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

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001011

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

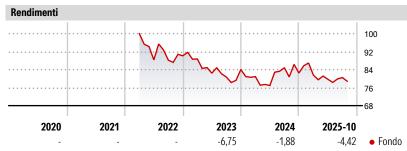
Not Benchmarked

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% |