GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

Categoria Morningstar™

Not Categorized Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar

Usato nel Report

Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

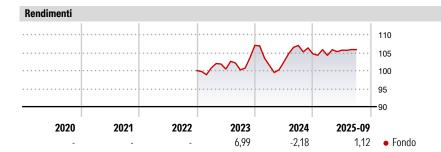
Benchmark Dichiarato

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	-0,31
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,70
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	1,40	Trimestrali %				
6-Mesi	1,55	2025	-0,41	1,39	0,15	-
1-Anno	1,87	2024	-5,15	0,92	4,46	-2,17
3-Anni Ann.ti	2,49	2023	0,78	-0,35	-0,23	6,78
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 30/10/2025						

Portafoglio 30/09/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Duration Effettiva	
Maturity effettiva	
Qualità Credito Media	

Fondo



Titoli principali Nome Set	ttore	%
Notifie Set	lore	70
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
Numero Complessivo di Titoli Obbligaziona	ari	34

₩ Governativo	35,72
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	-

Anagrafica			
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (MIn) (30/10/2025)	0,34 CHF
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	CHF
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS	Si
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Acc
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2296488534
NAV (30/10/2025)	CHF 93.71		

Investimento Min. Ingresso	50.000 CHF
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,57%
Spese correnti	0,57%
Commissione di incentivo	0,00%

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares CHF Hedged Acc

Patrimonio Netto (MIn)

501,53 USD

(30/09/2025)

