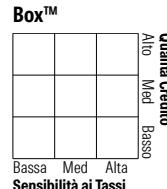
Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

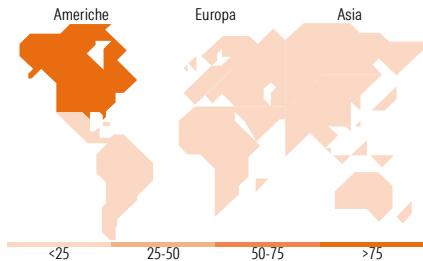
	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-1,10	-2,29	0,95	-5,06
2024	-3,76	-4,88	10,25	-2,78
2023	-1,54	-7,14	-2,07	4,15
2022	-	-11,68	-0,14	2,19

Portafoglio 30/11/2025


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

Fixed Income Style Box™

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) (04/02/2026)	4,65 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	JPY	T.E.R.	-
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 (04/02/2026)	JPY 10.444,00				
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				
(30/11/2025)					