

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Inc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

Morningstar Rating™

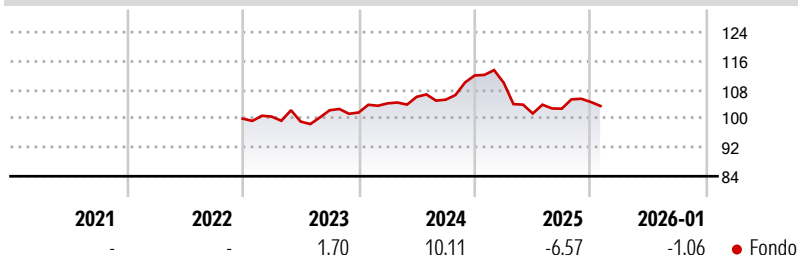
Senza rating

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	-0,22
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,40
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

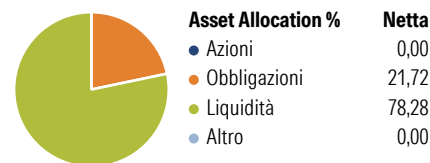
Rendimenti

Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	-0,69
6-Mesi	1,11
1-Anno	-7,50
3-Anni Ann.ti	1,20
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

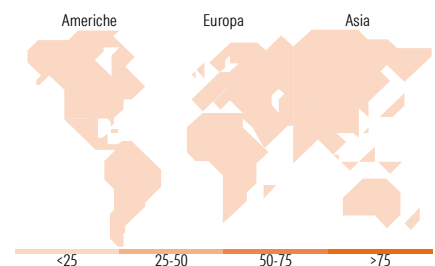
Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
2025	-1,81	-7,76	1,32	1,81
2024	2,51	1,73	-0,74	6,38
2023	0,55	-1,37	3,17	-0,61
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/11/2025

Fixed Income Style
Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	—	13,39
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	12,22
Federal Farm Credit Banks...	—	3,34
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,22
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,73
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,65
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,45
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,28
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,27
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,26
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		46,83
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		28

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	21,72
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	78,28
Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	63,19
Da 0 a 4 cedole	8,54
Da 4 a 6 cedole	28,27
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	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	100,37 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,40%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2296489342		
NAV (11/02/2026)	USD 100,04				

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Inc

Patrimonio Netto (Mln)	512,68 USD
(30/11/2025)	