

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares EUR Hedged Inc

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

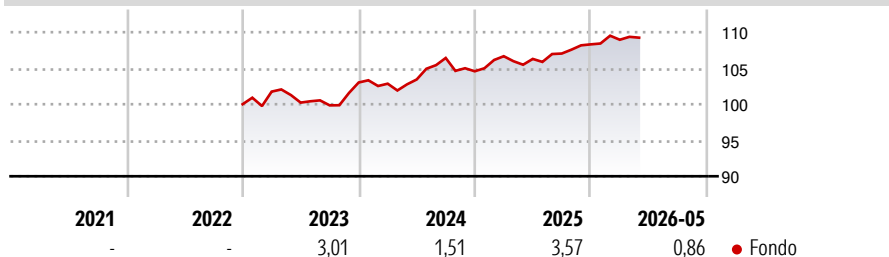
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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	-0,12
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,62
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

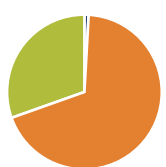
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,29
6-Mesi	1,41
1-Anno	3,21
3-Anni Ann.ti	2,91
5-Anni Ann.ti	0,39
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

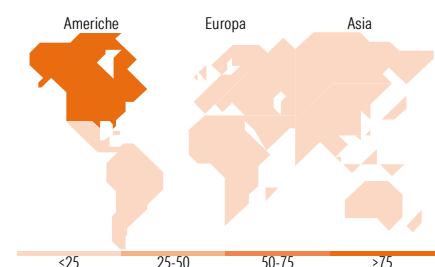
Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	0,59	-	-	-
2025	2,00	-0,36	0,70	1,19
2024	-0,16	0,57	2,89	-1,74
2023	1,75	-1,50	-0,38	3,18
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/03/2026

Asset Allocation %

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

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media

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

Coupon 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)	2,66 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.	0,39%
Data di Partenza	29/03/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,38%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2296488377		
NAV (26/06/2026)	EUR 92,22				
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.