Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio

Categoria Morningstar™
Finanziamento Misto

P USD Acc

Benchmark Morningstar
Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD
Usato nel Report

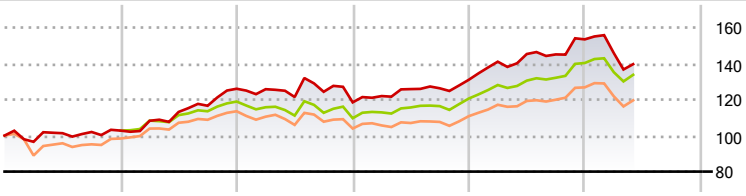
Benchmark Dichiarato
50% S&P 500 NR Hdg EUR, 50% Bloomberg US Agg Bond TR USD

Morningstar Rating™
★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing in a range of strategic factors offering exposure to various asset classes and instruments either indirectly through financial derivative instruments or directly. The Portfolio will, under normal circumstances, invest primarily in the underlying assets comprised in certain strategic factors through the implementation of the Strategic Factor Allocation process ("Strategic Allocation", as further described below). The Portfolio may have exposure to a diversified range of asset classes including, but not limited to, equity, fixed income, currency and such exposures may be achieved directly through Transferable Securities or Permitted Funds or...

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-05	
2,76	22,62	-6,00	10,57	17,13	-8,97	Fondo
-	15,70	-7,78	9,96	16,37	-4,68	Benchmark e Indici
-1,38	15,46	-8,53	6,60	14,65	-5,64	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,57	3Y Sharpe Ratio	0,15
3Y Beta	1,03	3Y Std Dev	10,95
3Y R-Squared	91,70	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,55	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,03	10Y Risk	-

Basati su Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-5,02	-3,23	-4,22
6-Mesi	-9,29	-5,77	-6,32
1-Anno	-4,73	0,89	-0,90
3-Anni Ann.ti	4,61	5,98	4,12
5-Anni Ann.ti	6,79	5,96	4,73
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2025

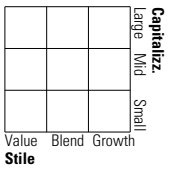
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-4,97	-	-	-
2024	7,68	3,01	-0,15	5,75
2023	2,95	3,17	0,35	3,74
2022	-0,21	-3,45	2,41	-4,73
2021	5,30	4,55	3,02	8,12

Portafoglio 31/05/2025

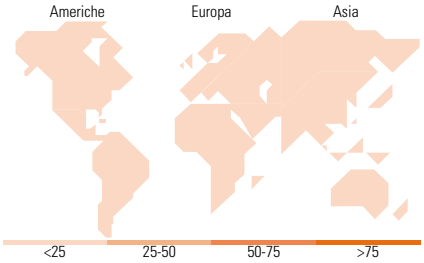
Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	30,89
Liquidità	69,11
Altro	0,00

Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	—	18,30
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	14,25
Federal Home Loan Banks 0%	—	8,43
Federal Home Loan Banks 0%	—	5,72
Federal Home Loan Banks 0%	—	5,04
Federal Home Loan Banks 0%	—	4,68
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,92
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,37
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,15
Federal Home Loan Banks 0%	—	3,09
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		69,93
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		49

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	0,00
Sensibile	0,00
Difensivo	0,00

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	30,89
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	69,11
Derivati	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 - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.
Telefono	+31-703781781
Web	https://am.gs.com/
Data di Partenza	30/09/2016
Nome del Gestore	James Park
Patrimonio Classe (Mln) (26/06/2025)	156,29 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,88%
Commissione di incentivo	-

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio

P USD Acc

Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1460672980
NAV (27/06/25)	USD 174,70		
Patrimonio Netto (Mln) (31/05/2025)	882,14 USD		

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.