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	0,15	3Y Sharpe Ratio	0,27		
3Y Beta	1,09	3Y Std Dev	6,50		
3Y R-Squared	54,40	3Y Risk	+Med		
3Y Info Ratio	0,04	5Y Risk	+Med		
3Y Tracking Error	4,40	10Y Risk	+Med		
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Cautious	Global Target Allocation NI	R EUR (dove		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,47	1,28	2,37	Trimestrali %	-			
6-Mesi	5,39	2,70	3,20	2025	-1,39	2,70	3,56	-
1-Anno	3,52	2,28	4,22	2024	1,94	1,12	2,60	-0,27
3-Anni Ann.ti	5,11	4,30	4,74	2023	1,51	1,85	-1,11	3,61
5-Anni Ann.ti	3,67	0,91	4,02	2022	-0,29	-7,54	-0,41	1,66
10-Anni Ann.ti	2,83	1,97	1,83	2021	2,38	4,80	-1,36	0,70
Rendimenti aggiornati al 05/12/2	2025							

Portafoglio 30/09/2025



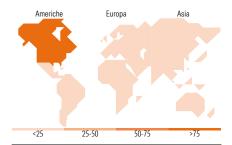


Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index	_	22,00
E-mini S&P 500 Future Dec 25	_	8,68
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	8,47
Euro Stoxx 50 Dec 25	-	7,23
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,67
United States Treasury Bills	_	4,23
E-mini Nasdaq 100 Future Dec	-	3,48
United States Treasury Notes	-	2,78
FTSE 100 Index Future Dec 25	_	2,77
United States Treasury Bills	_	2,23
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		66,53
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	C
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	13

₩ Governativo	13,31
Societario	2,36
☆ Cartolarizzazioni	0,00
🔀 Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	117,43
Derivati	-33,10
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,92
Da 0 a 4 cedole	50,91
Da 4 a 6 cedole	48,18
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		
America	91,35		
Stati Uniti	90,48		
Canada	0,23		
America Latina e Centrale	0,63		
Europa	7,85		
Regno Unito	7,35		
Europa Occidentale - Euro	0,14		
Europa Occidentale - Non Euro	0,26		
Europa dell'Est	0,00		
Africa	0,10		
Medio Oriente	0,01		
Asia	0,80		
Giappone	0,00		
Australasia	0,02		
Asia - Paesi Sviluppati	0,68		
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 (05/12/2025)	EUR 358,93
Patrimonio Netto (MIn)	246,62 USD
(30/09/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	12,96 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0398684661

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

(30/09/2025