

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares EUR 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 | -0,23 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 2,68 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti



Rend. Cumulati %

| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 1,01 |
| 6-Mesi | 1,71 |
| 1-Anno | 4,27 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,46 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,46 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 15/04/2026

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | 0,59 | - | - | - |
| 2025 | 2,01 | -0,36 | 0,71 | 1,19 |
| 2024 | -0,16 | 0,57 | 2,89 | -1,75 |
| 2023 | 1,74 | -1,50 | -0,37 | 3,18 |
| 2022 | - | - | - | - |

Portafoglio 31/01/2026



Fixed Income Style

Box™

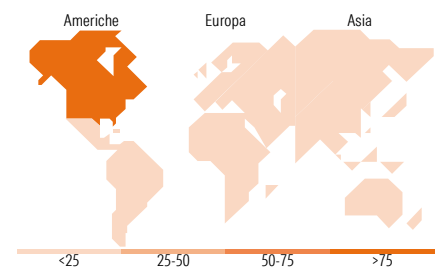
| Qualità Credito | | Sensibilità ai Tassi |
|-----------------|-----|----------------------|
| Alto | Med | |
| | | Basso |
| | | Med |
| | | Alta |

Fondo

Duration Effettiva -

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| 2 Year Treasury Note Future... | - | 31,14 |
| Us 5yr Note (Cbt) Mar26 Xcvt... | - | 18,83 |
| Federal Home Loan Banks 0.01% | - | 5,60 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 2,15 |
| Federal Farm Credit Banks... | - | 1,81 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,78 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,54 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,49 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,46 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,46 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 67,26 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 45 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 70,42 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 29,58 |
| Derivati | 0,00 |

Coupon Range %

| Range | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 94,06 |
| Da 0 a 4 cedole | 5,94 |
| 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 %

| Regione | Fondo |
|-------------------------------|--------------|
| America | 99,48 |
| Stati Uniti | 99,48 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| Europa | 0,41 |
| Regno Unito | 0,03 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,13 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,25 |
| 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. | Patrimonio Classe (Mln) | 27,48 EUR | Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 29/03/2021 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,40% |
| Nome del Gestore | Oliver Bunn | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 0,00% |
| Data Inizio Gestione | 03/07/2022 | ISIN | LU2296488294 | | |
| NAV (15/04/2026) | EUR 103,07 | | | | |

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares EUR Hedged Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.047,68 USD

(31/01/2026)