GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Not Categorized

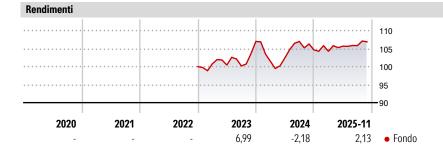
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Portfolio seeks capital appreciation by investing in the Strategic Volatility Premium which offers exposure to financial derivative instruments. The Portfolio will, under normal circumstances, invest primarily in the underlying assets comprised in the Strategic Volatility Premium, as further described below, which is a factor within the proprietary Strategic Factor Allocation process ("Strategic Allocation") of the Goldman Sachs Investment Strategy Group ("ISG"). ISG is a group of researchers, economists and strategists within Goldman Sachs & Co, LLC, responsible for strategic and tactical asset allocation recommendations for Goldman Sachs and its clients by employing a range of fundamental, quantitative and technical analysis at...



| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|---|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | -0,18 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 5,30 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |
| | | | |

| Rend. Cumulati % | Fondo | Rendimenti | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|-------------------------------------|-------|---------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 0,30 | Trimestrali % | | | | |
| 6-Mesi | 2,07 | 2025 | -0,41 | 1,39 | 0,15 | - |
| 1-Anno | 0,39 | 2024 | -5,15 | 0,92 | 4,46 | -2,17 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,91 | 2023 | 0,78 | -0,35 | -0,23 | 6,78 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 2022 | = | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | 2021 | = | - | - | - |
| Rendimenti aggiornati al 12/12/2025 | | | | | | |

Portafoglio 30/09/2025





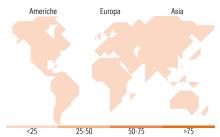
Tit Governativo

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | |
| | |
| | |

Fondo

35,72



| Titoli principali | | |
|---------------------------------------|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 13,64 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 6,99 |
| GS USD Treasury Liq Res X Inc | _ | 6,14 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 3,79 |
| Federal Farm Credit Banks | _ | 3,44 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 3,28 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 2,78 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 2,43 |
| Federal Home Loan Banks 0% | _ | 2,32 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 2,31 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 47,12 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| NumeroComplessivodiTitoliObbligazi | onari | 34 |

| Societario | 0,00 |
|----------------------------|-------|
| ★ Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| 🚅 Liquidità ed equivalenti | 64,28 |
| Derivati | 0,00 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 74,43 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 25,57 |
| 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 | 0,00 |
| Stati Uniti | - |
| Canada | - |
| America Latina e Centrale | - |
| Europa | 0,00 |
| Regno Unito | - |
| Europa Occidentale - Euro | - |
| Europa Occidentale - Non Euro | - |
| Europa dell'Est | - |
| Africa | - |
| Medio Oriente | - |
| Asia | 0,00 |
| Giappone | - |
| Australasia | - |
| Asia - Paesi Sviluppati | - |
| Asia - Emergente | - |

| Allagianica | |
|----------------------|---------------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset |
| | Management B.V. |
| Telefono | +31-703781781 |
| Web | https://am.gs.com/ |
| Data di Partenza | 29/03/2021 |
| Nome del Gestore | Oliver Bunn |
| Data Inizio Gestione | 03/07/2022 |

CHF 93.93

Anagrafica

NAV (12/12/2025)

| Patrimonio Classe (MIn) | 0,20 CHF |
|---|---------------------------------|
| Domicilio Valuta del Fondo UCITS Inc/Acc | LUSSEMBURGO CHF Si Acc |
| ISIN | LU2296488534 |

| Investimento Min. Ingresso | 50.000 CHF |
|------------------------------|------------|
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,57% |
| Spese correnti | 0,57% |
| Commissione di incentivo | 0,00% |

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

Patrimonio Netto (MIn)

501,53 USD

(30/09/2025)

