## Goldman Sachs Alternative Beta - I Dis(HY) JPY (hedged i)

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001011

**Benchmark Morningstar** 

Not Categorized
Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato** 

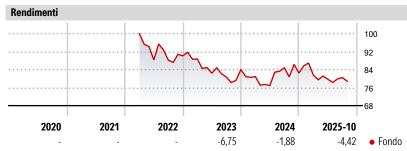
Not Benchmarked

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	-0,48
3Y Beta	-	3Y Std Dev	11,75
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-3,00	Trimestrali %				
6-Mesi	-4,82	2025	-1,10	-2,29	0,95	-
1-Anno	-6,34	2024	-3,76	-4,88	10,25	-2,78
3-Anni Ann.ti	-4,78	2023	-1,54	-7,14	-2,07	4,15
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-11,68	-0,14	2,19
10-Anni Ann.ti	-	2021	=	-	-	=

## Portafoglio 31/08/2025





Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Setto	re	%
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		0
NumeroComplessivodiTitoliObbligazionari		17

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	
₩ 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	18/03/2022
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (14/11/2025)	JPY 10.269,00
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD
(31/08/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	4,64 USD
(14/11/2025)	
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	JPY
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2434802489

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,73%
Commissione di incentivo	0,00%