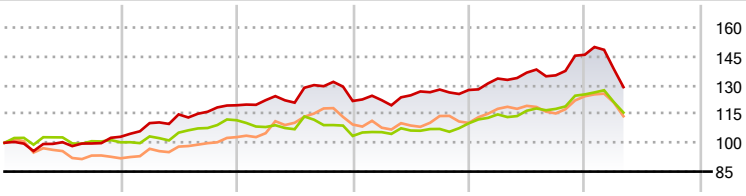
Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001010	Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report	Not Benchmarked	★★★★

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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-04	
3,14	15,88	1,87	4,71	14,38	-11,54	Fondo
0,24	11,48	-7,32	6,35	13,67	-7,57	Benchmark e Indici
-7,73	13,07	7,54	0,91	13,92	-8,30	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-0,71	3Y Sharpe Ratio	-0,09
3Y Beta	0,75	3Y Std Dev	9,76
3Y R-Squared	61,85	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,15	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,88	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-12,68	-8,26	-8,14
6-Mesi	-5,44	-2,57	-1,30
1-Anno	-1,78	1,50	-1,51
3-Anni Ann.ti	1,55	2,04	3,09
5-Anni Ann.ti	5,96	2,62	5,61
10-Anni Ann.ti	3,56	3,63	3,11

Rendimenti aggiornati al 02/05/2025

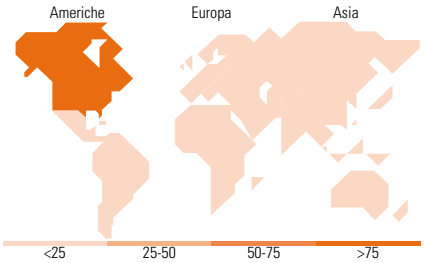
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-5,09	-	-	-
2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
2023	0,35	2,06	2,42	-0,18
2022	2,23	-1,07	7,10	-5,95
2021	6,89	4,12	1,19	2,90

Portafoglio 31/01/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	48,43
Obbligazioni	-6,34
Liquidità	57,47
Altro	0,44

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	22,73
Euro Stoxx 50 Mar 25	—	21,72
E-mini S&P 500 Future Mar 25	—	11,62
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,54
United States Treasury Bills...	—	4,21
United States Treasury Bills...	—	3,48
United States Treasury Notes...	—	3,05
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,38
United States Treasury Bills...	—	1,90
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,89
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		81,52
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		26

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	13,30
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	51,15
Derivati	35,55

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	35,31
Da 0 a 4 cedole	57,73
Da 4 a 6 cedole	6,96
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	**99,42**
Stati Uniti	98,91
Canada	0,06
America Latina e Centrale	0,45
Europa	**0,38**
Regno Unito	0,06
Europa Occidentale - Euro	0,11
Europa Occidentale - Non Euro	0,14
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,06
Asia	**0,20**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,14
Asia - Emergente	0,06

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	16/06/2008
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (02/05/2025)	USD 384,17
Patrimonio Netto (Mln) (31/01/2025)	247,21 USD

Patrimonio Classe (Mln) (02/05/2025)	3,21 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0370038324

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,35%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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 prodotto; (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.