

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

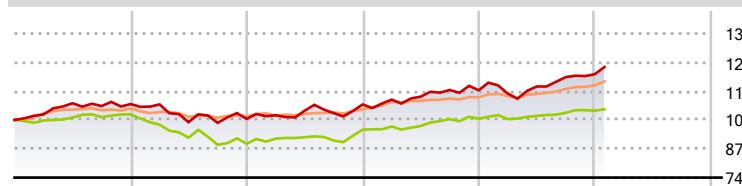
Not Benchmarked

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.

Rendimenti


2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria
7,17	-6,27	6,51	5,98	6,39	2,69	● Fondo	● Benchmark e Indici	● Categoria
2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	0,62			
4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99	1,53			

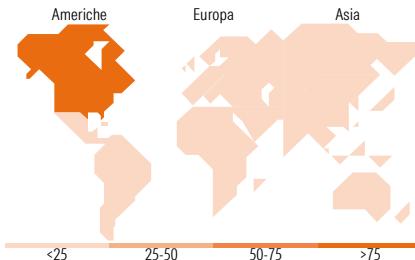
Misure di Rischio	Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3Y Alpha	1,59	3Y Sharpe Ratio	0,56						
3Y Beta	1,14	3Y Std Dev	6,30						
3Y R-Squared	48,65	3Y Risk	+Med						
3Y Info Ratio	0,39	5Y Risk	+Med						
3Y Tracking Error	4,56	10Y Risk	+Med						
Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)									
Rendimenti aggiornati al 02/02/2026									

Portafoglio 30/11/2025


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

Fixed Income Style Box™	Qualità Credito
	Alt
	Med
	Bass
Bassa	Med
Med	Alta
Alta	Bass

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

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
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		0
Numeri 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 %	
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
Europa	8,83
Asia	0,89
Stati Uniti	89,39
Canada	0,27
America Latina e Centrale	0,61
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
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) (02/02/2026)	0,16 USD	Investimento Min. Ingresso
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.
Data di Partenza	11/11/2013	UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0953789194	
NAV (02/02/2026)	EUR 391,51			
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD			
(30/11/2025)				

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società produttori; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.