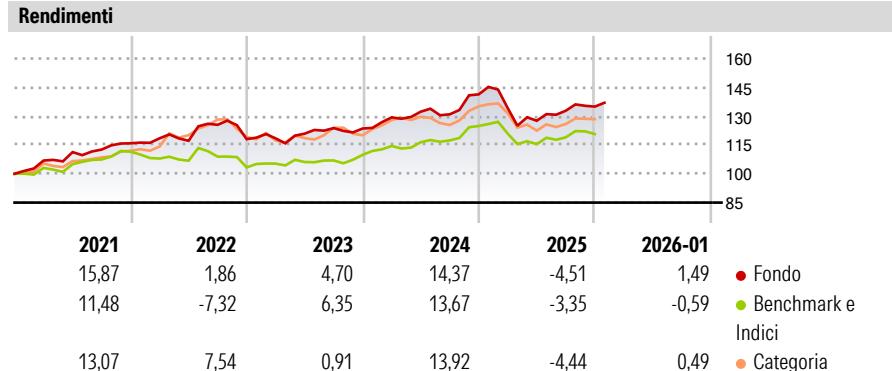


Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap EUR

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 Dichiарато

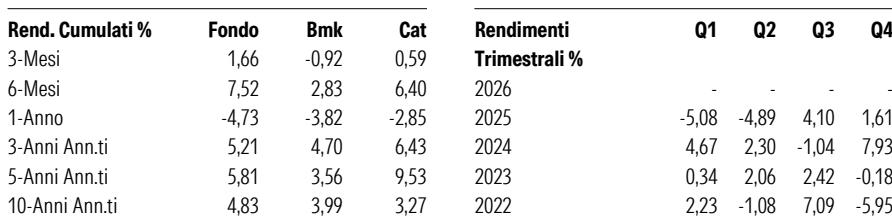
Il presente comparto mira a replicare i rendimenti realizzati da un indice hedge fund, attraverso la combinazione di un numero ristretto di asset class di tipo tradizionale e liquide, avvalendosi di sofisticate tecniche di elaborazione di modelli finanziari e di una gestione dinamica dell'asset allocation.



Misure di Rischio

3Y Alpha	0,90	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)

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



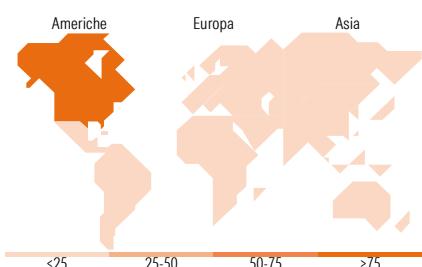
Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style Box™			Qualità Credito
Bassa	Med	Alta	Basso

Sensibilità ai Tassi



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		9

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

Coupon Range %		Fondo
0 coupon		75,81
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 %	Fondo
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 - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	14,96 USD	Investimento Min. Ingresso	-
	(02/02/2026)			Investimento Min. Successivo	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,35%
Data di Partenza	16/06/2008	UCITS	Si	Commissione di incentivo	0,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038167		
NAV (02/02/2026)	EUR 565,77				
Patrimonio Netto (Mln)	248,83 USD				

© 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 prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferibili a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e dei dati forniti. I dati sono esclusivamente indicativi. Non vanno considerati come consiglio di investimento.