

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio P 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

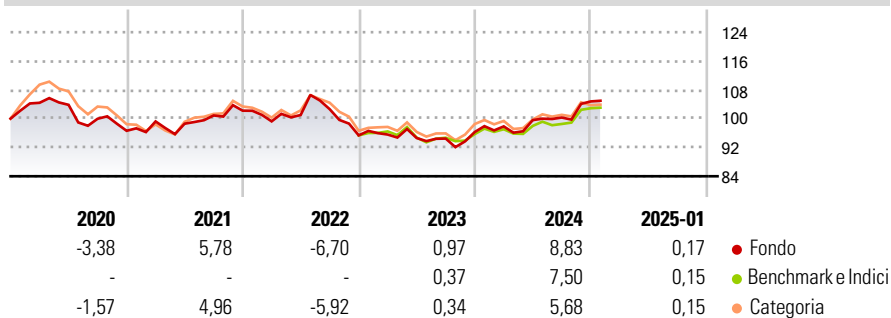
Morningstar Rating™

★★★★

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	1,90	3Y Sharpe Ratio	-0,17
3Y Beta	1,22	3Y Std Dev	6,97
3Y R-Squared	93,30	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,18	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,50	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	4,92	4,97	4,58	2025	-	-	-	-
6-Mesi	3,90	3,54	2,69	2025	1,62	1,79	0,71	4,46
1-Anno	6,84	6,18	6,03	2024	0,23	-1,00	-0,16	1,93
3-Anni Ann.ti	1,68	1,59	0,42	2023	-2,91	1,78	1,61	-7,09
5-Anni Ann.ti	0,39	0,36	-0,52	2022	2,69	-0,63	2,33	1,31
10-Anni Ann.ti	1,73	1,70	1,18	2021				

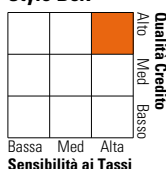
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

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)	24,63 USD	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(04/02/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
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	Acc		
NAV (04/02/2025)	USD 14,21	ISIN	LU0429683823		
Patrimonio Netto (Mln)	209,40 USD				

(31/12/2024)