

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

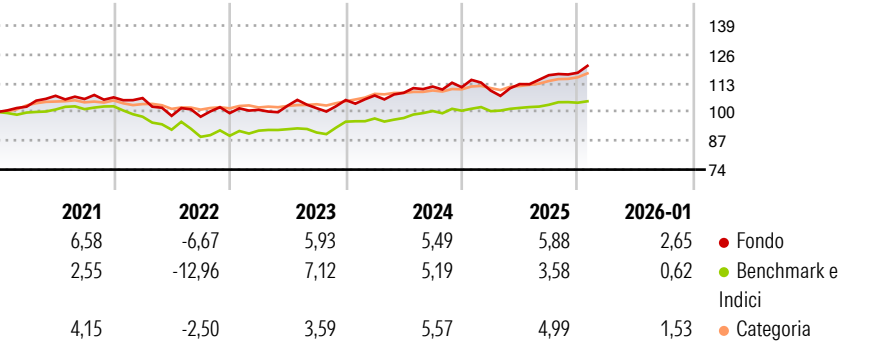
Morningstar Rating™

★★★★

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



Misure di Rischio

3Y Alpha	1,11	3Y Sharpe Ratio	0,48
3Y Beta	1,13	3Y Std Dev	6,30
3Y R-Squared	48,22	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,28	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,57	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,28	0,54	2,86
6-Mesi	8,45	2,87	6,06
1-Anno	5,67	3,46	6,70
3-Anni Ann.ti	5,73	4,33	5,81
5-Anni Ann.ti	3,37	0,97	4,67
10-Anni Ann.ti	3,47	2,11	2,23

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

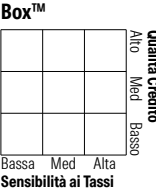
Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
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 30/11/2025

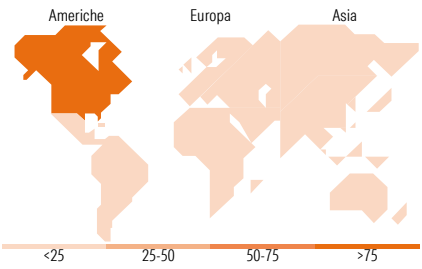


Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	23,34
Euro Stoxx 50 Dec 25	—	9,12
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,48
E-mini S&P 500 Future Dec 25	—	8,33
United States Treasury Bills...	—	6,05
E-mini Nasdaq 100 Future Dec...	—	4,83
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,62
United States Treasury Bills...	—	4,22
FTSE 100 Index Future Dec 25	—	3,43
United States Treasury Bills...	—	2,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,13
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		9

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	23,70
Societario	2,09
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	107,91
Derivati	-33,71

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	75,81
Da 0 a 4 cedole	2,79
Da 4 a 6 cedole	21,40
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>90,28</b>
Stati Uniti	89,39
Canada	0,27
America Latina e Centrale	0,61
<b>Europa</b>	<b>8,83</b>
Regno Unito	8,35
Europa Occidentale - Euro	0,15
Europa Occidentale - Non Euro	0,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,09
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>0,89</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,77
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	13,35 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	20/08/2009	UCITS	Si	Spese correnti	1,37%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0398684661		
NAV (02/02/2026)	EUR 368,93				
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				

(30/11/2025)

© 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.