

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio Base Acc USD

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

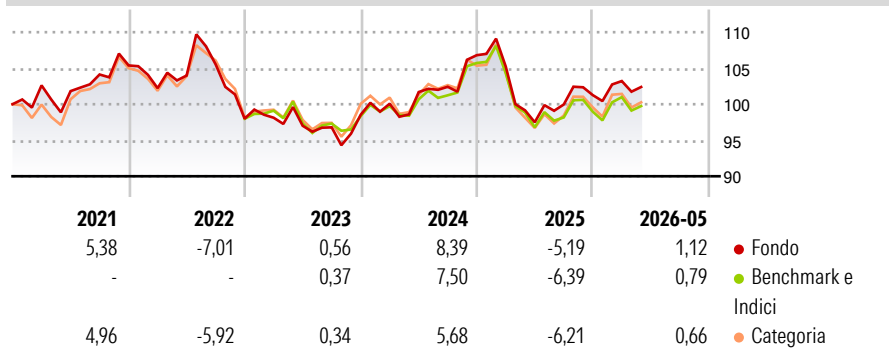
Bloomberg US Securitised GR USD

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.

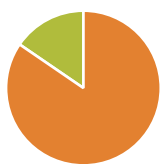
Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,58	3Y Sharpe Ratio	-0,26
3Y Beta	1,21	3Y Std Dev	6,71
3Y R-Squared	92,04	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,57	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	-1,00	-1,31	-1,19	2026	1,93	-	-	-
6-Mesi	2,47	1,77	1,97	2025	-1,47	-7,35	2,53	1,30
1-Anno	5,23	3,15	3,96	2024	1,56	1,62	0,72	4,28
3-Anni Ann.ti	1,90	0,87	0,51	2023	0,14	-1,14	-0,23	1,80
5-Anni Ann.ti	0,66	0,51	-0,13	2022	-2,99	1,71	1,49	-7,15
10-Anni Ann.ti	0,59	0,61	0,27					

Rendimenti aggiornati al 15/06/2026

Portafoglio 31/03/2026


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

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Duration Effettiva	Fondo 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	Below B	0,20
	2,06	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 %

	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 %

	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)	0,95 USD	Investimento Min. Ingresso	1.500 EUR
Telefono	+31-703781781	(15/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	14/11/2005	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,04%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	Inc/Acc	Acc		
NAV (15/06/2026)	USD 17,11	ISIN	LU0234571056		
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.