## Goldman Sachs Alternative Beta - I Cap PLN (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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	1,08
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,24
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-
Ü			

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,13	Trimestrali %				
6-Mesi	6,52	2025	1,47	2,22	3,99	-
1-Anno	9,12	2024	3,37	1,58	3,92	0,69
3-Anni Ann.ti	12,47	2023	2,92	8,88	-4,22	11,13
5-Anni Ann.ti	8,91	2022	-0,82	-7,46	-1,25	7,71
10-Anni Ann.ti	-	2021	0,93	7,91	-2,99	1,80

## Portafoglio 31/08/2025





Prondo

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 Azionar	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	rionari	17

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	2,29
<ul><li>Societario</li></ul>	3,86
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	119,87
Derivati	-26,02
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	29,66
0 coupon	27,00
Da 0 a 4 cedole	27,15
•	
Da 0 a 4 cedole	27,15
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole	27,15 43,19
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole	27,15 43,19 0,00

.25	25 50 50 15	. 13
Ripartizione	Fondo	
America		98,45
Stati Uniti		97,52
Canada		0,29
America Latii	na e Centrale	0,64
Europa		0,91
Regno Unito		0,42
Europa Occio	lentale - Euro	0,15
Europa Occio	lentale - Non Euro	0,22
Europa dell'E	st	0,00
Africa		0,10
Medio Orient	e	0,01
Asia		0,63
Giappone		0,01
Australasia		0,02
Asia - Paesi S	Sviluppati	0,50
Asia - Emerg	ente	0,11

Anagrafica	
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	14/08/2019
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (14/11/2025)	PLN 32.239,40
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD
(31/08/2025)	

Patrimonio Classe (Mln)	1,38 USD
(14/11/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	PLN
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2016011004

Investimento Min. Ingresso	250.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,73%
Commissione di incentivo	-