

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

Categoria Morningstar™  
**P USD Inc**  
 Morningstar Mod Target USD

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

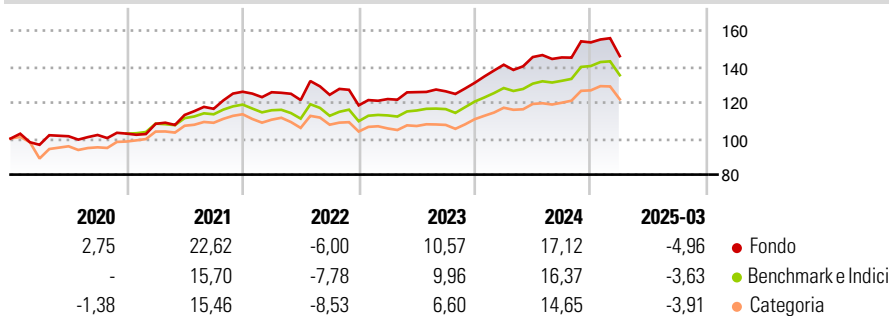
The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing in a range of strategic factors offering exposure to various asset classes and instruments either indirectly through financial derivative instruments or directly. The Portfolio will, under normal circumstances, 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...

## Misure di Rischio

3Y Alpha	-0,18	3Y Sharpe Ratio	0,29
3Y Beta	1,04	3Y Std Dev	10,21
3Y R-Squared	93,85	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,10	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,74	10Y Risk	-

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

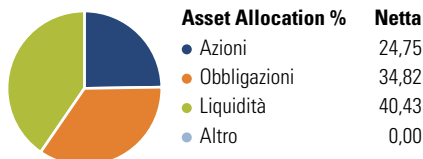
## Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bnk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-15,16	-	-	2025	-4,96	-	-	-
6-Mesi	-10,97	-	-	2024	7,68	3,01	-0,15	5,75
1-Anno	-4,85	-	-	2023	2,95	3,17	0,35	3,74
3-Anni Ann.ti	1,55	-	-	2022	-0,21	-3,44	2,40	-4,73
5-Anni Ann.ti	5,29	-	-	2021	5,30	4,55	3,02	8,12
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

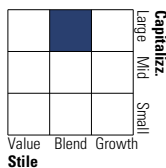
Rendimenti aggiornati al 17/04/2025

## Portafoglio 28/02/2025

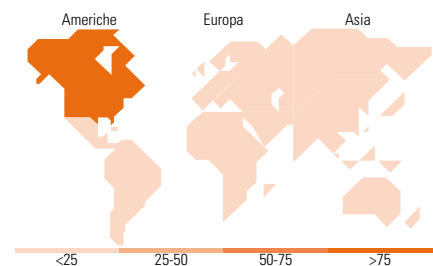


## Morningstar Style Box®

### Stile Azionario



### Reddito Fisso



## Titoli principali

Nome	Settore	%
10 Year Treasury Note Future...	-	27,33
Future on E-mini S&P 500...	-	24,77
Goldman Sachs Plc Us Treasu...	-	5,08
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	3,37
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	2,37
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,18
Federal Home Loan Banks 0%	-	1,65
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	1,46
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	1,13
Federal Home Loan Banks 0.01%	-	0,99
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		70,33
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		111

## Distribuzione Settoriale %

	Fondo
Ciclico	28,67
Sensibile	52,11
Difensivo	19,22

## Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	45,99
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	54,01
Derivati	0,00

## Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>99,42</b>
Stati Uniti	99,42
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,00
<b>Europa</b>	<b>0,54</b>
Regno Unito	0,10
Europa Occidentale - Euro	0,16
Europa Occidentale - Non Euro	0,28
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>0,04</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,04
Asia - Emergente	0,00

## Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	56,16 USD	Investimento Min. Ingresso	50.000 USD
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,88%
Data di Partenza	30/09/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-

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

Data Inizio Gestione	01/07/2022	ISIN	LU1460672808
AVG (2022)	USD 148,81		
Patrimonio Netto (Mln)	1.815,02 USD		

(28/02/2025)