Goldman Sachs Alternative Beta - N Cap EUR (hedged i)

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report

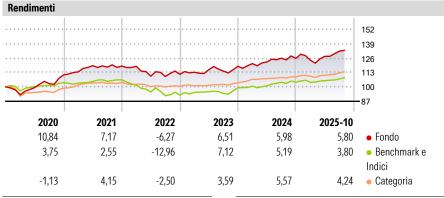
Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

Morningstar 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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	0,53	3Y Sharpe Ratio	0,45
3Y Beta	1,07	3Y Std Dev	6,55
3Y R-Squared	55,32	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,14	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,40	10Y Risk	+Med
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Cautious	Global Target Allocation N	IR EUR (dove

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,52	1,38	2,50	Trimestrali %				
6-Mesi	4,77	3,16	4,14	2025	-1,28	2,83	3,69	-
1-Anno	3,60	3,73	5,14	2024	2,04	1,22	2,74	-0,14
3-Anni Ann.ti	4,98	4,81	4,96	2023	1,64	2,04	-1,05	3,79
5-Anni Ann.ti	4,30	0,98	4,12	2022	-0,16	-7,48	-0,30	1,78
10-Anni Ann.ti	3,18	1,96	1,89	2021	2,50	4,94	-1,18	0,83
Rendimenti aggiornati al 14/11/2	2025							

Fondo

Portafoglio 31/08/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index	_	22,88
E-mini S&P 500 Future Sept 25	_	10,74
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	8,52
Euro Stoxx 50 Sep 25	_	7,90
E-mini Nasdaq 100 Future	_	5,31
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,93
United States Treasury Bills	_	4,46
United States Treasury Notes	_	3,27
United States Treasury Notes	_	3,00
United States Treasury Bills	-	2,35
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		73,35
Numero Complessivo di Titoli Azionari		C
Numero Complessivo di Titoli Obbligazi	onari	17

₩ Governativo	2,29	
Societario	3,86	
★ Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
🚅 Liquidità ed equivalenti	119,87	
Derivati	-26,02	
Coupon Range %	Fondo	
0 coupon	29,66	
Da 0 a 4 cedole	27,15	
Da 4 a 6 cedole	43,19	
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	98,45
Stati Uniti	97,52
Canada	0,29
America Latina e Centrale	0,64
Europa	0,91
Regno Unito	0,42
Europa Occidentale - Euro	0,15
Europa Occidentale - Non Euro	0,22
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,10
Medio Oriente	0,01
Asia	0,63
Giappone	0,01
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,50
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica	
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	11/11/2013
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (14/11/2025)	EUR 374,86
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD
(31/08/2025)	

Patrimonio Classe (Mln) (14/11/2025)	0,16 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0953789194

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,88%
Commissione di incentivo	=