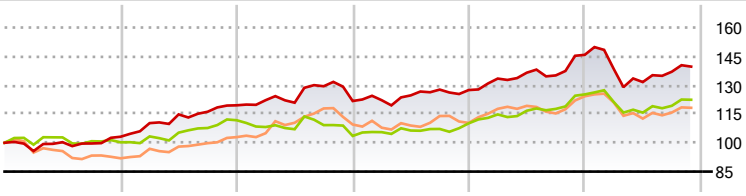
Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap EUR

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 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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
3,14	15,87	1,86	4,70	14,37	-4,20	Fondo
0,24	11,48	-7,32	6,35	13,67	-2,22	Benchmark e Indici
-7,73	13,07	7,54	0,91	13,92	-4,46	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-0,70	3Y Sharpe Ratio	0,01
3Y Beta	0,82	3Y Std Dev	9,32
3Y R-Squared	55,70	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,31	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,47	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,85	2,79	3,80
6-Mesi	4,97	4,55	2,93
1-Anno	-3,91	-2,48	-2,75
3-Anni Ann.ti	3,76	4,48	4,14
5-Anni Ann.ti	6,54	3,99	8,97
10-Anni Ann.ti	4,27	3,89	3,30

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

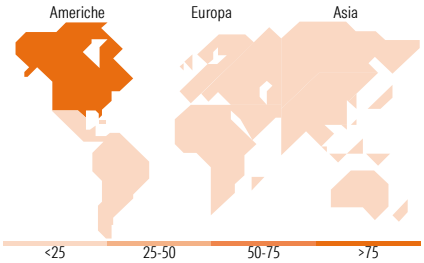
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-5,08	-4,89	4,10	-
2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
2023	0,34	2,06	2,42	-0,18
2022	2,23	-1,08	7,09	-5,95
2021	6,88	4,12	1,19	2,90

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	39,58
Obbligazioni	2,30
Liquidità	57,92
Altro	0,20

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



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 Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		13

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	13,31
Societario	2,36
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 Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	16/06/2008
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (05/12/2025)	EUR 555,39
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	246,62 USD

Patrimonio Classe (Mln) (05/12/2025)	15,28 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0370038167

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,35%
Commissione di incentivo	0,00%

© 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 prodotto; (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.

MORNINGSTAR