

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio P Acc USD

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

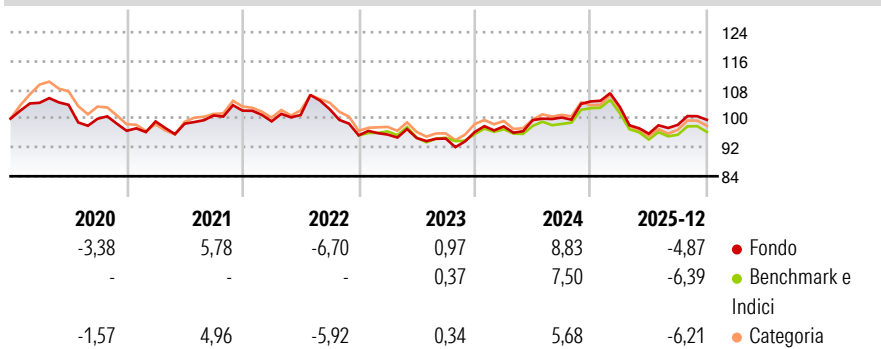
Bloomberg US Securitised GR USD

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.

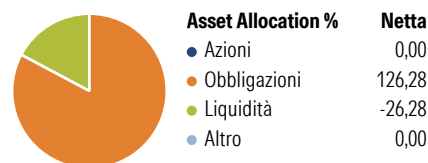
Rendimenti

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 1,45 | 3Y Sharpe Ratio | -0,19 |
| 3Y Beta | 1,18 | 3Y Std Dev | 6,72 |
| 3Y R-Squared | 91,70 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,55 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 2,16 | 10Y Risk | Med |

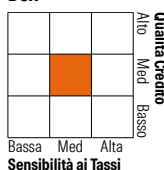
Basati su Morningstar US Government Bond TR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | -1,88 | -2,81 | -3,50 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 2,37 | 0,38 | 1,02 | 2025 | -1,43 | -7,22 | 2,55 | 1,44 |
| 1-Anno | -5,86 | -7,83 | -7,41 | 2024 | 1,62 | 1,79 | 0,71 | 4,46 |
| 3-Anni Ann.ti | 0,58 | -0,45 | -0,97 | 2023 | 0,23 | -1,00 | -0,16 | 1,93 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,18 | -0,51 | -1,22 | 2022 | -2,91 | 1,78 | 1,61 | -7,09 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,51 | 0,31 | 0,05 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Portafoglio 30/11/2025

Fixed Income Style

Box™


Fondo

 Duration Effettiva 5,28
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media AA

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|------|
| AAA | -27,9 | BBB | 1,54 |
| AA | 124,6 | BB | 0,00 |
| A | 9 | B | 0,13 |
| | 1,46 | Below B | 0,14 |
| | | Not Rated | 0,00 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Federal National Mortgage... | — | 15,16 |
| Federal National Mortgage... | — | 6,02 |
| Federal National Mortgage... | — | 5,87 |
| GS USD Treasury Liq Res X Inc | — | 5,81 |
| United States Treasury Bills... | — | 5,31 |
| Federal National Mortgage... | — | 4,55 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 3,83 |
| Government National Mortgage... | — | 3,78 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 3,20 |
| Government National Mortgage... | — | 3,12 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 56,67 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 687 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|--------------------------|--------|
| Governativo | 8,05 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 126,64 |
| Enti Locali | 0,05 |
| Liquidità ed equivalenti | -34,40 |
| Derivati | -0,34 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 2,43 |
| Da 0 a 4 cedole | 51,13 |
| Da 4 a 6 cedole | 39,21 |
| Da 6 a 8 cedole | 7,11 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,11 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 10,22 |
| da 3 a 5 | 0,35 |
| da 5 a 7 | 5,33 |
| da 7 a 10 | 6,79 |
| da 10 a 15 | 6,70 |
| da 15 a 20 | 5,83 |
| da 20 a 30 | 44,74 |
| oltre 30 | 19,56 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 23,34 USD | Investimento Min. Ingresso | 50.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | (28/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 29/05/2009 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 0,67% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 30/09/2002 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (28/01/2026) | USD 15,36 | ISIN | LU0429683823 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 186,95 USD | | | | |

(30/11/2025)