

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio P Inc USD

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

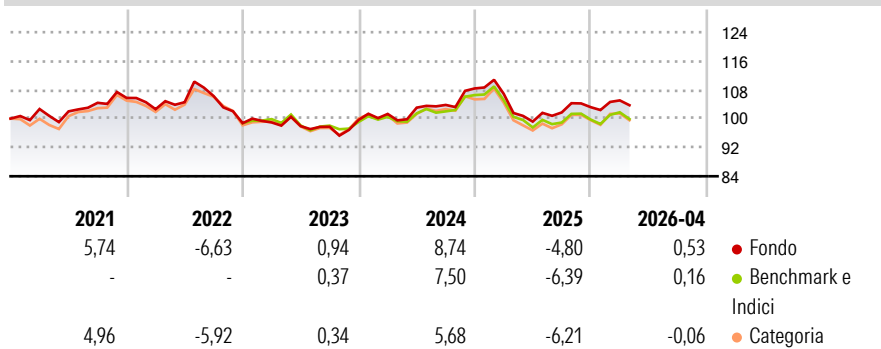
Bloomberg US Securitised GR USD

Morningstar Rating™

★★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Comparto intende fornire un reddito e una crescita del capitale nel lungo termine. Il Comparto investirà prevalentemente in titoli garantiti da ipoteca e da attività statunitensi.

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	2,04	3Y Sharpe Ratio	-0,12
3Y Beta	1,20	3Y Std Dev	6,83
3Y R-Squared	91,90	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,76	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,04	10Y Risk	Med

Basati su Morningstar US Government Bond TR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,66	0,19	0,03	2026	1,83	-	-	-
6-Mesi	-0,32	-1,34	-1,65	2025	-1,38	-7,21	2,57	1,43
1-Anno	0,84	-0,77	-0,18	2024	1,64	1,72	0,73	4,41
3-Anni Ann.ti	1,08	-0,23	-0,66	2023	0,20	-1,03	-0,17	1,96
5-Anni Ann.ti	0,67	0,39	-0,28	2022	-2,95	1,88	1,63	-7,08
10-Anni Ann.ti	0,92	0,72	0,25					

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Portafoglio 28/02/2026


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	129,55
● Liquidità	-29,55
● Altro	0,00

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Med	Basso	Alta

Duration Effettiva	4,93
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	AA

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
	0		0
AAA	-22,9	BBB	1,30
	0	BB	0,00
AA	119,3	B	0,18
	6	Below B	0,18
A	1,88	Not Rated	0,00

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal National Mortgage...	—	8,55
10 Year Treasury Note Future...	—	7,03
Federal National Mortgage...	—	6,49
Government National Mortgage...	—	4,31
Government National Mortgage...	—	3,61
Government National Mortgage...	—	3,48
Government National Mortgage...	—	3,17
Government National Mortgage...	—	3,13
Government National Mortgage...	—	2,90
Federal Home Loan Mortgage...	—	2,74
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		45,41
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		697

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏠 Governativo	-8,92
🏠 Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	139,10
🏠 Enti Locali	0,06
🏠 Liquidità ed equivalenti	-29,59
🏠 Derivati	-0,65

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	1,68
Da 0 a 4 cedole	50,97
Da 4 a 6 cedole	40,28
Da 6 a 8 cedole	7,06
Da 8 a 10 cedole	0,01
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %

	Fondo
da 1 a 3	11,70
da 3 a 5	0,81
da 5 a 7	4,14
da 7 a 10	6,80
da 10 a 15	7,47
da 15 a 20	5,77
da 20 a 30	37,56
oltre 30	21,85

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,10 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	29/05/2009	UCITS	Si	Spese correnti	0,67%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	ISIN	LU0429683740		
NAV (12/05/2026)	USD 9,81				
Patrimonio Netto (Mln)	140,64 USD				

(28/02/2026)