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

Categoria Morningstar™ HedgedaAcc

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR

Benchmark Dichiarato

US Agg Bond TR USD

50% S&P 500 NR Hdg EUR, 50% Bloomberg ★★

Morningstar Rating™ ★★★

Usato nel Report

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	anororak	710 0000111100 01 1 011	iiiittou
Misure di Rischi)		
3Y Alpha	-2,33	3Y Sharpe Ratio	0,12
3Y Beta	1,16	3Y Std Dev	10,61
3Y R-Squared	90,88	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	-0,61	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	3,46	10Y Risk	-

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

Rendimenti 130 115 100 2020 2021 2022 2023 2024 2025-05 10,20 13,04 -14,13 11,80 7,97 -1,02 Fondo Benchmark e 4,23 11,51 -12,28 10,99 11,17 0,36 Indici 2,37 9,41 -12,94 8,34 8,53 Categoria 0,10

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimen
3-Mesi	2,47	0,72	0,42	Trimestra
6-Mesi	0,94	0,17	0,03	2025
1-Anno	2,41	4,92	3,52	2024
3-Anni Ann.ti	5,88	6,86	5,32	2023
5-Anni Ann.ti	5,79	5,58	3,92	2022
10-Anni Ann.ti	=	-	-	2021
Rendimenti aggiornati al 26/06/2	2025			

Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-1,24	-	-	-
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
2021	0,93	5,27	0,48	5,87

Portafoglio 31/05/2025

applicabile)





Distribuzione Settoriale %

U Ciclico



Fondo

0,00

Americhe	Eu	ropa	Asia
<25	25-50	50-75	>/5

Dinauticiona Coognafica (/

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 Obbligaz	ionari	49

₩ 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

Fondo
0,00
-
-
-
0,00
-
-
-
-
-
-
0,00
-
-
-
-

Anagrafica					
Società di Gestione	Goldman Sachs Asset	Patrimonio Classe (MIn)	151,49 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
	Management B.V.	(26/06/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,88%
Data di Partenza	30/09/2016	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	lames Park	Inc/Acc	Acc		

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

 Data Inizio Gestione
 01/07/2022
 ISIN
 LU1474200133

 Hedged Acc
 EUR 145,89

 Patrimonio Netto (MIn)
 882,14 USD

(31/05/2025)