## **Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap USD**

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001010

**Benchmark Morningstar** 

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

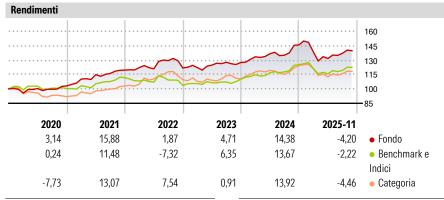
Not Benchmarked

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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-0,70	3Y Sharpe Ratio	0,01
3Y Beta	0,82	3Y Std Dev	9,32
3Y R-Squared	55,72	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,31	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	2,57	1,14	2,11	Trimestrali %				
6-Mesi	5,00	4,00	3,62	2025	-5,09	-4,89	4,10	-
1-Anno	-5,32	-3,85	-3,89	2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
3-Anni Ann.ti	3,67	4,11	4,05	2023	0,35	2,06	2,42	-0,18
5-Anni Ann.ti	6,36	3,70	8,83	2022	2,23	-1,07	7,10	-5,95
10-Anni Ann.ti	4,47	3,94	3,41	2021	6,89	4,12	1,19	2,90
Rendimenti aggiornati al 12/12/2	2025							

## Portafoglio 30/09/2025



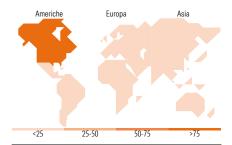


Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



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
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	C
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	13

₩ Governativo	13,31
Societario	2,36
<b>☆</b> 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	50,91
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 - Emergente	0,11

Anagrafica		
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset	Patrimonio Classe (Mlr
	Management B.V.	(12/12/2025)
Telefono	+31-703781781	Domicilio
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo
Data di Partenza	16/06/2008	UCITS
Nome del Gestore	-	Inc/Acc
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN
NAV (12/12/2025)	USD 423,07	
Patrimonio Netto (MIn)	246,62 USD	
(30/09/2025)		

3,10 USD	Investimento Min. Ingresso	-
	Investimento Min. Successivo	-
ISSEMBURGO	T.E.R.	-
USD	Spese correnti	1,35%
Si	Commissione di incentivo	0,00%
Acc		
U0370038324		
	USSEMBURGO USD Si Acc	Investimento Min. Successivo USSEMBURGO T.E.R. USD Spese correnti Si Commissione di incentivo Acc

M RNINGSTAR