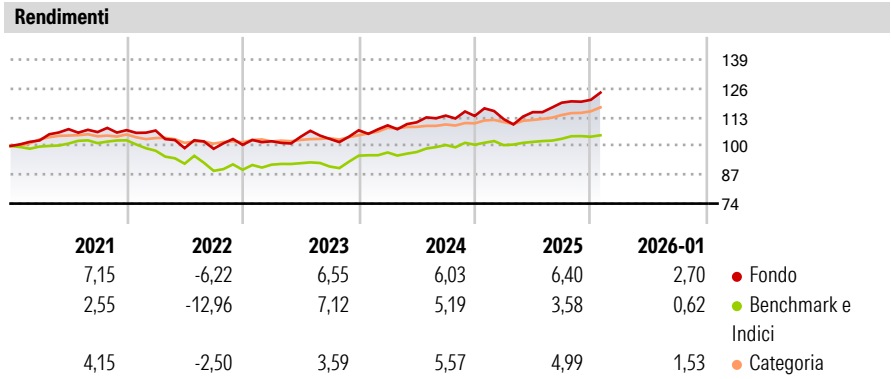


Goldman Sachs Alternative Beta - R Cap EUR (hedged i)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Multistrategy	Morningstar Euro Cautious Global Target	Not Benchmarked	★★★★
	Allocation NR EUR		
	Usato nel Report		

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.



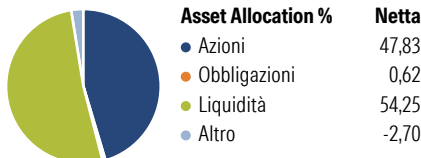
Misure di Rischio			
3Y Alpha	1,64	3Y Sharpe Ratio	0,56
3Y Beta	1,13	3Y Std Dev	6,29
3Y R-Squared	48,12	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,40	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,57	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

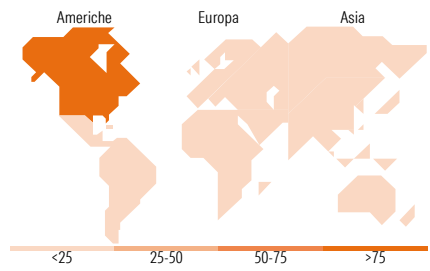
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,41	0,54	2,86	2026	-	-	-	-
6-Mesi	8,72	2,87	6,06	2025	-1,27	2,83	3,70	1,08
1-Anno	6,19	3,46	6,70	2024	2,07	1,25	2,75	-0,14
3-Anni Ann.ti	6,29	4,33	5,81	2023	1,63	1,99	-0,91	3,74
5-Anni Ann.ti	3,91	0,97	4,67	2022	-0,16	-7,42	-0,30	1,78
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™		Fondo
Duration Effettiva		-
Maturità effettiva		-
Qualità Credito Media		-
Qualità Credito		
Alto		
Med		
Basso		
Sensibilità ai Tassi		
Bassa		
Med		
Alta		



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 - Emergente		0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,68 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	(02/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	21/08/2018	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	Inc/Acc	Acc		
NAV (02/02/2026)	EUR 339,09	ISIN	LU1673808165		
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				

(30/11/2025)