## Goldman Sachs Alternative Beta - Zz Cap EUR (hedged i)

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

**Benchmark Morningstar** 

Usato nel Report

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR

**Benchmark Dichiarato** 

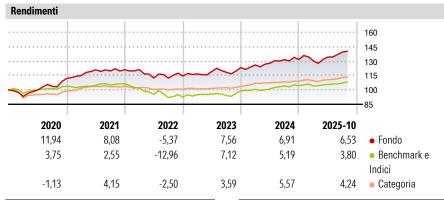
Not Benchmarked

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	1,43	3Y Sharpe Ratio	0,59
	3Y Beta	1,06	3Y Std Dev	6,57
	3Y R-Squared	54,81	3Y Risk	+Med
	3Y Info Ratio	0,35	5Y Risk	+Med
	3Y Tracking Error	4,43	10Y Risk	+Med
	Basati su Morningstar Euro applicabile)	Cautious	Global Target Allocation Ni	R EUR (dove

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	0-4	Rendimenti	01	02	02	04
Kena. Cumulati %	Foliao	DIIIK	Cat	Kendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,74	1,38	2,50	Trimestrali %				
6-Mesi	5,21	3,16	4,14	2025	-1,07	3,04	3,91	-
1-Anno	4,48	3,73	5,14	2024	2,29	1,43	2,96	0,08
3-Anni Ann.ti	5,93	4,81	4,96	2023	1,86	2,29	-0,78	4,04
5-Anni Ann.ti	5,24	0,98	4,12	2022	0,09	-7,21	-0,08	1,97
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 14/11/2	3,99 <sup>2025</sup>	1,96	1,89	2021	2,72	5,17	-0,99	1,06

Fondo

## Portafoglio 31/08/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Setto	ore	%
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 Obbligazionari	i	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	02/09/2016
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (14/11/2025)	EUR 7.448,45
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD

Patrimonio Classe (MIn)	4,17 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1473481007

Investimento Min. Ingresso	5.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	=
Spese correnti	0,01%
Commissione di incentivo	-

(31/08/2025)