Goldman Sachs Alternative Beta - X Cap USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report

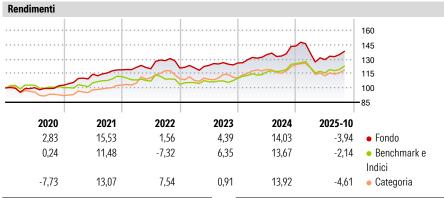
Benchmark Dichiarato

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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-1,09	3Y Sharpe Ratio	-0,07
3Y Beta	0,79	3Y Std Dev	9,39
3Y R-Squared	55,94	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,47	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,56	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	5,88	3,90	4,77	Trimestrali %				
6-Mesi	7,36	5,93	3,64	2025	-5,16	-4,96	4,02	-
1-Anno	1,37	3,21	3,52	2024	4,59	2,23	-1,11	7,85
3-Anni Ann.ti	1,79	3,82	2,93	2023	0,27	1,98	2,34	-0,25
5-Anni Ann.ti	6,67	4,02	9,34	2022	2,16	-1,15	7,01	-6,02
10-Anni Ann.ti	3,98	3,99	3,44	2021	6,80	4,04	1,11	2,82
Rendimenti aggiornati al 03/11/2	2025							

Portafoglio 31/08/2025





Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Setto	re	%
E-mini Russell 2000 Index	_	22,88
E-mini S&P 500 Future Sept 25	-	10,74
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	8,52
Euro Stoxx 50 Sep 25	-	7,90
E-mini Nasdaq 100 Future	_	5,31
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,93
United States Treasury Bills	-	4,46
United States Treasury Notes	_	3,27
United States Treasury Notes	_	3,00
United States Treasury Bills	-	2,35
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		73,35
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
NumeroComplessivodiTitoliObbligazionari		17

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	
₩ Governativo	2,29	
Societario	3,86	
★ Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
🚅 Liquidità ed equivalenti	119,87	
■ Derivati	-26,02	
Coupon Range %	Fondo	
0 coupon	29,66	
Da 0 a 4 cedole	27,15	
Da 4 a 6 cedole	43,19	
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	98,45
Stati Uniti	97,52
Canada	0,29
America Latina e Centrale	0,64
Europa	0,91
Regno Unito	0,42
Europa Occidentale - Euro	0,15
Europa Occidentale - Non Euro	0,22
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,10
Medio Oriente	0,01
Asia	0,63
Giappone	0,01
Australasia	0,02
Asia - Paesi Sviluppati	0,50
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	25/09/2008
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	06/11/2023
NAV (03/11/2025)	USD 420,00
Patrimonio Netto (MIn)	232,84 USD
(24/00/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	3,04 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0370038670

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti 1,0	55%
Commissione di incentivo 0,0	00%

(31/08/2025)