

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio Base Inc USD

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

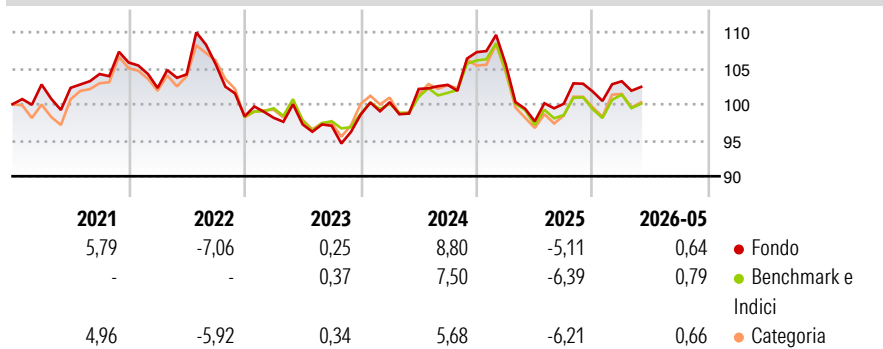
Bloomberg US Securitised GR USD

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 | 1,43 | 3Y Sharpe Ratio | -0,27 |
| 3Y Beta | 1,20 | 3Y Std Dev | 6,91 |
| 3Y R-Squared | 89,96 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,47 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 2,20 | 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 | -0,45 | -0,54 | -0,57 | 2026 | 1,41 | - | - | - |
| 6-Mesi | 2,47 | 1,87 | 1,90 | 2025 | -1,58 | -7,50 | 2,49 | 1,69 |
| 1-Anno | 5,44 | 3,36 | 3,67 | 2024 | 1,74 | 1,84 | 0,56 | 4,42 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,35 | 0,46 | 0,25 | 2023 | -0,21 | -0,94 | -0,19 | 1,60 |
| 5-Anni Ann.ti | 0,61 | 0,47 | -0,01 | 2022 | -3,34 | 1,84 | 1,38 | -6,88 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,58 | 0,72 | 0,27 | | | | | |

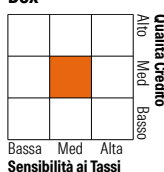
Rendimenti aggiornati al 12/06/2026

Portafoglio 31/03/2026


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 122,37 |
| ● Liquidità | -22,37 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style

Box™



| | |
|-----------------------|------|
| Duration Effettiva | 5,27 |
| Maturità effettiva | - |
| Qualità Credito Media | AA |

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|------|
| AAA | -22,2 | BBB | 1,47 |
| AA | 118,2 | BB | 0,00 |
| A | 8 | B | 0,20 |
| | 2,06 | Below B | 0,20 |
| | | Not Rated | 0,00 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Federal National Mortgage... | — | 8,89 |
| Government National Mortgage... | — | 4,05 |
| Federal National Mortgage... | — | 3,99 |
| Federal National Mortgage... | — | 3,97 |
| Government National Mortgage... | — | 3,82 |
| 10 Year Treasury Note Future... | — | 3,75 |
| Government National Mortgage... | — | 3,47 |
| Government National Mortgage... | — | 3,31 |
| Government National Mortgage... | — | 3,27 |
| CBOT/CBT 5-YR TNOTE 6/2026 | — | 3,05 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 41,58 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 640 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|----------------------------|--------------|
| 🏠 Governativo | -12,29 |
| 🏢 Societario | 0,09 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 135,24 |
| 🏠 Enti Locali | 0,06 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | -22,77 |
| 🏠 Derivati | -0,33 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 1,46 |
| Da 0 a 4 cedole | 49,82 |
| Da 4 a 6 cedole | 40,87 |
| Da 6 a 8 cedole | 7,83 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,01 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| Scadenza | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 3,16 |
| da 3 a 5 | 1,06 |
| da 5 a 7 | 4,94 |
| da 7 a 10 | 5,87 |
| da 10 a 15 | 5,27 |
| da 15 a 20 | 7,48 |
| da 20 a 30 | 52,55 |
| oltre 30 | 15,14 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | Goldman Sachs Asset Management B.V. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,54 USD | Investimento Min. Ingresso | 5.000 EUR |
| Telefono | +31-703781781 | (12/06/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | https://am.gs.com/ | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 30/09/2002 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 1,04% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 30/09/2002 | Inc/Acc | Inc | | |
| NAV (12/06/2026) | USD 1,95 | ISIN | LU0154844384 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 135,26 USD | | | | |

(31/03/2026)

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.