

Goldman Sachs Alternative Beta - X Cap USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar
Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

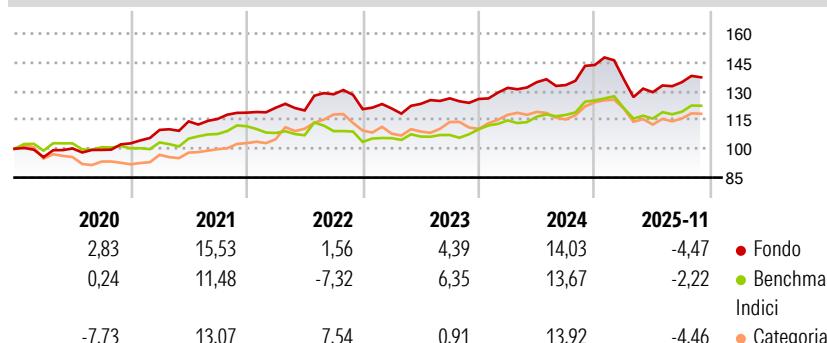
Not Benchmarked

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	-1,00	3Y Sharpe Ratio	-0,02
3Y Beta	0,82	3Y Std Dev	9,32
3Y R-Squared	55,70	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,38	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,47	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %

3-Mesi	2,00	Bmk	3,34
6-Mesi	4,12	3,57	3,48
1-Anno	-5,73	-3,63	-3,20
3-Anni Ann.ti	3,69	4,43	4,35
5-Anni Ann.ti	5,75	3,79	8,90
10-Anni Ann.ti	3,82	3,76	3,19

Rendimenti aggiornati al 17/12/2025

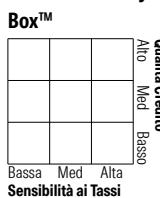
Fondo
Bmk
Cat
Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-5,16	-4,96	4,02	-
2024	4,59	2,23	-1,11	7,85
2023	0,27	1,98	2,34	-0,25
2022	2,16	-1,15	7,01	-6,02
	6,80	4,04	1,11	2,82

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %

• Azioni	39,58
• Obbligazioni	2,30
• Liquidità	57,92
• Altro	0,20

Fixed Income Style Box™

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo


<25 25-50 50-75 >75

Titoli principali

Nome	Settore	%
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
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	13	

Fixed Income Sector Weightings %

Governativo	13,31
Societario	2,36
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	117,43
Derivati	-33,10

Coupon Range %

0 coupon	0,92
Da 0 a 4 cedole	50,91
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
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 - Emergenti	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln) (17/12/2025)	2,95 USD	Investimento Min. Ingresso
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.
Data di Partenza	25/09/2008	UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038670	0,00%
NAV (17/12/2025)	USD 420,01			
Patrimonio Netto (Mln)	246,62 USD			

(30/09/2025)

© 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 produttori; (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.