

# 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

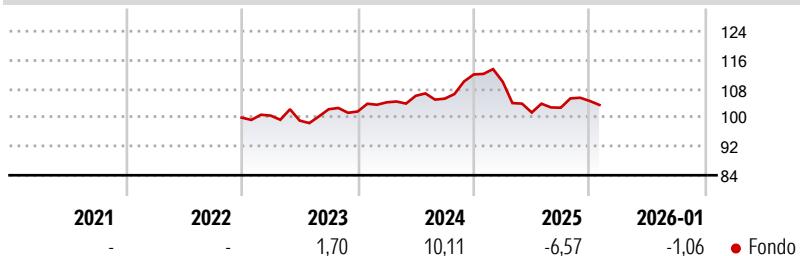
## Morningstar Rating™

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...

### Rendimenti



### 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	-

### Rend. Cumulati %

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	-

### Fondo

### Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
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	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

### Portafoglio 30/11/2025



#### Asset Allocation %

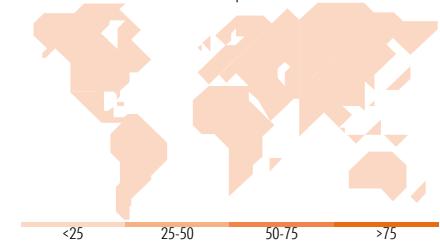
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	21,72
● Liquidità	78,28
● Altro	0,00

#### Netta

#### Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
Alt	Maturity effettiva	-
Med	Qualità Credito Media	-
Basso	Sensibilità ai Tassi	-
Bassa		
Med		
Alta		

#### Americhe



#### Europa



#### Asia



### 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

<b>America</b>	<b>0,00</b>
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	<b>0,00</b>
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	<b>0,00</b>
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergenti	-

### 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	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	<a href="https://am.gs.com/">https://am.gs.com/</a>	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/03/2021	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,40%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	UCITS	Si	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	Inc/Acc	Inc		
NAV (11/02/2026)	USD 100,04	ISIN	LU2296489342		

## GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Inc

Patrimonio Netto (Mln)

512,68 USD

(30/11/2025)