

# 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

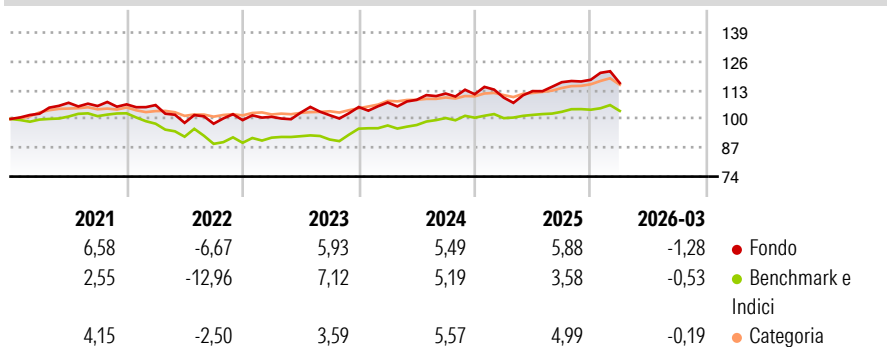
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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	0,40	3Y Sharpe Ratio	0,29
3Y Beta	1,24	3Y Std Dev	6,85
3Y R-Squared	55,27	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,12	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,69	10Y Risk	+Med

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

### Rend. Cumulati %

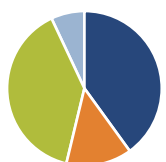
Periodo	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,68	-0,05	0,33
6-Mesi	4,06	0,88	3,14
1-Anno	15,06	5,71	8,83
3-Anni Ann.ti	6,48	4,72	5,66
5-Anni Ann.ti	3,13	0,90	4,07
10-Anni Ann.ti	3,33	1,92	2,17

Rendimenti aggiornati al 15/04/2026

### Rendimenti

Periodo	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 31/01/2026



#### Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

#### Netta

46,54  
15,97  
45,63  
-8,14

#### Fixed Income Style

##### Box™



Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

#### Fondo



### Titoli principali

Nome	Settore	%
F/C E-Mini Russ 2000 Mar26	-	24,30
E-mini S&P 500 Future Mar 26	-	8,33
Eurx/Eurx Er Stx 50 3/2026	-	7,96
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	7,19
Cmrc/Imm Emimi Nsdq 3/2026	-	6,11
United States Treasury Bills...	-	5,34
10 Year Treasury Note Future...	-	4,50
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,41
United States Treasury Bills...	-	3,72
United States Treasury Bills...	-	3,24
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		75,10
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		7

### Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	40,60
Societario	0,72
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	77,50
Derivati	-18,82

### Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	96,13
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	3,87
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 %

Regione	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)	13,26 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 (15/04/2026)	EUR 371,27				
Patrimonio Netto (Mln)	262,45 USD				

(31/01/2026)

© 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.