

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares AUD Hedged Inc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

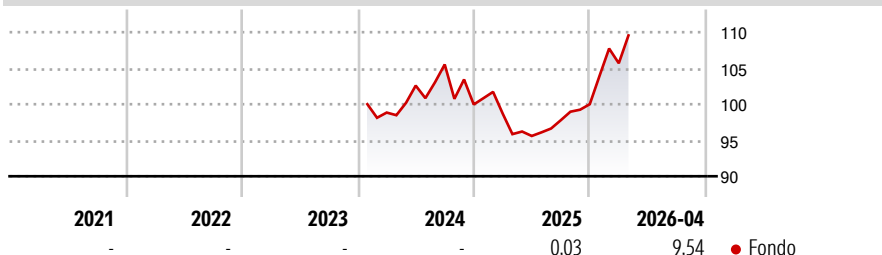
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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.

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

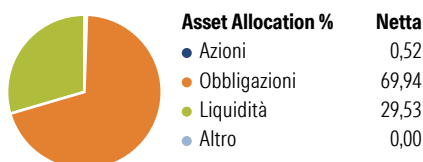
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	3,49
6-Mesi	11,69
1-Anno	13,78
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

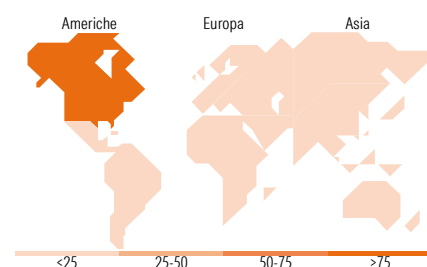
Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	5,68	-	-	-
2025	-1,28	-3,14	2,28	2,28
2024	-	3,79	2,85	-5,26
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 28/02/2026

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media

Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	-	28,74
Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcbr...	-	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 %

Settore	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 %

Regione	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.	Patrimonio Classe (Mln)	0,14 AUD	Investimento Min. Ingresso	50.000 AUD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	AUD	T.E.R.	0,58%
Data di Partenza	09/01/2024	UCITS	Si	Spese correnti	0,58%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2635649440		
NAV (12/05/2026)	AUD 102,63				
Patrimonio Netto (Mln)	1.058,38 USD				

(28/02/2026)