GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares EUR Hedged Inc

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	-0,14
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,00
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	
3-Mesi	1,02	Trimestrali %				
6-Mesi	2,06	2025	1,96	-0,40	0,67	
1-Anno	2,66	2024	-0,22	0,51	2,84	
3-Anni Ann.ti	2,69	2023	1,70	-1,55	-0,42	
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	
Rendimenti aggiornati al 03/11/2025						

Fondo

37,08

Portafoglio 31/08/2025





₩ Governativo

Fixed Income Sector Weightings %





Q4

-1,79 3,13

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	_	14,41
Federal Home Loan Banks 0%	_	7,38
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,00
Federal Farm Credit Banks	_	3,64
Federal Home Loan Banks 0%	_	3,47
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,56
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,55
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,45
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,44
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,15
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		45,05
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	0
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	36

O Societario	0,00		
★ Cartolarizzazioni	0,00 0,00 62,92		
£ Enti Locali			
🚅 Liquidità ed equivalenti			
Derivati	0,00		
Coupon Range %	Fondo		
0 coupon	68,91		
Da 0 a 4 cedole	0,00		
Da 4 a 6 cedole	31,09		
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		

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	=

Anagrafica	
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

EUR 93,33

NAV (03/11/2025)

Patrimonio Classe (MIn) (03/11/2025)	0,01 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2296489185

Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,57%
Spese correnti	0,55%
Commissione di incentivo	0,00%

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares EUR Hedged Inc

Patrimonio Netto (MIn)

500,49 USD

(31/08/2025)

