

# Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap EUR

## Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001010

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

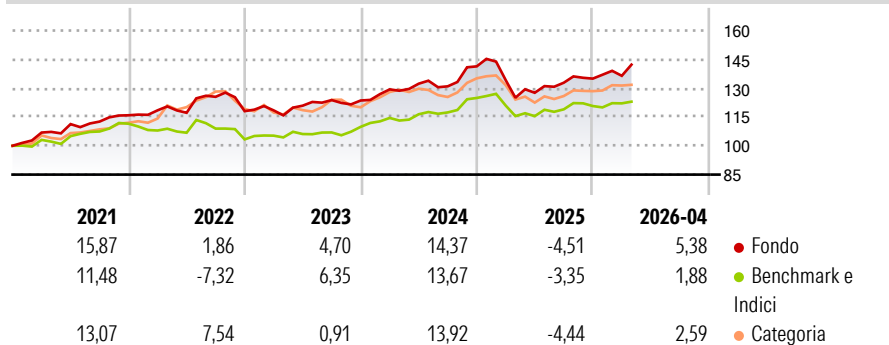
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

3Y Alpha	1,44	3Y Sharpe Ratio	0,49
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	8,77
3Y R-Squared	57,92	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,30	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,92	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

### Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,97	2,31	2,85
6-Mesi	6,06	1,20	3,78
1-Anno	9,11	4,07	7,34
3-Anni Ann.ti	7,09	5,27	6,80
5-Anni Ann.ti	6,53	4,09	8,43
10-Anni Ann.ti	5,56	4,30	4,26

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	1,08	-	-	-
2025	-5,08	-4,89	4,10	1,61
2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
2023	0,34	2,06	2,42	-0,18
2022	2,23	-1,08	7,09	-5,95

### Portafoglio 28/02/2026



### Asset Allocation %

● Azioni	45,93
● Obbligazioni	16,71
● Liquidità	45,32
● Altro	-7,96

### Fixed Income Style

#### Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alto			
Med			
Basso			

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
F/C E-Mini Russ 2000 Mar26	—	23,56
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,54
Eurx/Eurx Er Stx 50 3/2026	—	8,39
E-mini S&P 500 Future Mar 26	—	8,25
Cmrc/Imm Emimi Nsdq 3/2026	—	6,15
10 Year Treasury Note Future...	—	5,61
United States Treasury Bills...	—	5,18
United States Treasury Bills...	—	3,51
United States Treasury Bills...	—	3,14
United States Treasury Bills...	—	2,45
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		74,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		6

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	40,99
🏢 Societario	0,69
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏘️ Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	76,66
📄 Derivati	-18,34

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	96,12
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	3,88
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
<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	15,15 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,35%
Data di Partenza	16/06/2008	UCITS	Si	Spese correnti	1,35%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038167		
NAV (12/05/2026)	EUR 588,66				
Patrimonio Netto (Mln)	271,37 USD				

(28/02/2026)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.