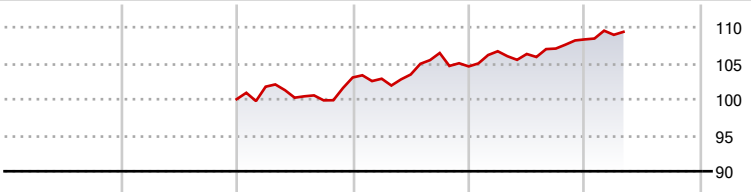
# GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares EUR Hedged Acc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Alt - Volatilità | Not Categorized<br>Usato nel Report | Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD | 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.

## Rendimenti




| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-04 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| - | - | 3,02 | 1,49 | 3,59 | 0,97 | ● Fondo |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | -0,21 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 2,68 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 0,39 |
| 6-Mesi | 1,42 |
| 1-Anno | 4,12 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,27 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,35 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

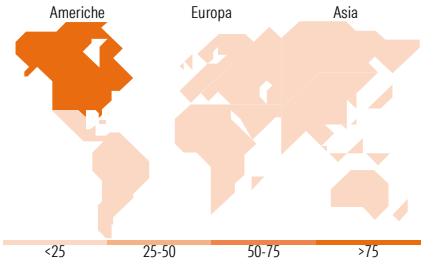
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 0,59 | - | - | - |
| 2025 | 2,01 | -0,36 | 0,71 | 1,19 |
| 2024 | -0,16 | 0,57 | 2,89 | -1,75 |
| 2023 | 1,74 | -1,50 | -0,37 | 3,18 |
| 2022 | - | - | - | - |

## Portafoglio 28/02/2026

| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| ● Azioni | 0,52 |
| ● Obbligazioni | 69,94 |
| ● Liquidità | 29,53 |
| ● Altro | 0,00 |

**Fixed Income Style Box™**

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




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 28,74 |
| Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcbt... | — | 21,27 |
| Goldman Sachs Plc Usd Treasu... | — | 2,81 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 2,13 |
| Federal Farm Credit Banks... | — | 1,80 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 1,77 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 1,53 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 1,48 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 1,45 |
| Federal Home Loan Banks 0% | — | 1,45 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 64,43 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 2 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 43 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 70,31 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 29,69 |
| Derivati | 0,00 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 94,20 |
| Da 0 a 4 cedole | 5,80 |
| Da 4 a 6 cedole | 0,00 |
| 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** | **99,24** |
| Stati Uniti | 99,24 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| **Europa** | **0,46** |
| Regno Unito | 0,04 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,14 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,28 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| **Asia** | **0,30** |
| Giappone | 0,00 |
| Australasia | 0,00 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,00 |
| Asia - Emergente | 0,30 |

## 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 |
| NAV (12/05/2026) | EUR 102,94 |
| Patrimonio Netto (Mln) (28/02/2026) | 1.058,38 USD |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (12/05/2026) | 27,29 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU2296488294 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,40% |
| Spese correnti | 0,40% |
| Commissione di incentivo | 0,00% |

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.