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

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

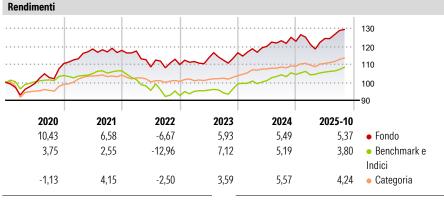
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report **Benchmark Dichiarato**

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.



Misure di Rischio					
3Y Alpha	0,04	3Y Sharpe Ratio	0,38		
3Y Beta	1,06	3Y Std Dev	6,54		
3Y R-Squared	54,94	3Y Risk	+Med		
3Y Info Ratio	0,02	5Y Risk	+Med		
3Y Tracking Error	4,40	10Y Risk	+Med		
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Cautious	Global Target Allocation N	R EUR (dove		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,38	1,38	2,50	Trimestrali %				
6-Mesi	4,50	3,16	4,14	2025	-1,39	2,70	3,56	-
1-Anno	3,09	3,73	5,14	2024	1,94	1,12	2,60	-0,27
3-Anni Ann.ti	4,46	4,81	4,96	2023	1,51	1,85	-1,11	3,61
5-Anni Ann.ti	3,78	0,98	4,12	2022	-0,29	-7,54	-0,41	1,66
10-Anni Ann.ti	2,69	1,96	1,89	2021	2,38	4,80	-1,36	0,70
Rendimenti aggiornati al 14/11/2	2025							

Portafoglio 31/08/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index	_	22,88
E-mini S&P 500 Future Sept 25	_	10,74
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	8,52
Euro Stoxx 50 Sep 25	_	7,90
E-mini Nasdaq 100 Future	_	5,31
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,93
United States Treasury Bills	_	4,46
United States Treasury Notes	_	3,27
United States Treasury Notes	_	3,00
United States Treasury Bills	-	2,35
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		73,35
Numero Complessivo di Titoli Azionari		C
Numero Complessivo di Titoli Obbligazi	onari	17

₩ Governativo	2,29
Societario	3,86
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	119,87
■ Derivati	-26,02
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	29,66
0 coupon Da 0 a 4 cedole	29,66 27,15
•	,
Da 0 a 4 cedole	27,15
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole	27,15 43,19
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole	27,15 43,19 0,00
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole Da 8 a 10 cedole	27,15 43,19 0,00 0,00

Ripartizione Geografica %	Fondo		
America	98,45		
Stati Uniti	97,52		
Canada	0,29		
America Latina e Centrale	0,64		
Europa	0,91		
Regno Unito	0,42		
Europa Occidentale - Euro	0,15		
Europa Occidentale - Non Euro	0,22		
Europa dell'Est	0,00		
Africa	0,10		
Medio Oriente	0,01		
Asia	0,63		
Giappone	0,01		
Australasia	0,02		
Asia - Paesi Sviluppati	0,50		
Asia - Emergente	0,11		

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 (14/11/2025)	EUR 353,62
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD
(0.4.100.100.05)	

Patrimonio Classe (MIn)	12,78 USE
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUF
UCITS	S
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU039868466′

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

(31/08/2025)