

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

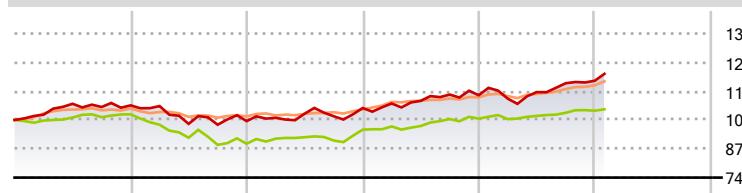
Not Benchmarked

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


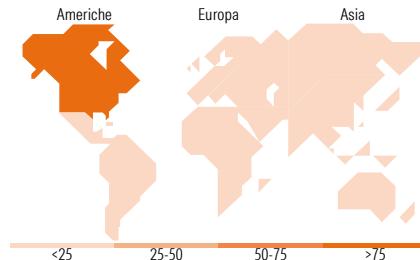
| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-01 | Fondo | Benchmark e Indici | Categoria |
|------|--------|------|------|------|---------|---------|----------------------|-------------|
| 6,58 | -6,67 | 5,93 | 5,49 | 5,88 | 2,65 | ● Fondo | ● Benchmark e Indici | ● Categoria |
| 2,55 | -12,96 | 7,12 | 5,19 | 3,58 | 0,62 | | | |
| | | | | | | | | |
| 4,15 | -2,50 | 3,59 | 5,57 | 4,99 | 1,53 | | | |

| Misure di Rischio | Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------------|------|-----|--------------------------|----|----|----|----|
| 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) | | | | | | | | | |
| Rendimenti aggiornati al 02/02/2026 | | | | | | | | | |

Portafoglio 30/11/2025


| Fixed Income Style Box™ | Netta |
|-------------------------|-------|
| 3-Mesi | 3,28 |
| 6-Mesi | 8,45 |
| 1-Anno | 5,67 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,73 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,37 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,47 |

| Qualità Credito | Duration Effettiva | Maturity effettiva | Qualità Credito Media |
|-----------------|--------------------|--------------------|-----------------------|
| Bassa | | | |
| Med | | | |
| Alta | | | |


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 | |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari | 0 | |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari | 9 | |

Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo | Governativo |
|-------|--------------------------|
| | 23,70 |
| | Societario |
| | Cartolarizzazioni |
| | Enti Locali |
| | Liquidità ed equivalenti |
| | Derivati |

| Fondo | Coupon Range % |
|-------|-------------------|
| | 0 coupon |
| | Da 0 a 4 cedole |
| | Da 4 a 6 cedole |
| | Da 6 a 8 cedole |
| | Da 8 a 10 cedole |
| | Da 10 a 12 cedole |
| | Oltre 12 cedole |

Ripartizione Geografica %

| Fondo | America |
|-------|-------------------------------|
| | 90,28 |
| | Stati Uniti |
| | Canada |
| | America Latina e Centrale |
| | Europa |
| | Regno Unito |
| | Europa Occidentale - Euro |
| | Europa Occidentale - Non Euro |
| | Europa dell'Est |
| | Africa |
| | Medio Oriente |
| | Asia |
| | Giappone |
| | Australasia |
| | Asia - Paesi Sviluppati |
| | Asia - Emergenti |

Anagrafica

| | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-----------------------------------------|--------------|------------------------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) (02/02/2026) | 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 |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo |
| Data Inizio Gestione | 06/11/2023 | ISIN | LU0398684661 | 0,00% |
| NAV (02/02/2026) | EUR 368,93 | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 248,83 USD | | | |
| (30/11/2025) | | | | |