

Goldman Sachs Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares (AUD-Hedged)

Categoria Morningstar™
AUD

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report

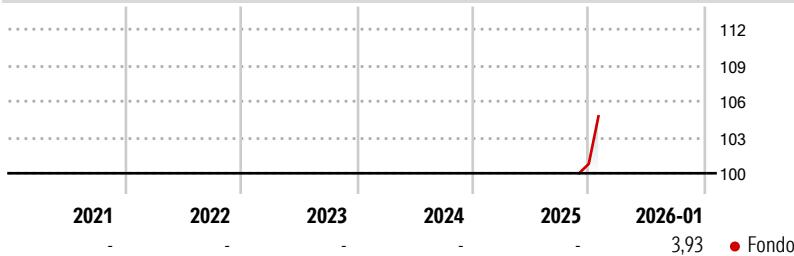
Benchmark Dichiarato
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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...

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	Rendimenti Trimestrali %
3-Mesi	8,18
6-Mesi	-
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %

• Azioni	0,00
• Obbligazioni	21,72
• Liquidità	78,28
• Altro	0,00

Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
Altro	Maturity effettiva	-
Medio	Qualità Credito Media	-
Basso	Sensibilità ai Tassi	-
Bassa		
Med		
Alta		

Rendimenti

Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-
2025	-	-	-
2024	-	-	-
2023	-	-	-
2022	-	-	-

Rendimenti Trimestrali %

Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-
2025	-	-	-
2024	-	-	-
2023	-	-	-
2022	-	-	-

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	13,39
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	12,22
Federal Farm Credit Banks...	-	3,34
Federal Home Loan Banks 0%	-	3,22
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,73
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,65
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,45
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,28
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,27
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,26
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		46,83
Numero Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	28	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	Governativo
	21,72
	Societario
	Cartolarizzazioni
	Enti Locali
	Liquidità ed equivalenti
	Derivati

Ripartizione Geografica %

Fondo	0,00
America	
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergenti	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,01 AUD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	06/11/2025	Valuta del Fondo	AUD	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/07/2022	Inc/Acc	Inc		
NAV (11/02/2026)	AUD 101,30	ISIN	LU3189663621		

Goldman Sachs Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares (AUD-Hedged)

Patrimonio Netto (Mln)
AUD 1

512,68 USD