## **Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio Base Inc USD**

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

## Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD Bloomberg US Securitised GR USD

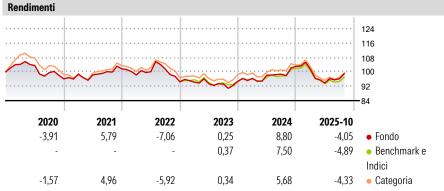
**Benchmark Dichiarato** 

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.



| Misure di Rischio           |            |                                |       |
|-----------------------------|------------|--------------------------------|-------|
| 3Y Alpha                    | 1,32       | 3Y Sharpe Ratio                | -0,36 |
| 3Y Beta                     | 1,17       | 3Y Std Dev                     | 7,16  |
| 3Y R-Squared                | 89,26      | 3Y Risk                        | Med   |
| 3Y Info Ratio               | 0,49       | 5Y Risk                        | Med   |
| 3Y Tracking Error           | 2,44       | 10Y Risk                       | Med   |
| Basati su Morningstar US Go | vernment l | Bond TR USD (dove applicabile) |       |

|  |       |       |       |               | •     |       |       |       |
|--|-------|-------|-------|---------------|-------|-------|-------|-------|
| Rend. Cumulati %                                   | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti    | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
| 3-Mesi   | 3,13  | 2,94  | 2,84  | Trimestrali % |       |       |       |       |
| 6-Mesi   | 3,57  | 1,76  | 2,36  | 2025          | -1,58 | -7,50 | 2,49  | -     |
| 1-Anno   | -2,87 | -4,45 | -4,37 | 2024          | 1,74  | 1,84  | 0,56  | 4,42  |
| 3-Anni Ann.ti                                      | 0,42  | -0,48 | -0,27 | 2023          | -0,21 | -0,94 | -0,19 | 1,60  |
| 5-Anni Ann.ti                                      | 0,14  | -0,34 | -0,94 | 2022          | -3,34 | 1,84  | 1,38  | -6,88 |
| 10-Anni Ann.ti<br>Rendimenti aggiornati al 28/11/2 | 0,11  | 0,44  | 0,08  | 2021          | 2,74  | -0,46 | 1,87  | 1,53  |

## Portafoglio 30/09/2025





|                       | ronao |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva    | 5,40  |
| Maturity effettiva    | -     |
| Qualità Credito Media | Α     |
|                       |       |
|                       |       |
|                       |       |

| Credit Quality % | Fond  | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|------|
|                  | 0     |                  | 0    |
| AAA              | -22,4 | BBB              | 1,59 |
|                  | 7     | BB               | 0,00 |
| AA               | 118,2 | В                | 0,13 |
|                  | 5     | Below B          | 0,14 |
| Α                | 1,57  | Not Rated        | 0,79 |
|                  |       |                  |      |

| Titoli principali                     |         |       |
|---------------------------------------|---------|-------|
| Nome                                  | Settore | %     |
| Federal National Mortgage             | _       | 6,61  |
| Federal National Mortgage             | _       | 5,58  |
| United States Treasury Bills          | _       | 5,46  |
| Federal National Mortgage             | _       | 5,42  |
| Federal National Mortgage             | -       | 4,60  |
| GS USD Treasury Liq Res X Inc         | _       | 3,94  |
| Federal National Mortgage             | _       | 3,92  |
| Government National Mortgage          | _       | 3,85  |
| Federal Home Loan Mortgage            | _       | 3,28  |
| Government National Mortgage          | -       | 3,16  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio      |         | 45,82 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligaz | ionari  | 684   |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| <b>₩</b> Governativo             | 7,35   |
| Societario                       | 1,71   |
| ★ Cartolarizzazioni              | 120,12 |
| Enti Locali                      | 0,06   |
| 🚅 Liquidità ed equivalenti       | -28,75 |
| ■ Derivati                       | -0,48  |
| Coupon Range %                   | Fondo  |
| 0 coupon                         | 0,72   |
| Da 0 a 4 cedole                  | 56,46  |
| Da 4 a 6 cedole                  | 35,83  |
| Da 6 a 8 cedole                  | 6,98   |
| 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   | 7,61  |
| da 3 a 5   | 2,50  |
| da 5 a 7   | 6,10  |
| da 7 a 10  | 6,96  |
| da 10 a 15 | 7,32  |
| da 15 a 20 | 5,81  |
| da 20 a 30 | 46,80 |
| oltre 30   | 16,91 |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |

| Anagrafica             |                     |
|------------------------|---------------------|
| Società di Gestione    | Goldman Sachs Asset |
|                        | Management B.V.     |
| Telefono               | +31-703781781       |
| Web                    | https://am.gs.com/  |
| Data di Partenza       | 30/09/2002          |
| Nome del Gestore       | -                   |
| Data Inizio Gestione   | 30/09/2002          |
| NAV (28/11/2025)       | USD 2,01            |
| Patrimonio Netto (MIn) | 183,22 USD          |
| (20/00/2025)           |                     |

| 0,59 USD     |
|--------------|
|              |
| LUSSEMBURGO  |
| USD          |
| Si           |
| Inc          |
| LU0154844384 |
|              |
|              |

| Investimento Min. Ingresso   | 5.000 EUR |
|------------------------------|-----------|
| Investimento Min. Successivo | -         |
| T.E.R.                       | 1,05%     |
| Spese correnti               | 1,04%     |
| Commissione di incentivo     | -         |