

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

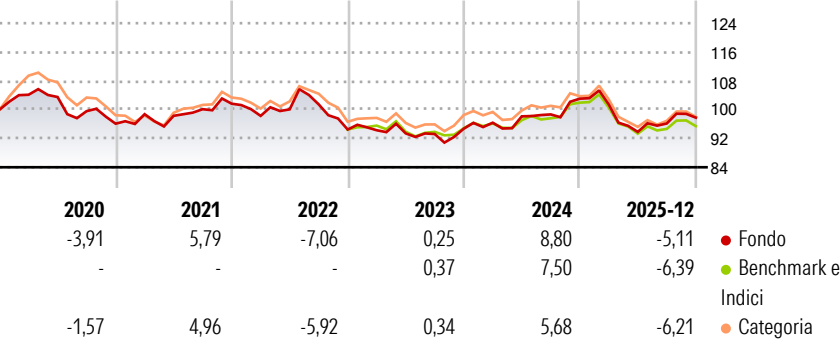
Morningstar Rating™

★★★★

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	1,10	3Y Sharpe Ratio	-0,23
3Y Beta	1,17	3Y Std Dev	6,92
3Y R-Squared	88,89	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,35	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,39	10Y Risk	Med

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

Rend. Cumulati %

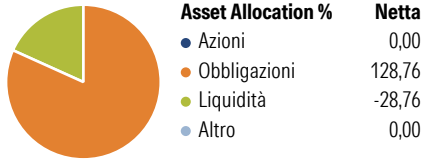
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,86	0,32	0,25
6-Mesi	5,37	3,31	3,84
1-Anno	-3,38	-5,71	-5,29
3-Anni Ann.ti	1,36	0,49	0,19
5-Anni Ann.ti	0,47	0,07	-0,29
10-Anni Ann.ti	0,52	0,64	0,38

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

Rendimenti

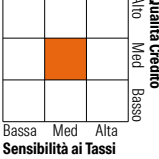
Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-1,58	-7,50	2,49	1,69
2024	1,74	1,84	0,56	4,42
2023	-0,21	-0,94	-0,19	1,60
2022	-3,34	1,84	1,38	-6,88

Portafoglio 31/10/2025



Fixed Income Style

Box™



Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

5,36

-

AA

Credit Quality %

	0		0
AAA	-26,7	BBB	1,55
	6	BB	0,00
AA	123,4	B	0,13
	4	Below B	0,14
A	1,50	Not Rated	0,00

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal National Mortgage...	—	11,40
Federal National Mortgage...	—	6,59
Federal National Mortgage...	—	5,88
United States Treasury Bills...	—	5,32
Federal National Mortgage...	—	4,56
Federal Home Loan Mortgage...	—	3,86
Government National Mortgage...	—	3,79
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	3,31
Federal Home Loan Mortgage...	—	3,23
Government National Mortgage...	—	3,13
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		51,06
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		691

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	8,73
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	125,80
Enti Locali	0,05
Liquidità ed equivalenti	-34,28
Derivati	-0,30

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	3,67
Da 0 a 4 cedole	52,73
Da 4 a 6 cedole	36,83
Da 6 a 8 cedole	6,77
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	10,38
da 3 a 5	0,36
da 5 a 7	5,23
da 7 a 10	6,74
da 10 a 15	7,28
da 15 a 20	5,58
da 20 a 30	39,10
oltre 30	23,83

Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,57 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	30/09/2002	UCITS	Si	Spese correnti	1,04%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	ISIN	LU0154844384		
NAV (16/01/2026)	USD 1,96				
Patrimonio Netto (Mln)	186,03 USD				

(31/10/2025)