

# 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

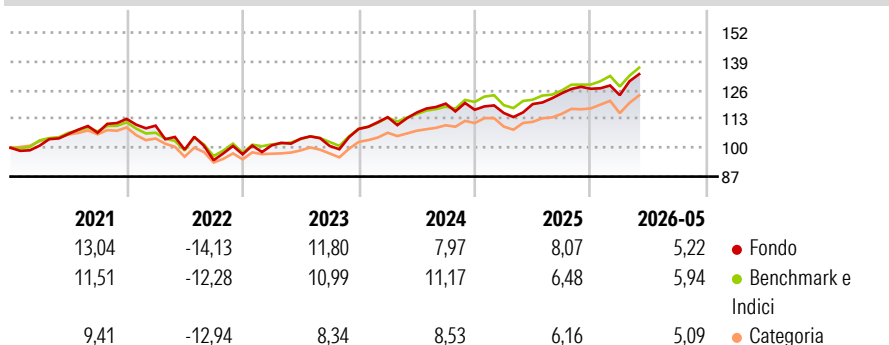
The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing in a range of strategic factors offering exposure to various asset classes and instruments either indirectly through financial derivative instruments or directly. The Portfolio will, under normal circumstances, 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	-1,22	3Y Sharpe Ratio	0,81
3Y Beta	1,11	3Y Std Dev	7,94
3Y R-Squared	81,87	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,17	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	3,46	10Y Risk	-

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

## Rendimenti



## Rend. Cumulati %

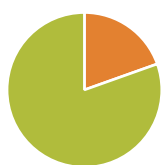
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,84	6,83	6,93
6-Mesi	3,57	6,54	5,82
1-Anno	11,22	13,18	12,03
3-Anni Ann.ti	8,44	9,98	8,66
5-Anni Ann.ti	4,51	5,16	3,42
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

## 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	0,00
● Obbligazioni	19,56
● Liquidità	80,44
● Altro	0,00

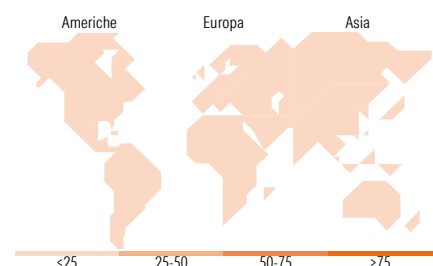
### Morningstar Style Box®

#### Stile Azionario

Stile	Capitalizz.		
	Large	Mid	Small
Value			
Blend			
Growth			

#### Reddito Fisso

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

## Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	155,78 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		

See disclosures for more details

© 2026 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 prodotte; (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.

MORNINGSTAR

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

NAV (25/06/2026)

**Hedged Acc**

EUR 161,42

950,03 USD

(28/02/2026)

[See disclosures for more details](#)

© 2026 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 prodotte; (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.

