

# GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP 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.

**Rendimenti**

**Misure di Rischio**

|                   |   |                 |      |
|-------------------|---|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,27 |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | 4,65 |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | -    |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | -    |

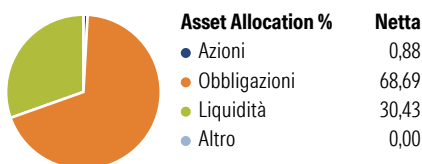
**Rend. Cumulati %**

| Periodo        | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi         | 1,90  |
| 6-Mesi         | 3,36  |
| 1-Anno         | 4,06  |
| 3-Anni Ann.ti  | 4,53  |
| 5-Anni Ann.ti  | 1,85  |
| 10-Anni Ann.ti | -     |

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

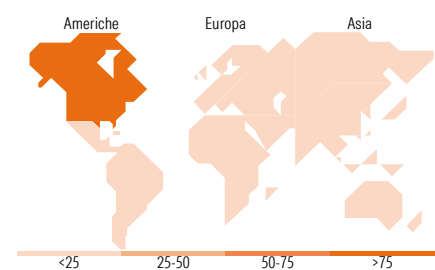
**Rendimenti**

| Periodo              | Q1   | Q2    | Q3    | Q4    |
|----------------------|------|-------|-------|-------|
| <b>Trimestrali %</b> |      |       |       |       |
| 2026                 | 0,96 | -     | -     | -     |
| 2025                 | 1,24 | -2,19 | -0,54 | 1,71  |
| 2024                 | 1,53 | 1,75  | 5,19  | -0,69 |
| 2023                 | 3,11 | 1,18  | -0,96 | 3,62  |
| 2022                 | -    | -     | -     | -     |

**Portafoglio 31/03/2026**

**Fixed Income Style**
**Box™**

| Qualità Credito |       | Sensibilità ai Tassi |      |
|-----------------|-------|----------------------|------|
| Alto            | Basso | Bassa                | Alta |
|                 |       |                      |      |
|                 |       |                      |      |
|                 |       |                      |      |
|                 |       |                      |      |

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


**Titoli principali**

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| 2 Year Treasury Note Future...              | -       | 32,63 |
| Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcvt...             | -       | 16,56 |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 3,04  |
| Goldman Sachs Plc Usd Treasu...             | -       | 2,48  |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 2,14  |
| Federal Farm Credit Banks...                | -       | 1,79  |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 1,53  |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 1,45  |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 1,45  |
| Federal Home Loan Banks 0%                  | -       | 1,39  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 64,46 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 33    |

**Fixed Income Sector Weightings %**

| Settore                  | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 69,30 |
| Societario               | 0,00  |
| Cartolarizzazioni        | 0,00  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 30,70 |
| Derivati                 | 0,00  |

| Coupon Range %    | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 95,49 |
| Da 0 a 4 cedole   | 4,51  |
| 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 %**

| Regione                       | Fondo        |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>99,45</b> |
| Stati Uniti                   | 99,45        |
| Canada                        | 0,00         |
| America Latina e Centrale     | 0,00         |
| <b>Europa</b>                 | <b>0,44</b>  |
| Regno Unito                   | 0,03         |
| Europa Occidentale - Euro     | 0,13         |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,28         |
| Europa dell'Est               | 0,00         |
| Africa                        | 0,00         |
| Medio Oriente                 | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   | <b>0,11</b>  |
| Giappone                      | 0,00         |
| Australasia                   | 0,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 0,00         |
| Asia - Emergente              | 0,11         |

**Anagrafica**

|                        |                                     |                         |              |                              |           |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione    | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 5,48 GBP     | Investimento Min. Ingresso   | 5.000 GBP |
| Telefono               | +31-703781781                       | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -         |
| Web                    | https://am.gs.com/                  | Valuta del Fondo        | GBP          | T.E.R.                       | 0,40%     |
| Data di Partenza       | 29/03/2021                          | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,39%     |
| Nome del Gestore       | Oliver Bunn                         | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | 0,00%     |
| Data Inizio Gestione   | 03/07/2022                          | ISIN                    | LU2296489854 |                              |           |
| NAV (26/06/2026)       | GBP 111,74                          |                         |              |                              |           |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.061,20 USD                        |                         |              |                              |           |

(31/03/2026)

[See disclosures for more details](#)

© 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 prodotte; (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.