

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc (NRS)

Categoria Morningstar™

Alt - Volatilità

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

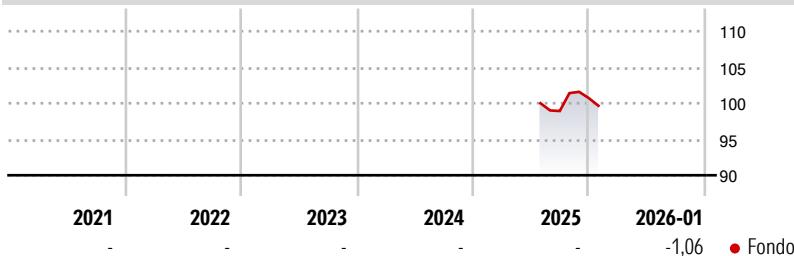
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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...

Rendimenti

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	-0,69
6-Mesi	1,10
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	1,81
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

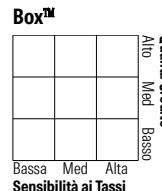
Portafoglio 30/11/2025

Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

Netta

0,00
21,72
78,28
0,00

Fixed Income Style

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	13,39
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	12,22
Federal Farm Credit Banks...	-	3,34
Federal Home Loan Banks 0%	-	3,22
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,73
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,65
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,45
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,28
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,27
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,26
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		46,83
Numero Complessivo di Titoli Azionari	0	
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	28	

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	21,72
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	78,28
Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	63,19
Da 0 a 4 cedole	8,54
Da 4 a 6 cedole	28,27
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 - Emergenti	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln) (11/02/2026)	4,65 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,45%
Data di Partenza	23/07/2025	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	Oliver Bunn	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	03/07/2022	ISIN	LU3091675465		
NAV (11/02/2026)	USD 103,99				

GS Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares USD Acc (NRS)

Patrimonio Netto (Mln)

512,68 USD

(30/11/2025)