GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class I Shares AUD Hedged Acc

Categoria Morningstar™

Benchmark Morningstar Alt - Volatilità

Not Categorized Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

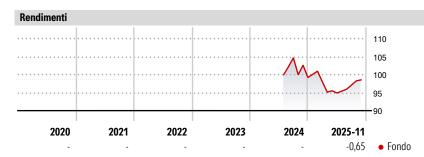
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
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	1,20	Trimestrali %				
6-Mesi	3,75	2025	-1,24	-3,12	2,28	-
1-Anno	-2,61	2024	-	-	-	-5,23
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 12/12/2025						

Portafoglio 30/09/2025





Governativo

Fixed Income Sector Weightings %

	I Ullu
Duration Effettiva	
Maturity effettiva	
Qualità Credito Media	

Fondo

35,72



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
NumeroComplessivodiTitoliObbligaz	ionari	34

Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	64,28
■ Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	74,43
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	25,57
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 %	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	-

Α	na	aı	aı	IC:	а

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	26/07/2024
Nome del Gestore	Oliver Bunn
Data Inizio Gestione	03/07/2022
NAV (12/12/2025)	AUD 105,66

Patrimonio Classe (MIn)	3,90 AUD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	AUD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2850687380

Investimento Min. Ingresso	1.000.000 AUD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,52%
Spese correnti	0,52%
Commissione di incentivo	0,00%

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class I Shares AUD Hedged Acc

Patrimonio Netto (MIn)

501,53 USD

(30/09/2025)

