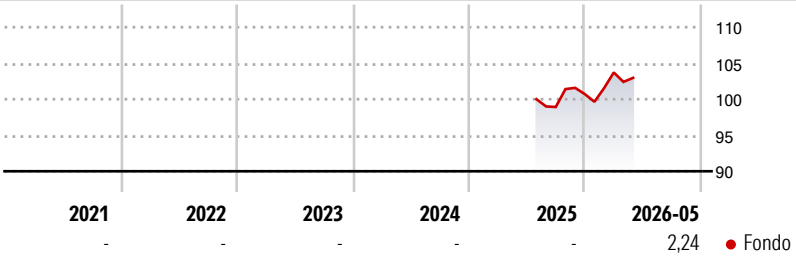
GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc (NRS)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Volatilità	Not Categorized Usato nel Report	Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD	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 %	Fondo
3-Mesi	3,04
6-Mesi	5,74
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

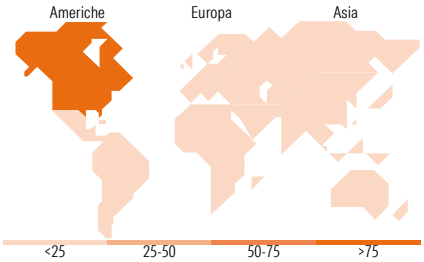
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	2,98	-	-	-
2025	-	-	-	1,81
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/03/2026

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,88
Obbligazioni	68,69
Liquidità	30,43
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	—	32,63
Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcbt...	—	16,56
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,04
Goldman Sachs Plc Usd Treasu...	—	2,48
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,14
Federal Farm Credit Banks...	—	1,79
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,53
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,45
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,45
Federal Home Loan Banks 0%	—	1,39
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		64,46
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		33

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	69,30
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	30,70
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	95,49
Da 0 a 4 cedole	4,51
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 %	Fondo
America	**99,45**
Stati Uniti	99,45
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	**0,44**
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,28
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,11**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,11

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	23/07/2025
Nome del Gestore	Oliver Bunn
Data Inizio Gestione	03/07/2022
NAV (26/06/2026)	USD 105,52
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	1.061,20 USD

Patrimonio Classe (Mln) (26/06/2026)	4,72 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU3091675465

Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,45%
Spese correnti	0,45%
Commissione di incentivo	-

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.