

# Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio P 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

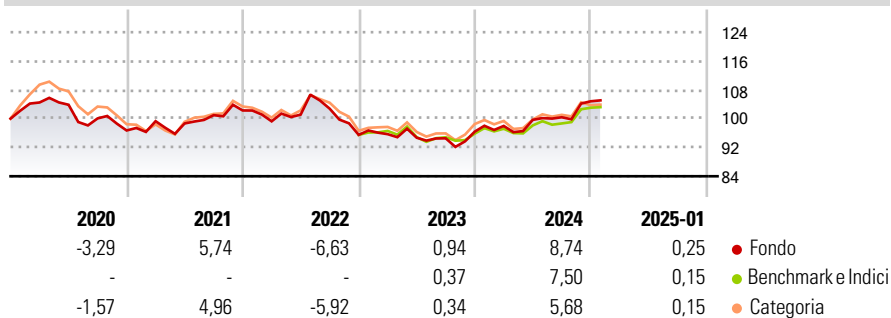
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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	1,89	3Y Sharpe Ratio	-0,17
3Y Beta	1,21	3Y Std Dev	6,96
3Y R-Squared	93,47	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,19	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,46	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	4,96	4,97	4,58	2025	-	-	-	-
6-Mesi	3,91	3,54	2,69	2024	1,64	1,72	0,73	4,41
1-Anno	6,97	6,18	6,03	2023	0,20	-1,03	-0,17	1,96
3-Anni Ann.ti	1,70	1,59	0,42	2022	-2,95	1,88	1,63	-7,08
5-Anni Ann.ti	0,43	0,36	-0,52	2021	2,66	-0,63	2,33	1,30
10-Anni Ann.ti	1,65	1,70	1,18					

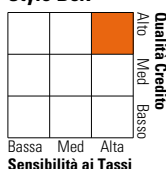
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	186,57
● Liquidità	-86,57
● Altro	0,00

### Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva	Fondo 6,07
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	AA

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	93,57	BBB	2,24
AA	2,86	BB	0,11
A	0,39	B	0,00
		Below B	0,13
		Not Rated	0,70

### Titoli principali

Nome	Settore	%
Government National Mortgage...	-	3,85
Government National Mortgage...	-	3,82
Government National Mortgage...	-	3,79
Federal National Mortgage...	-	3,48
Government National Mortgage...	-	3,19
Federal National Mortgage...	-	2,96
Federal Home Loan Mortgage...	-	2,91
Government National Mortgage...	-	2,90
Federal National Mortgage...	-	2,88
Federal National Mortgage...	-	2,77
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		32,56
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		754

### Fixed Income Sector Weightings %

🏠 Governativo	Fondo 57,52
🏢 Societario	0,73
🏠 Cartolarizzazioni	128,70
🏠 Enti Locali	0,07
🏠 Liquidità ed equivalenti	-87,01
📄 Derivati	-0,01

### Coupon Range %

0 coupon	Fondo 0,74
Da 0 a 4 cedole	54,25
Da 4 a 6 cedole	32,83
Da 6 a 8 cedole	11,50
Da 8 a 10 cedole	0,69
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

### Scadenze %

da 1 a 3	Fondo 0,01
da 3 a 5	3,62
da 5 a 7	2,85
da 7 a 10	2,16
da 10 a 15	6,16
da 15 a 20	3,80
da 20 a 30	35,30
oltre 30	15,41

### Anagrafica

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,31 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,66%
Data di Partenza	29/05/2009	UCITS	Si	Spese correnti	0,68%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	ISIN	LU0429683740		
NAV (04/02/2025)	USD 9,41				
Patrimonio Netto (Mln)	209,40 USD				

(31/12/2024)