

# GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc

**Categoria Morningstar™**

Alt - Volatilità

**Benchmark Morningstar**
Not Categorized  
Usato nel Report
**Benchmark Dichiarato**

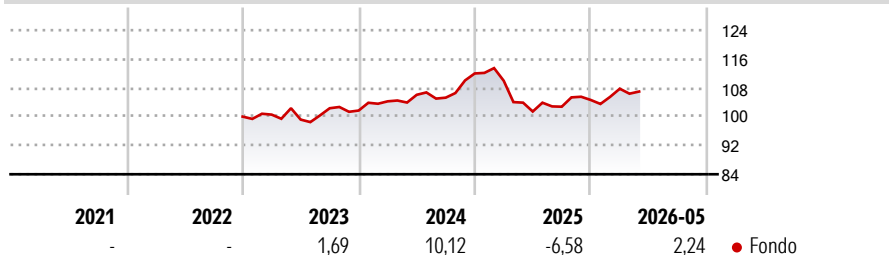
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

**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.

**Rendimenti**

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,19
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,35
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

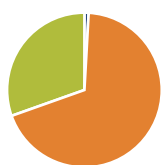
**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	3,04
6-Mesi	5,75
1-Anno	8,34
3-Anni Ann.ti	3,42
5-Anni Ann.ti	3,28
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
<b>Trimestrali %</b>				
2026	2,98	-	-	-
2025	-1,81	-7,76	1,32	1,81
2024	2,51	1,74	-0,75	6,38
2023	0,56	-1,37	3,17	-0,62
2022	-	-	-	-

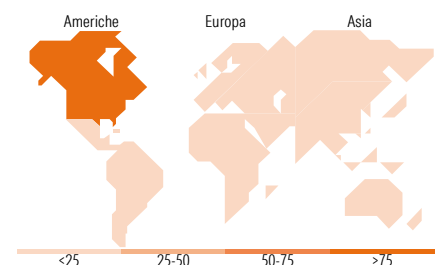
**Portafoglio 31/03/2026**

**Asset Allocation %**

● Azioni	Netta	0,88
● Obbligazioni		68,69
● Liquidità		30,43
● Altro		0,00

**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Basso	
		Bassa
		Med
		Alta

Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media

**Fondo**

**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 %**

Settore	Fondo
🏠 Governativo	69,30
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	30,70
🏠 Derivati	0,00

Periodo	Fondo
<b>Coupon Range %</b>	
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 %**

Regione	Fondo
<b>America</b>	<b>99,45</b>
Stati Uniti	99,45
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>0,44</b>
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
<b>Asia</b>	<b>0,11</b>
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)	109,55 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,40%
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	LU2296489268		
NAV (26/06/2026)	USD 113,65				
Patrimonio Netto (Mln)	1.061,20 USD				

(31/03/2026)

[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 produttrici; (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.