Goldman Sachs Alternative Beta - X Cap EUR

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report

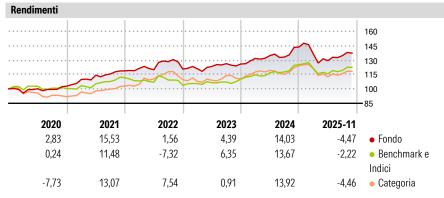
Benchmark Dichiarato

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.



Misure di Rischio					
3Y Alpha	-1,00	3Y Sharpe Ratio	-0,02		
3Y Beta	0,82	3Y Std Dev	9,32		
3Y R-Squared	55,68	3Y Risk	+Med		
3Y Info Ratio	-0,38	5Y Risk	+Med		
3Y Tracking Error	4,47	10Y Risk	+Med		
Basati su Morningstar US applicabile)	Conserva	tive Target Allocation NF	R USD (dove		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,99	1,76	3,34	Trimestrali %				
6-Mesi	4,12	3,57	3,48	2025	-5,16	-4,96	4,02	-
1-Anno	-5,73	-3,63	-3,20	2024	4,60	2,23	-1,12	7,85
3-Anni Ann.ti	3,69	4,43	4,35	2023	0,27	1,98	2,34	-0,25
5-Anni Ann.ti	5,75	3,79	8,90	2022	2,15	-1,15	7,01	-6,02
10-Anni Ann.ti	3,82	3,76	3,19	2021	6,81	4,04	1,11	2,82
Rendimenti aggiornati al 17/12/2	2025							

Portafoglio 30/09/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali		
Nome Sett	ore	%
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 Azionari		C
Numero Complessivo di Titoli Obbligaziona	ri	13

(30/09/2025)

☑ Societario 2,30 ☑ 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 50,92 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		
Cartolarizzazioni 0,00 Enti Locali 0,00 Liquidità ed equivalenti 117,42 Derivati -33,10 Coupon Range % Fondo 0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,92 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	₩ Governativo	13,31
Enti Locali 0,00 Liquidità ed equivalenti 117,42 Derivati -33,10 Coupon Range % Fondo 0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,99 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	Societario	2,36
□ Liquidità ed equivalenti 117,43 □ Derivati -33,10 Coupon Range % Fondo 0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,99 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	★ Cartolarizzazioni	0,00
Coupon Range % Fondo 0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,92 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	Enti Locali	0,00
Coupon Range % Fondo 0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,92 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	🚅 Liquidità ed equivalenti	117,43
0 coupon 0,92 Da 0 a 4 cedole 50,92 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	Derivati	-33,10
Da 0 a 4 cedole 50,9° 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	Coupon Range %	Fondo
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	0 coupon	0,92
Da 6 a 8 cedole 0,00 Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 0 a 4 cedole	50,91
Da 8 a 10 cedole 0,00 Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 4 a 6 cedole	48,18
Da 10 a 12 cedole 0,00	Da 6 a 8 cedole	0,00
•	Da 8 a 10 cedole	0,00
Oltre 12 cedole 0.00	Da 10 a 12 cedole	0,00
5,00	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.	Patrimonio Classe (MIn) (17/12/2025)	55,98 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti
Data di Partenza	25/09/2008	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038597	
NAV (17/12/2025)	EUR 522,55			
Patrimonio Netto (MIn)	246,62 USD			

M/RNINGSTAR

1,65% 0,00%