GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP Hedged Inc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Volatilità	Not Categorized Usato nel Report	Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD	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...

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,18
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,07
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,16
6-Mesi	0,50
1-Anno	-1,15
3-Anni Ann.ti	3,57
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/12/2025

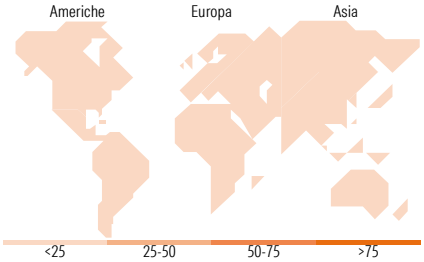
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	1,24	-2,19	-0,55	-
2024	1,54	1,74	5,19	-0,68
2023	3,11	1,19	-0,97	3,63
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	35,72
Liquidità	64,28
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
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 Obbligazionari		34

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
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.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	29/03/2021
Nome del Gestore	Oliver Bunn
Data Inizio Gestione	03/07/2022
NAV (11/12/2025)	GBP 97,55
Patrimonio Classe (MIn) (11/12/2025)	53,68 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2296488021
Investimento Min. Ingresso	5.000 GBP
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,39%
Spese correnti	0,39%
Commissione di incentivo	0,00%

© 2025 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 prodotto; (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.

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP Hedged Inc

Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	501,53 USD

© 2025 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 prodotto; (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.