

Goldman Sachs Alternative Beta - X Cap EUR

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

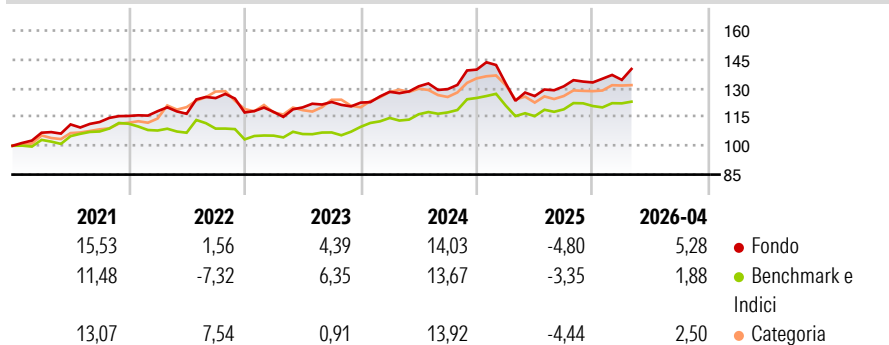
Morningstar Rating™

★★★★

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	1,14	3Y Sharpe Ratio	0,46
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	8,76
3Y R-Squared	57,92	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,24	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,92	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,76	2,48	2,67
6-Mesi	4,34	0,61	3,04
1-Anno	13,42	6,53	7,56
3-Anni Ann.ti	6,76	5,62	6,59
5-Anni Ann.ti	5,49	3,78	8,29
10-Anni Ann.ti	5,11	4,31	4,09

Rendimenti aggiornati al 30/04/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	1,01	-	-	-
2025	-5,16	-4,96	4,02	1,53
2024	4,60	2,23	-1,12	7,85
2023	0,27	1,98	2,34	-0,25
2022	2,15	-1,15	7,01	-6,02

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			

Fondo
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
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	53,45 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,65%
Data di Partenza	25/09/2008	UCITS	Si	Spese correnti	1,65%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038597		
NAV (30/04/2026)	EUR 555,08				
Patrimonio Netto (Mln)	271,37 USD				

(28/02/2026)

© 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.