

Goldman Sachs Alternative Beta - P Cap EUR

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Not Benchmarked

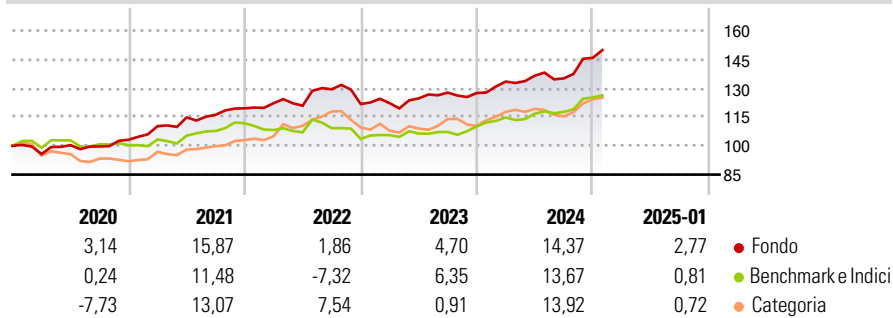
Morningstar Rating™

★★★★

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	2,33	3Y Sharpe Ratio	0,69
3Y Beta	0,73	3Y Std Dev	7,81
3Y R-Squared	67,47	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,66	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,63	10Y Risk	+Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	8,96	6,68	7,55	2025	-	-	-	-
6-Mesi	14,64	8,29	9,28	2025	-	-	-	-
1-Anno	16,17	12,02	12,14	2024	4,67	2,30	-1,04	7,93
3-Anni Ann.ti	8,59	5,64	8,94	2023	0,34	2,06	2,42	-0,18
5-Anni Ann.ti	8,09	4,17	6,47	2022	2,23	-1,08	7,09	-5,95
10-Anni Ann.ti	5,38	4,81	4,35	2021	6,88	4,12	1,19	2,90

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/11/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	44,74
Obbligazioni	-0,67
Liquidità	55,84
Altro	0,09

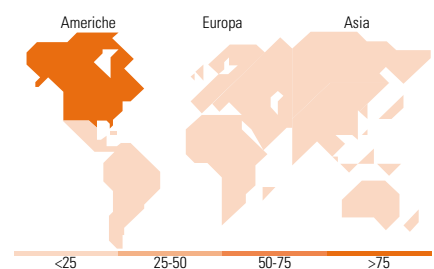
Fixed Income

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	%
E-mini Russell 2000 Index...	—	21,59
Euro Stoxx 50 Dec 24	—	16,07
E-mini S&P 500 Future Dec 24	—	9,12
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	8,49
United States Treasury Bills...	—	7,52
United States Treasury Notes...	—	3,05
United States Treasury Bills...	—	1,79
FTSE 100 Index Future Dec 24	—	1,41
United States Treasury Bills...	—	1,14
United States Treasury Bills...	—	1,02
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		71,20
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		25

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	8,77
🏢 Societario	0,38
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏘️ Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	77,33
📄 Derivati	13,52

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	62,85
Da 0 a 4 cedole	27,60
Da 4 a 6 cedole	9,55
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	95,19
Stati Uniti	94,64
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,47
Europa	4,61
Regno Unito	4,18
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,23
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,06
Asia	0,20
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,14
Asia - Emergente	0,06

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	24,02 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,35%
Data di Partenza	16/06/2008	UCITS	Si	Spese correnti	1,35%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038167		
NAV (04/02/2025)	EUR 595,57				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)