

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares AUD 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. 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...

Misure di Rischio

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

Rendimenti

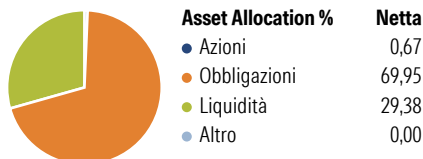
Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	6,49
6-Mesi	10,88
1-Anno	14,52
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

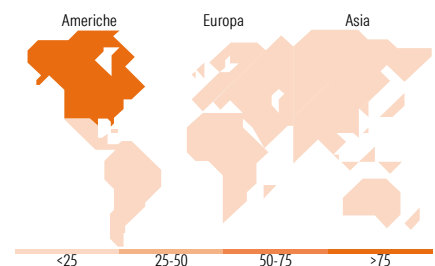
Rendimenti aggiornati al 15/04/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	5,68	-	-	-
2025	-1,28	-3,14	2,28	2,28
2024	-	3,79	2,85	-5,26
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/01/2026

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Med	
		Basso
		Med
		Alta

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media

Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	-	31,14
Us 5yr Note (Cbt) Mar26 Xcvt...	-	18,83
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	5,60
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,15
Federal Farm Credit Banks...	-	1,81
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,78
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,54
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,49
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,46
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,46
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		67,26
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		45

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	70,42
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	29,58
📄 Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	94,06
Da 0 a 4 cedole	5,94
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 %

	Fondo
America	99,48
Stati Uniti	99,48
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
Europa	0,41
Regno Unito	0,03
Europa Occidentale - Euro	0,13
Europa Occidentale - Non Euro	0,25
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)	0,14 AUD	Investimento Min. Ingresso	50.000 AUD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	AUD	T.E.R.	-
Data di Partenza	09/01/2024	UCITS	Si	Spese correnti	0,58%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU2635649440		
NAV (15/04/2026)	AUD 102,58				

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares AUD Hedged Inc

Patrimonio Netto (Mln) 1.047,68 USD

(31/01/2026)