GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP Hedged Inc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark DichiaratoBloomberg 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	0,15
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,05
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	1,01	Trimestrali %				
6-Mesi	0,60	2025	1,24	-2,19	-0,55	-
1-Anno	0,28	2024	1,54	1,74	5,19	-0,68
3-Anni Ann.ti	4,46	2023	3,11	1,19	-0,97	3,63
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 03/11/2025						

Portafoglio 30/09/2025

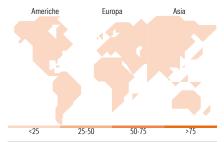




Fixed Income Sector Weightings %

Duration Effettiva	
Maturity effettiva	
Qualità Credito Media	

Fondo



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 Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazio	onari	34

ថា Governativo	35,72
O Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	64,28
🗈 Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
) acusas	74.43
O coupon	14,43
Da 0 a 4 cedole	0,00
'	, -
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole	0,00 25,57
Da 0 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	-

Anagrafica		
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset	-
	Management B.V.	(
Telefono	+31-703781781	
Web	https://am.gs.com/	١
Data di Partenza	29/03/2021	Į
Nome del Gestore	Oliver Bunn	
Data Inizio Gestione	03/07/2022	
NAV (03/11/2025)	GBP 100,29	

Patrimonio Classe (Mln)	50,96 GBP
Domicilio Valuta del Fondo	LUSSEMBURGO GBP
UCITS Inc/Acc	Si Inc
ISIN	LU2296488021

Investimento Min. Ingresso	5.000 GBP
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	0,39%
Spese correnti	0,39%
Commissione di incentivo	0,00%

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP Hedged Inc

Patrimonio Netto (MIn)

501,53 USD

(30/09/2025)

