

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

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Not Benchmarked

Morningstar Rating™

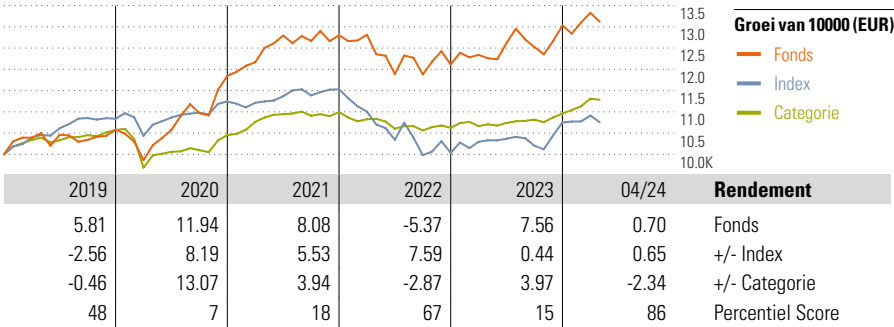
★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Multistrategy

Beleggingsdoelstelling

Het Compartiment streeft ernaar het rendement van hedgefondindices na te bootsen aan de hand van een combinatie van bèta's van slechts een beperkt aantal traditionele, liquide financiële markten, door middel van gesofistikeerde modeltechnieken en door een dynamisch beheer van de toewijzingen. Het Compartiment heeft tot doel, gemeten over een periode van meerdere jaren, de prestatie van de Benchmark, de HFRX Global Hedge Fund Index, te overtreffen. Het Compartiment neemt daartoe via een breed spectrum van indices...



Risicomaatstaven

Alpha	2.68	Sharpe Ratio	0.08
Beta	0.83	Std Deviatie	6.92
R-kwadraat	57.20	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.67	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	4.61	10-jr Risico	Bov gem

Berekeningen met Morningstar EU Cau Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	4.54	3.03	1.80
6 Maanden	7.87	2.72	2.91
1 jaar	10.72	5.17	4.26
3 jr gean.	2.97	3.89	0.41
5 jr gean.	5.60	4.75	3.68

Kwartaalrendementen

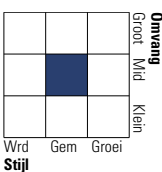
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	2.29	-	-	-
2023	1.86	2.29	-0.78	4.04
2022	0.09	-7.21	-0.08	1.97
2021	2.72	5.17	-0.99	1.06
2020	-6.76	7.18	3.73	7.98

Portefeuille 29 feb 2024

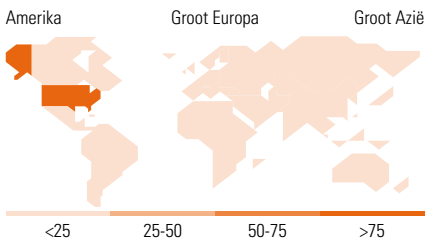
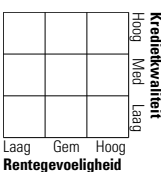
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	39.99	8.13	31.87
Obligaties	9.78	0.00	9.78
Kas/ geldmarkt	98.22	36.66	61.55
Overig	0.11	3.31	-3.20

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
E-mini Russell 2000 Index...	—	15.98
E-mini S&P 500 Future Mar...	—	10.82
Euro Stoxx 50 Mar 242024-03-15	—	10.69
United States Treasury Bills...	—	6.03
United States Treasury Bills...	—	5.46
United States Treasury Bills...	—	5.31
United States Treasury Bills...	—	4.23
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	3.68
United States Treasury Bills...	—	2.56
United States Treasury Bills...	—	2.30
Totaal Aantal Aandelen		0
Totaal Aantal Obligaties		21
% Van Vermogen In Top 10 Posities		67.06

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	31.56
Basismaterialen	3.54
Cyclische consumentenproducten	10.84
Financiële dienstverlening	12.59
Vastgoed	4.59
Licht Cyclisch	47.10
Communicatiediensten	5.51
Energie	5.21
Industrie	12.13
Technologie	24.25
Defensief	21.34
Defensieve consumptiegoederen	5.15
Gezondheidszorg	13.89
Nutsbedrijven	2.30

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	97.78
Verenigde Staten	97.20
Canada	0.08
Latijns Amerika	0.49
Groot Europa	2.03
Verenigd Koninkrijk	1.49
West Europa – Euro	0.28
West Europa – Niet Euro	0.18
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.07
Groot Azië	0.20
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.08
Azië - Emerging	0.12

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	2 sep 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Osman Ali	ISIN	LU1473481007		
Aanvangsdatum	6 nov 2023				
Koers (17 mei 2024)	EUR 6,889.60				
Fondsvermogen (mln)	USD 3.69				