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

# Categoria Morningstar™ Hedgedalne

#### **Benchmark Morningstar**

Usato nel Report

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR

#### **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...

naimenti						
						145
						130
		<b>3</b> 000000000000000000000000000000000000		······		115
						100
						85
						<b>-</b> 70
2020	2021	2022	2023	2024	2025-10	
10,22	13,05	-14,11	11,84	7,99	8,04	<ul><li>Fondo</li></ul>
4,23	11,51	-12,28	10,99	11,17	6,45	<ul> <li>Benchmark e</li> </ul>
						Indici
2,37	9,41	-12,94	8,34	8,53	5,97	<ul> <li>Categoria</li> </ul>

Misure di Rischio						
3Y Alpha	-0,72	3Y Sharpe Ratio	0,74			
3Y Beta	1,13	3Y Std Dev	8,28			
3Y R-Squared	80,28	3Y Risk	Alto			
3Y Info Ratio	-0,01	5Y Risk	Alto			
3Y Tracking Error	3,78	10Y Risk	-			
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)						

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3
3-Mesi	4,10	4,04	4,55	Trimestrali %			
6-Mesi	10,36	7,88	8,60	2025	-1,24	3,48	4,07
1-Anno	8,12	8,84	7,68	2024	4,89	1,83	3,49
3-Anni Ann.ti	9,52	9,24	7,98	2023	4,15	3,00	-3,14
5-Anni Ann.ti	5,62	5,99	4,49	2022	-2,70	-9,82	-4,81
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	0,93	5,28	0,49
Rendimenti aggiornati al 04/11/3	2025						

**Fondo** 

0,00

0,00







Distribuzione Settoriale %

Ciclico

w Sensibile



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

Q4

-2,30 7.64 2,83 5,87

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Federal Home Loan Banks 0%	-	14,37
Federal Home Loan Banks 0%	_	14,16
Federal Home Loan Banks 0%	_	9,60
Federal Home Loan Banks 0%	_	9,25
GS USD Treasury Liq Res X Inc	_	6,75
Federal Home Loan Banks 0%	_	4,61
Federal Home Loan Banks 0%	_	3,86
Federal Farm Credit Banks	_	3,77
Federal Home Loan Banks 0%	_	3,56
Federal Home Loan Banks 0%	-	3,46
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		73,39
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	0
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	36

→ Difensivo	0,00	
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	
<b>₩</b> Governativo	36,63	
Societario	0,00	
★ Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
🚅 Liquidità ed equivalenti	63,37	
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	Patrimonio Classe (MIn)	0,02 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
	Management B.V.	(04/11/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,85%
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,85%
Data di Partenza	30/09/2016	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	lames Park	Inc/Acc	Inc		

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

 Data Inizio Gestione
 01/07/2022
 ISIN
 LU1474200059

 Hedged Inc
 EUR 142,79
 EUR 142,79

 Patrimonio Netto (MIn)
 922,23 USD
 922,23 USD

(31/08/2025)