## **GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc**

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

#### **Benchmark Morningstar**

Not Categorized

#### **Benchmark Dichiarato**

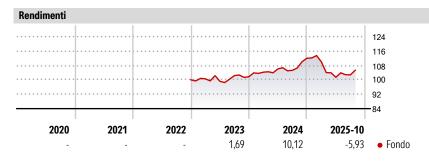
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

## 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	-0,46
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,92
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,98	Trimestrali %				
6-Mesi	2,06	2025	-1,81	-7,76	1,32	-
1-Anno	-1,01	2024	2,51	1,74	-0,75	6,38
3-Anni Ann.ti	-0,63	2023	0,56	-1,37	3,17	-0,62
5-Anni Ann.ti	-	2022	=	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	=	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 03/11/2025						

## Portafoglio 30/09/2025





Fixed Income Sector Weightings %

	FUIIU
Duration Effettiva	
Maturity effettiva	
Qualità Credito Media	

Fondo

92,71 USD

USD Si Acc LU2296489268

LUSSEMBURGO



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	_	13,64
Federal Home Loan Banks 0%	_	6,99
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	6,14
Federal Home Loan Banks 0%	_	3,79
Federal Farm Credit Banks	-	3,44
Federal Home Loan Banks 0%	_	3,28
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,78
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,43
Federal Home Loan Banks 0%	_	2,32
Federal Home Loan Banks 0%	=	2,31
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		47,12
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	(
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	34

ਜੋ Governativo	35,72
O Societario	0,00
<b>←</b> Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	64,28
🖺 Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
O coupon	74,43
O coupon Da O a 4 cedole	74,43 0,00
'	, -
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole	0,00 25,57
Da O a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole	0,00 25,57 0,00
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole Da 8 a 10 cedole	0,00 25,57 0,00 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	-

Anagratica		
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset	Patrimonio Classe (MIn)
	Management B.V.	(03/11/2025)
Telefono	+31-703781781	Domicilio
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN
NAV (03/11/2025)	USD 110,14	

Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,39%
Spese correnti	0,40%
Commissione di incentivo	0,00%

# **GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc**

Patrimonio Netto (MIn)

501,53 USD

(30/09/2025)

