

# GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares EUR Hedged 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

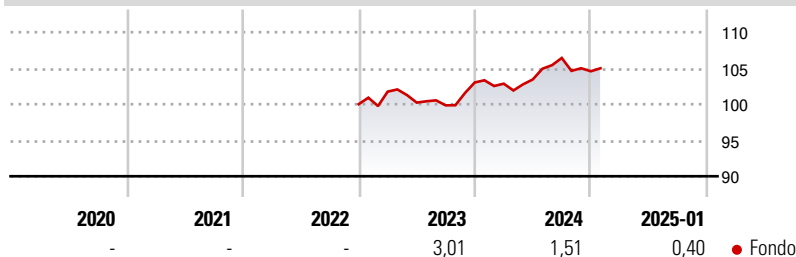
### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	-0,81
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,59
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

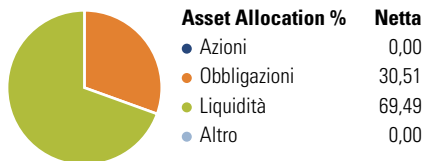
Periodo	Fondo
3-Mesi	0,35
6-Mesi	-0,88
1-Anno	1,98
3-Anni Ann.ti	-0,39
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Rendimenti

Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-0,16	0,57	2,89	-1,74
2023	1,75	-1,50	-0,38	3,18
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

### Portafoglio 31/12/2024



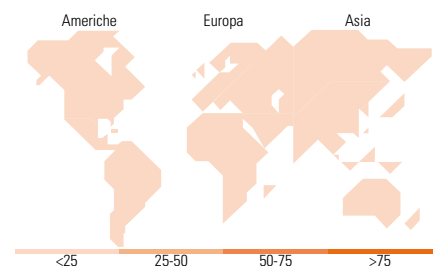
### Fixed Income

#### Style Box™

			Alto
			Med
			Basso
Bassa	Med	Alta	

Sensibilità ai Tassi

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



### Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	6,12
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,05
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	3,42
Federal Home Loan Banks 0%	-	3,24
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,55
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,52
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,29
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,03
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,03
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,02
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,26
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		69

### Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	30,51
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	69,49
Derivati	0,00

### Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	52,36
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	47,64
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>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 Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	8,61 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,37%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	-	ISIN	LU2296488377		
NAV (04/02/2025)	EUR 91,33				

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

Patrimonio Netto (Mln) 477,67 USD

(31/12/2024)