

# GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares GBP 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	0,39
3Y Beta	-	3Y Std Dev	4,68
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

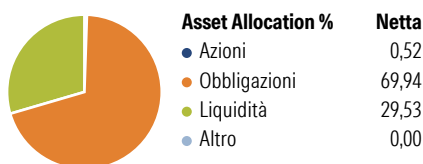
**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,11
6-Mesi	4,14
1-Anno	3,10
3-Anni Ann.ti	4,17
5-Anni Ann.ti	1,62
10-Anni Ann.ti	-

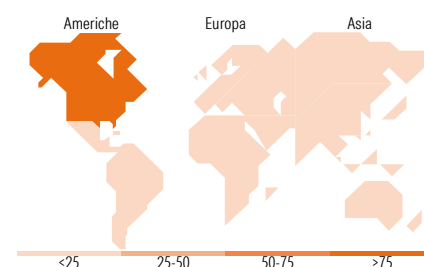
Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
<b>Trimestrali %</b>				
2026	0,97	-	-	-
2025	1,24	-2,19	-0,55	1,70
2024	1,54	1,74	5,19	-0,68
2023	3,11	1,19	-0,97	3,63
2022	-	-	-	-

**Portafoglio 28/02/2026**

**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...	-	28,74
Us 5yr Note (Cbt) Jun26 Xcvt...	-	21,27
Goldman Sachs Plc Usd Treasu...	-	2,81
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,13
Federal Farm Credit Banks...	-	1,80
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,77
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,53
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,48
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,45
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,45
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		64,43
Numero Complessivo di Titoli Azionari		2
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		43

**Fixed Income Sector Weightings %**

Settore	Fondo
Governativo	70,31
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	29,69
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	94,20
Da 0 a 4 cedole	5,80
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>99,24</b>
Stati Uniti	99,24
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>0,46</b>
Regno Unito	0,04
Europa Occidentale - Euro	0,14
Europa Occidentale - Non Euro	0,28
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>0,30</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,30

**Anagrafica**

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	60,13 GBP	Investimento Min. Ingresso	5.000 GBP
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	GBP	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	LU2296488021		
NAV (12/05/2026)	GBP 99,39				
Patrimonio Netto (Mln)	1.058,38 USD				

(28/02/2026)