

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

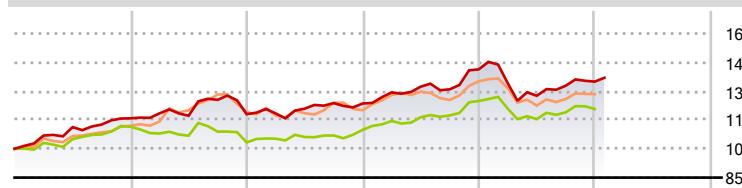
Not Benchmarked

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


2021 2022 2023 2024 2025 2026-01

15,87	1,86	4,70	14,37	-4,51	1,49
11,48	-7,32	6,35	13,67	-3,35	-0,59
13,07	7,54	0,91	13,92	-4,44	0,49

Misure di Rischio

3Y Alpha	0,90	3Y Sharpe Ratio	0,25
3Y Beta	0,81	3Y Std Dev	8,64
3Y R-Squared	50,19	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,08	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,60	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

3-Mesi	1,77	Fondo	Bmk	Cat
6-Mesi	6,30		2,24	5,70
1-Anno	-5,23		-4,27	-3,36
3-Anni Ann.ti	4,97		4,60	5,47
5-Anni Ann.ti	5,54		3,39	8,46
10-Anni Ann.ti	5,10		4,20	3,91

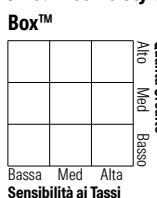
Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

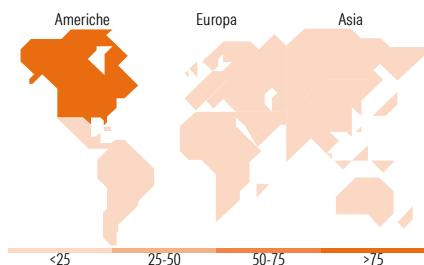
2026	-	-	-	
2025	-5,08	-4,89	4,10	1,61
2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
2023	0,34	2,06	2,42	-0,18
2022	2,23	-1,08	7,09	-5,95

Portafoglio 30/11/2025


	Asset Allocation %	Netta
• Azioni	47,83	
• Obbligazioni	0,62	
• Liquidità	54,25	
• Altro	-2,70	

Fixed Income Style Box™


Duration Effettiva
Maturity 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	
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	9	

Fixed Income Sector Weightings %

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

Coupon Range %

0 coupon	75,81	Fondo
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 %

America	90,28
Stati Uniti	89,39
Canada	0,27
America Latina e Centrale	0,61
Europa	8,83
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
Asia	0,89
Giappone	0,00
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,77
Asia - Emergenti	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln) (04/02/2026)	14,89 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	16/06/2008	UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038167	0,00%
NAV (04/02/2026)	EUR 564,42			
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD			

(30/11/2025)