

# 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

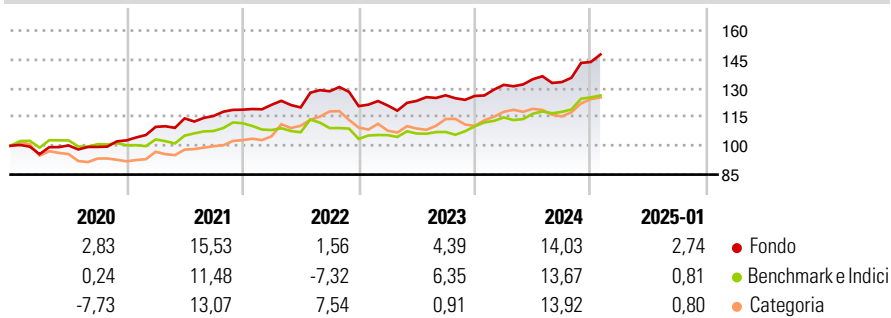
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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.

### Rendimenti



### Misure di Rischio

3Y Alpha	2,02	3Y Sharpe Ratio	0,66
3Y Beta	0,73	3Y Std Dev	7,81
3Y R-Squared	67,45	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,59	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	6,25	5,33	6,98	2025	-	-	-	-
6-Mesi	16,51	9,97	10,99	2024	4,60	2,23	-1,12	7,85
1-Anno	15,56	12,19	12,58	2023	0,27	1,98	2,34	-0,25
3-Anni Ann.ti	8,42	5,81	9,81	2022	2,15	-1,15	7,01	-6,02
5-Anni Ann.ti	7,77	4,06	6,51	2021	6,81	4,04	1,11	2,82
10-Anni Ann.ti	5,01	4,80	4,22					

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

### Portafoglio 30/11/2024



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

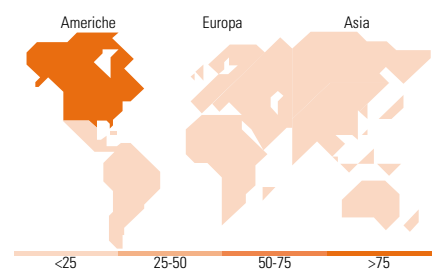
### Fixed Income

#### 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
<b>America</b>	<b>95,19</b>
Stati Uniti	94,64
Canada	0,08
America Latina e Centrale	0,47
<b>Europa</b>	<b>4,61</b>
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
<b>Asia</b>	<b>0,20</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppatti	0,14
Asia - Emergente	0,06

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	66,72 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,65%
Data di Partenza	25/09/2008	UCITS	Si	Spese correnti	1,65%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023	ISIN	LU0370038597		
NAV (07/02/2025)	EUR 573,62				
Patrimonio Netto (Mln)	245,36 USD				

(30/11/2024)