

# 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

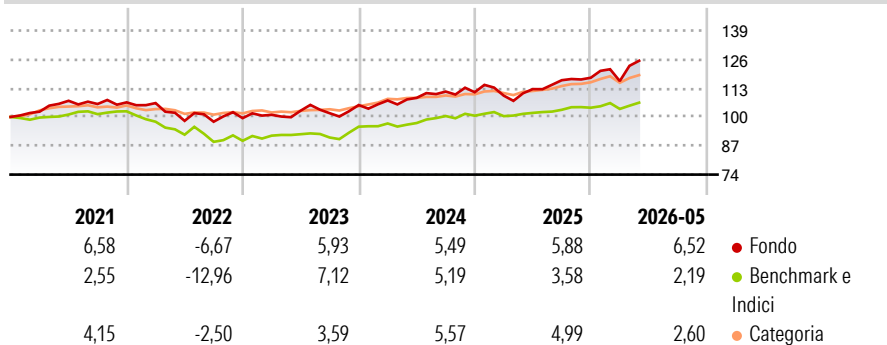
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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	2,16	3Y Sharpe Ratio	0,66
3Y Beta	1,33	3Y Std Dev	7,53
3Y R-Squared	54,38	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,54	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,29	10Y Risk	+Med

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

### Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,12	0,49	0,78
6-Mesi	4,94	1,49	3,37
1-Anno	10,25	3,83	6,56
3-Anni Ann.ti	6,66	4,68	6,88
5-Anni Ann.ti	3,00	0,93	4,35
10-Anni Ann.ti	3,52	1,91	2,17

Rendimenti aggiornati al 10/06/2026

### Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-1,28	-	-	-
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 28/02/2026



#### Asset Allocation %

Azioni	45,93
Obbligazioni	16,71
Liquidità	45,32
Altro	-7,96

#### Fixed Income Style

##### Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Sensibilità ai Tassi			
Bassa			
Med			
Alta			

Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

#### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
F/C E-Mini Russ 2000 Mar26	—	23,56
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,54
Eurx/Eurx Er Stx 50 3/2026	—	8,39
E-mini S&P 500 Future Mar 26	—	8,25
Cmrc/Imm Emimi Nsdq 3/2026	—	6,15
10 Year Treasury Note Future...	—	5,61
United States Treasury Bills...	—	5,18
United States Treasury Bills...	—	3,51
United States Treasury Bills...	—	3,14
United States Treasury Bills...	—	2,45
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		74,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		6

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	40,99
Societario	0,69
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	76,66
Derivati	-18,34

### Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	96,12
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	3,88
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>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	13,19 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,37%
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 (10/06/2026)	EUR 378,39				
Patrimonio Netto (Mln)	271,37 USD				

(28/02/2026)

[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 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.