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

Categoria Morningstar™
Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

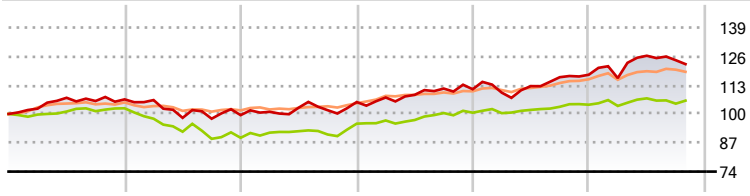
Benchmark Dichiarato
Not Benchmarked

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	6,58	-6,67	5,93	5,49	5,88	4,08
Benchmark e Indici	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	1,77
Categoria	4,15	-2,50	3,59	5,57	4,99	2,66

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,69	3Y Sharpe Ratio	0,59
3Y Beta	1,25	3Y Std Dev	7,17
3Y R-Squared	51,39	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,26	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,10	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,47	-0,44	0,04
6-Mesi	-1,80	1,05	1,62
1-Anno	4,87	1,66	4,96
3-Anni Ann.ti	6,74	5,21	6,92
5-Anni Ann.ti	2,55	0,67	4,98
10-Anni Ann.ti	3,40	1,98	2,36

Rendimenti aggiornati al 11/11/2026

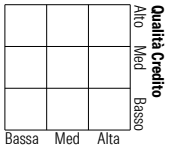
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,28	8,67	-1,59	-
2025	-1,39	2,70	3,56	0,95
2024	1,94	1,12	2,60	-0,27
2023	1,51	1,85	-1,11	3,61
2022	-0,29	-7,54	-0,41	1,66

Portafoglio 31/08/2026

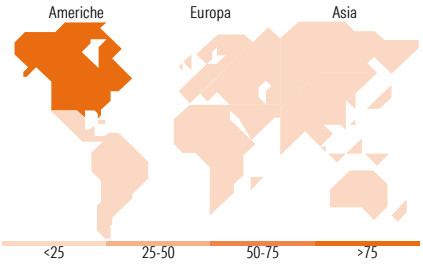


Asset Allocation %	Netta
Azioni	24,86
Obbligazioni	27,60
Liquidità	58,85
Altro	-11,31

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-Mini Russell 2000 Index...	—	15,48
United States Treasury Bills...	—	10,56
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	6,68
United States Treasury Bills...	—	6,56
Federal Home Loan Banks 0%	—	5,60
FTSE 100 Index Future Sept 26	—	4,88
E-mini S&P 500 Future Sept 26	—	4,31
Eurx/Eurx Er Stx 50 9/2026	—	2,95
United States Treasury Bills...	—	2,46
United States Treasury Bills...	—	1,92
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		61,40
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		9

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	40,86
Societario	0,96
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	65,13
Derivati	-6,95

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	82,67
Da 0 a 4 cedole	3,30
Da 4 a 6 cedole	14,03
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	**79,99**
Stati Uniti	79,13
Canada	0,19
America Latina e Centrale	0,67
Europa	**19,53**
Regno Unito	18,31
Europa Occidentale - Euro	0,28
Europa Occidentale - Non Euro	0,82
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,11
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,48**
Giappone	0,01
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,33
Asia - Emergente	0,12

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	20/08/2009
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (11/11/2026)	EUR 374,87
Patrimonio Netto (Mln) (31/08/2026)	314,28 USD

Patrimonio Classe (Mln) (10/11/2026)	12,94 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0398684661

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,37%
Commissione di incentivo	0,00%

See disclosures for more details

© 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 prodotto; (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.

MORNINGSTAR