

Goldman Sachs Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares (AUD-Hedged)

Categoria Morningstar™
AUD

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report

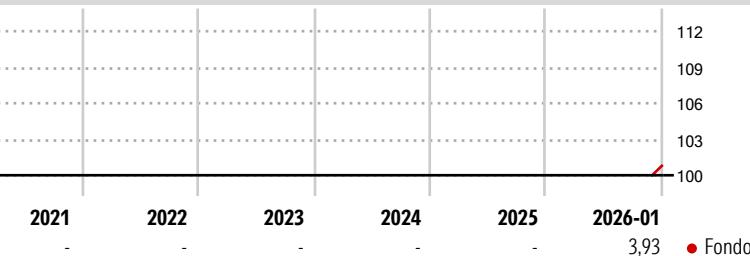
Benchmark Dichiarato
Bloomberg US Treasury 1-5Y TR USD

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	Rendimenti Trimestrali %
3-Mesi	-
6-Mesi	-
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-
2022	-

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %

• Azioni	0,00
• Obbligazioni	21,72
• Liquidità	78,28
• Altro	0,00

Netta

Fixed Income Style

Fondo	Box™	Duration Effettiva
-	Alt	-
-	Med	-
-	Basso	-
-	Bassa	Maturity effettiva
-	Med	Qualità Credito Media
-	Alta	Qualità Credito Alta

Americhe



Europa



Asia



<25

25-50

50-75

>75

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
	Cartolarizzazioni
	Enti Locali
	Liquidità ed equivalenti
	Derivati

Coupon Range %

Fondo	0 coupon
	63,19
	Da 0 a 4 cedole
	Da 4 a 6 cedole
	Da 6 a 8 cedole
	Da 8 a 10 cedole
	Da 10 a 12 cedole
	Oltre 12 cedole

Ripartizione Geografica %

America

Stati Uniti

Canada

America Latina e Centrale

Europa

Regno Unito

Europa Occidentale - Euro

Europa Occidentale - Non Euro

Europa dell'Est

Africa

Medio Oriente

Asia

Giappone

Australasia

Asia - Paesi Sviluppati

Asia - Emergenti

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,01 AUD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+31-703781781	(02/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	06/11/2025	Valuta del Fondo	AUD	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	Oliver Bunn	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/07/2022	Inc/Acc	Inc		
NAV (02/02/2026)	AUD 100,78	ISIN	LU3189663621		

Goldman Sachs Strategic Volatility Premium Portfolio Class R Shares (AUD-Hedged)

Patrimonio Netto (Mln)
AUD 1

512,68 USD