

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares CHF Hedged Inc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

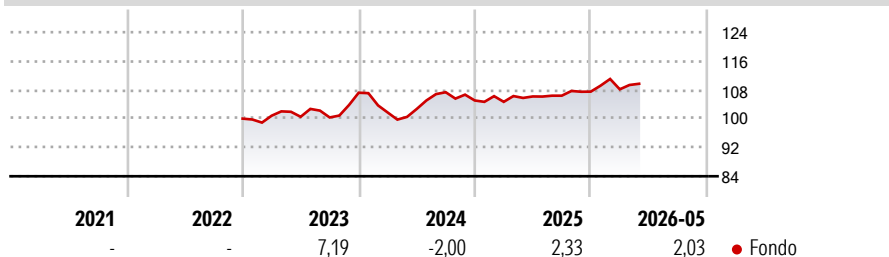
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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 | -0,05 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 5,48 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

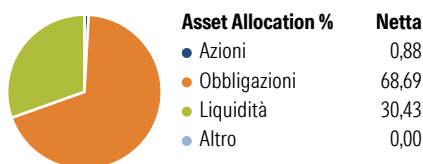
Rend. Cumulati %

| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 0,02 |
| 6-Mesi | 1,06 |
| 1-Anno | 2,65 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,51 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,19 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2026 | 0,59 | - | - | - |
| 2025 | -0,37 | 1,43 | 0,20 | 1,06 |
| 2024 | -5,12 | 0,96 | 4,53 | -2,13 |
| 2023 | 0,81 | -0,30 | -0,18 | 6,84 |
| 2022 | - | - | - | - |

Portafoglio 31/03/2026

Fixed Income Style
Box™

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

Duration Effettiva

Maturità effettiva

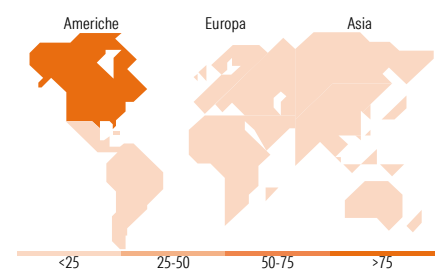
Qualità Credito Media

Fondo

-

-

-


Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| 2 Year Treasury Note Future... | - | 32,63 |
| Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcvt... | - | 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 |

Coupon Range %

| Range | Fondo |
|-------------------|-------|
| 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 |
|-------------------------------|--------------|
| America | 99,45 |
| Stati Uniti | 99,45 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| Europa | 0,44 |
| 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 |
| 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) | 1,49 CHF | Investimento Min. Ingresso | 5.000 CHF |
| Telefono | +31-703781781 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Valuta del Fondo | CHF | T.E.R. | 0,40% |
| Data di Partenza | 29/03/2021 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,39% |
| Nome del Gestore | Oliver Bunn | Inc/Acc | Inc | Commissione di incentivo | 0,00% |
| Data Inizio Gestione | 03/07/2022 | ISIN | LU2296489938 | | |
| NAV (26/06/2026) | CHF 84,89 | | | | |
| 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 prodotte; (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.