

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

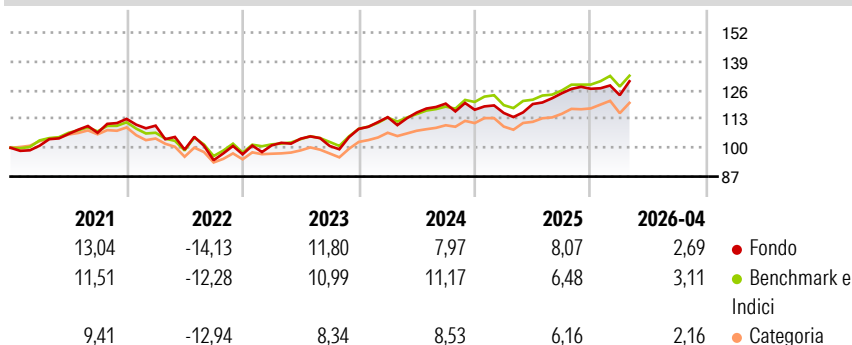
The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing in a range of strategic factors offering exposure to various asset classes and instruments either indirectly through financial derivative instruments or directly. The Portfolio will, under normal circumstances, invest primarily in the underlying assets comprised in certain strategic factors through the implementation of the Strategic Factor Allocation process. 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 indirectly, through the use of financial derivative...

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -1,40 | 3Y Sharpe Ratio | 0,69 |
| 3Y Beta | 1,12 | 3Y Std Dev | 7,90 |
| 3Y R-Squared | 81,44 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | -0,23 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 3,49 | 10Y Risk | - |

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %

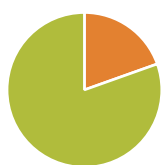
| | Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 3,36 | 1,95 | 1,62 |
| 6-Mesi | 4,23 | 4,10 | 4,27 |
| 1-Anno | 16,05 | 12,33 | 12,32 |
| 3-Anni Ann.ti | 8,99 | 9,39 | 8,34 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,99 | 5,23 | 3,43 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 11/05/2026

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | -2,28 | - | - | - |
| 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 |

Portafoglio 28/02/2026



Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

Netta

| | |
|--------------|-------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 19,56 |
| Liquidità | 80,44 |
| Altro | 0,00 |

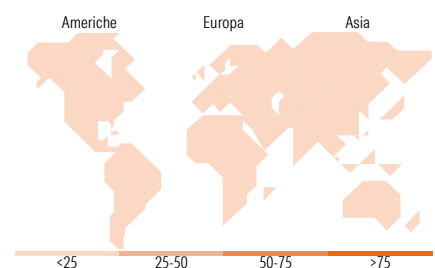
Morningstar Style Box®

Stile Azionario

| | Large | Mid | Small |
|-------------|-------|-------|--------|
| Capitalizz. | | | |
| Stile | Value | Blend | Growth |

Reddito Fisso

| | Alto | Med | Basso |
|----------------------|-------|-----|-------|
| Qualità Credito | | | |
| Sensibilità ai Tassi | Bassa | Med | Alta |



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Federal Farm Credit Banks... | - | 3,75 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 2,91 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 2,49 |
| Federal Farm Credit Banks... | - | 1,56 |
| United States Treasury Notes... | - | 1,47 |
| Federal Home Loan Banks 0% | - | 1,20 |
| United States Treasury Notes... | - | 1,12 |
| United States Treasury Bills... | - | 0,86 |
| United States Treasury Bills... | - | 0,54 |
| United States Treasury Notes... | - | 0,52 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 16,43 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 54 |

Distribuzione Settoriale %

| | Fondo |
|-----------|-------|
| Ciclico | 0,00 |
| Sensibile | 0,00 |
| Difensivo | 0,00 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 23,32 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 76,68 |
| 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. | Patrimonio Classe (Mln) | 155,55 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. | 0,88% |
| Data di Partenza | 30/09/2016 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,88% |
| Nome del Gestore | James Park | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2022 | ISIN | LU1474200133 | | |

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

NAV (11/05/2026)

Hedged Acc

EUR 161,49

950,03 USD

(28/02/2026)