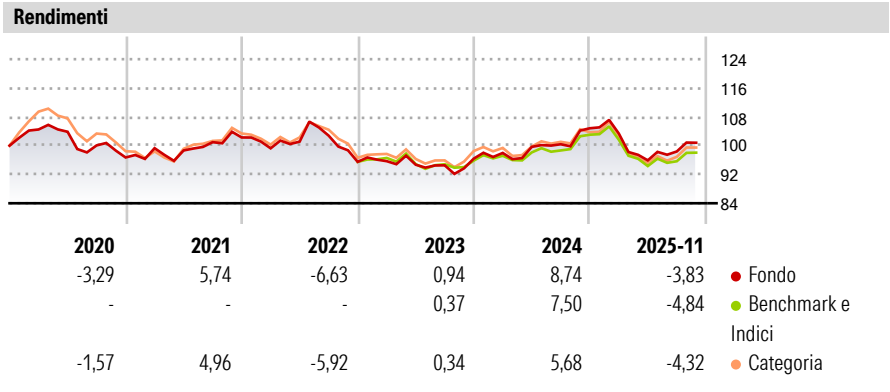


Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio P Inc USD

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
Obbligazionari Governativi USD	Morningstar US Government Bond TR USD Usato nel Report	Bloomberg US Securitised GR USD	★★★★

**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.



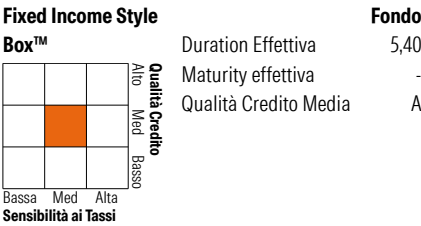
Misure di Rischio			
3Y Alpha	1,48	3Y Sharpe Ratio	-0,29
3Y Beta	1,18	3Y Std Dev	6,98
3Y R-Squared	91,69	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,57	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,14	10Y Risk	Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,43	0,13	-0,34	2025	-1,38	-7,21	2,57	-
6-Mesi	2,80	1,35	1,86	2024	1,64	1,72	0,73	4,41
1-Anno	-4,81	-6,10	-6,36	2023	0,20	-1,03	-0,17	1,96
3-Anni Ann.ti	0,41	-0,57	-1,11	2022	-2,95	1,88	1,63	-7,08
5-Anni Ann.ti	0,39	-0,35	-1,06	2021	2,66	-0,63	2,33	1,30
10-Anni Ann.ti	0,61	0,58	0,32					

Rendimenti aggiornati al 15/12/2025

Portafoglio 30/09/2025



Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	-22,4	BBB	1,59
	7	BB	0,00
AA	118,2	B	0,13
	5	Below B	0,14
A	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 Obbligazionari		684

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
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.	Patrimonio Classe (Mln)	0,33 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(15/12/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,70%
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	Inc		
NAV (15/12/2025)	USD 9,73	ISIN	LU0429683740		
Patrimonio Netto (Mln)	183,22 USD				

(30/09/2025)