

# Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio P EUR

Categoria Morningstar™  
**Hedged Acc**

Benchmark Morningstar  
Morningstar Euro Moderate Global Target  
Allocation NR EUR  
Usato nel Report

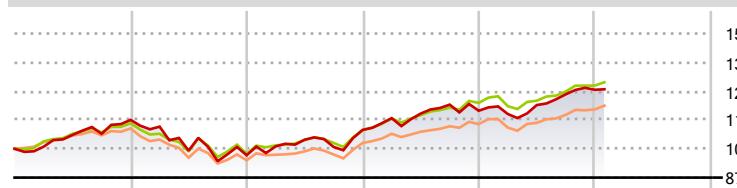
Benchmark Dichiarato  
50% S&P 500 NR Hdg EUR, 50% Bloomberg  
US Agg Bond TR USD

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01
13,04	-14,13	11,80	7,97	8,07	0,19
11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	1,18
9,41	-12,94	8,34	8,53	6,16	1,46

## Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,50	3Y Sharpe Ratio	0,66
3Y Beta	1,17	3Y Std Dev	7,50
3Y R-Squared	75,05	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,19	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	3,86	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,93	2,09	2,88
6-Mesi	5,26	6,15	6,43
1-Anno	7,33	5,61	5,66
3-Anni Ann.ti	8,38	8,77	7,38
5-Anni Ann.ti	4,77	5,09	3,39
10-Anni Ann.ti	-	-	-

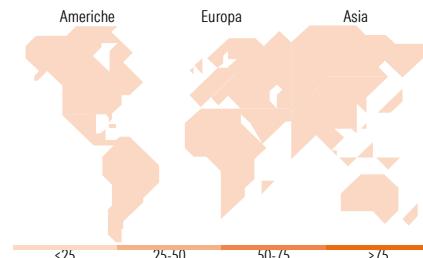
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-1,24	3,47	4,06	1,63
2024	4,88	1,83	3,48	-2,31
2023	4,14	3,00	-3,14	7,62
2022	-2,71	-9,82	-4,82	2,83

Rendimenti aggiornati al 10/02/2026

## Portafoglio 30/11/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	0,00
• Obbligazioni	9,49
• Liquidità	90,51
• Altro	0,00



## Titoli principali

Nome	Settore	%
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	29,76
Federal Farm Credit Banks...	-	3,74
Federal Farm Credit Banks...	-	1,55
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,00
Federal Home Loan Banks 0%	-	0,96
Federal Home Loan Banks 0%	-	0,52
Federal National Mortgage...	-	0,36
Federal Home Loan Mortgage...	-	0,28
Federal Home Loan Mortgage...	-	0,25
Federal Farm Credit Banks...	-	0,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		38,64
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		22

## Distribuzione Settoriale %

	Fondo
● Ciclico	0,00
▼ Sensibile	0,00
► Difensivo	0,00
<b>Fixed Income Sector Weightings %</b>	<b>Fondo</b>
■ Governativo	9,49
○ Societario	0,00
■ Cartolarizzazioni	0,00
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	90,51
□ Derivati	0,00

## Ripartizione Geografica %

Fondo	0,00
<b>America</b>	
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
<b>Europa</b>	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
<b>Asia</b>	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppati	-
Asia - Emergenti	-

## Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	149,04 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	30/09/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-

## Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio P EUR

Data Inizio Gestione  
**Hedged Acc**  
Patrimonio Netto. (Mln)  
(30/11/2025)

01/07/2022  
EUR 156,37  
943,42 USD

ISIN

LU1474200133