Goldman Sachs Alternative Beta - X Cap USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report

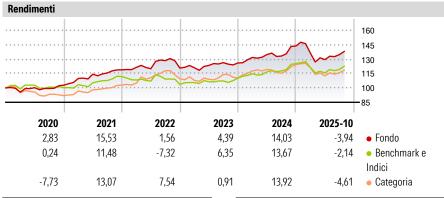
Benchmark Dichiarato

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)