

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

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. 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	-0,11
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,25
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti

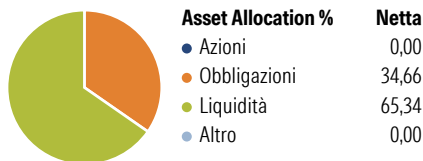
Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	0,39
6-Mesi	2,61
1-Anno	3,73
3-Anni Ann.ti	2,85
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

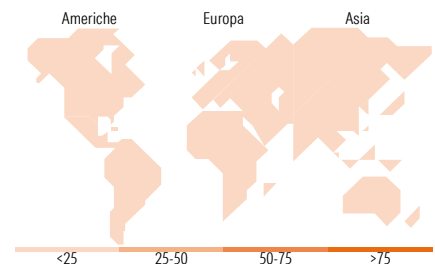
Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
2025	-0,41	1,39	0,15	1,02
2024	-5,15	0,92	4,46	-2,17
2023	0,78	-0,35	-0,23	6,78
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/10/2025

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito
Alto Med Basso
Sensibilità ai Tassi
Bassa Med Alta

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	—	13,51
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	11,97
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,75
Federal Farm Credit Banks...	—	3,41
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,25
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,75
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,68
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,40
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,29
Federal Home Loan Banks 0%	—	2,28
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		48,30
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		30

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	34,66
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	65,34
Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	77,10
Da 0 a 4 cedole	5,40
Da 4 a 6 cedole	17,50
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	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,20 CHF	Investimento Min. Ingresso	50.000 CHF
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,57%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2296488534		
NAV (28/01/2026)	CHF 93,83				

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln)	504,23 USD
(31/10/2025)	