# **GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares AUD Hedged Inc**

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

## Benchmark Morningstar

Not Categorized Usato nel Report

#### **Benchmark Dichiarato**

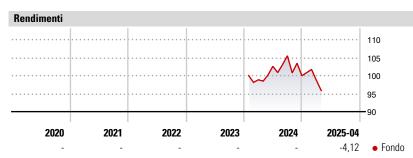
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

#### 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	

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	-6,14
6-Mesi	-7,19
1-Anno	-3,43
3-Anni Ann.ti	
5-Anni Ann.ti	
10-Anni Ann.ti	
Rendimenti aggiornati al 23/05/2025	

Rendimenti	<b>Q1</b>	02	03	<b>Q</b> 4
Trimestrali %				
2025	-1,28	-	-	-
2024	-	3,79	2,85	-5,26
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

### **Portafoglio** 30/04/2025





Governativo

-
-

Fondo

62,95



Titoli principali		
Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future	-	31,73
Us 5yr Note (Cbt) Jun25 Xcbt	_	19,30
Goldman Sachs Plc Us Treasu	_	7,78
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	4,60
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	2,73
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,41
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	2,35
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	2,24
Federal Home Loan Banks 0.01%	_	1,81
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	1,72
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		76,68
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	0
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	73

Societario	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	37,05
Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	92,56
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	7,44
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

Fixed Income Sector Weightings %

\25	20-30	30-73	//3
Ripartizione Geografica %			Fondo
America			99,50
Stati Uniti			99,50
Canada			0,00
America Lati	na e Centrale		0,00
Europa			0,46
Regno Unito			0,03
Europa Occid	lentale - Euro		0,14
Europa Occid	lentale - Non Eu	ro	0,28
Europa dell'E	st		0,00
Africa			0,00
Medio Orien	te		0,00
Asia			0,04
Giappone			0,00
Australasia			0,00
Asia - Paesi	Sviluppati		0,04
Asia - Emerg	ente		0,00

ırafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset
	Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	09/01/2024
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	03/07/2022
NAV (23/05/2025)	AUD 100,23

Patrimonio Classe (Mln) (23/05/2025)	0,14 AUD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	AUD
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU2635649440

Investimento Min. Ingresso	50.000 AUD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,58%
Spese correnti	0,58%
Commissione di incentivo	-

# **GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class P Shares AUD Hedged Inc**

Patrimonio Netto (MIn)

1.033,63 USD

(30/04/2025)