

Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio

Categoria Morningstar™
P CHF Hedged Acc

Benchmark Morningstar
 Cat 50% Citi Swiss GBI & 50% MSCI Wld
 Free NR
 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

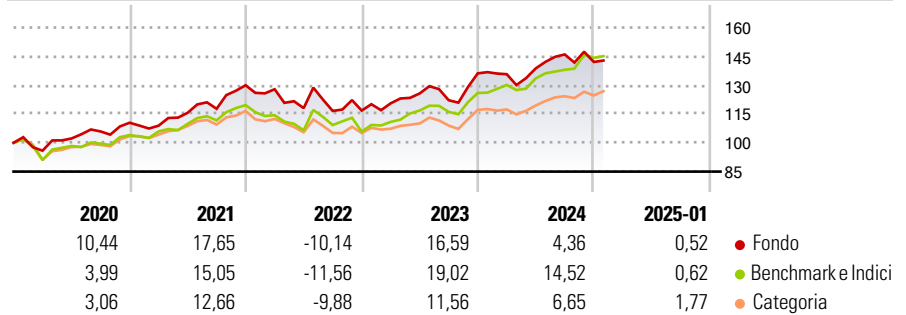
The Portfolio seeks total returns consisting of income and capital appreciation by investing in a range of strategic factors offering exposure to various asset classes and instruments either indirectly through financial derivative instruments or directly. The Portfolio will, under normal circumstances, 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	-3,00	3Y Sharpe Ratio	0,21
3Y Beta	0,94	3Y Std Dev	12,15
3Y R-Squared	73,57	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	-0,61	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,59	10Y Risk	-

Basati su Cat 50% Citi Swiss GBI & 50% MSCI Wld Free NR (dove applicabile)

Rendimenti

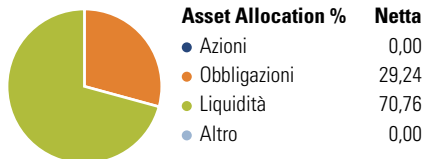


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,16	5,01	1,87
6-Mesi	-0,01	8,09	2,85
1-Anno	4,05	14,55	5,42
3-Anni Ann.ti	5,10	8,56	4,31
5-Anni Ann.ti	6,67	7,35	4,46
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

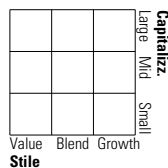
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-0,32	2,24	5,22	-2,68
2023	3,25	4,26	-2,83	11,46
2022	-1,57	-7,71	-1,24	0,16
2021	-1,40	6,16	1,81	10,41

Portafoglio 31/12/2024

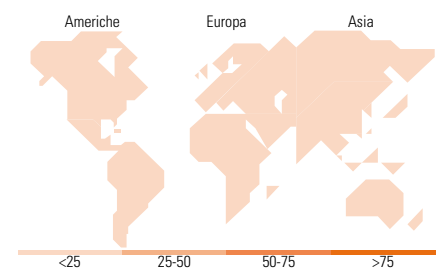


Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



Titoli principali

Nome	Settore	%
GS USD Treasury Liq Res X Inc	-	22,48
Federal Home Loan Banks 0%	-	12,00
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,55
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,20
Federal Home Loan Banks 0%	-	5,14
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,62
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,60
Federal Home Loan Banks 0%	-	4,01
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,60
Federal Home Loan Banks 0%	-	2,55
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		68,74
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		69

Distribuzione Settoriale %

	Fondo
Ciclico	0,00
Sensibile	0,00
Difensivo	0,00

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	29,24
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	70,76
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)	0,28 CHF	Investimento Min. Ingresso	50.000 CHF
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	0,88%
Data di Partenza	07/08/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,89%
Nome del Gestore	James Park	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-

Goldman Sachs Funds II - Goldman Sachs Strategic Factor Allocation Portfolio

Data Inizio Gestione 01/07/2022 ISIN LU1651879543

P-CHF Hedged Acc
(AVL 01/07/25) CHF 130,57

Patrimonio Netto (Mln) 902,54 USD

(31/12/2024)