

# Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio Base Inc USD

**Categoria Morningstar™**

Obbligazionari Governativi USD

**Benchmark Morningstar**

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

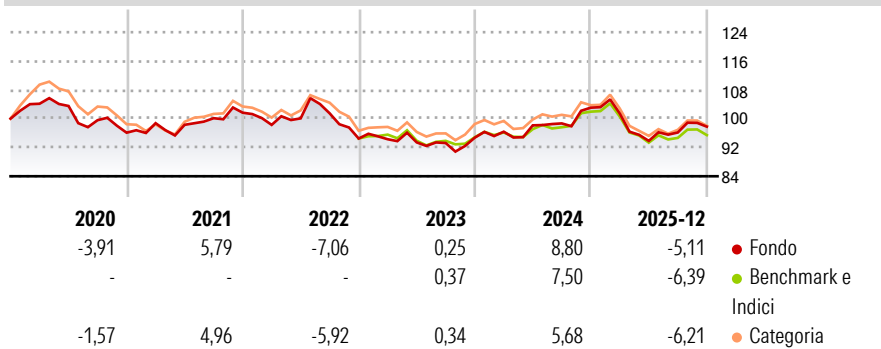
Bloomberg US Securitised GR USD

**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.

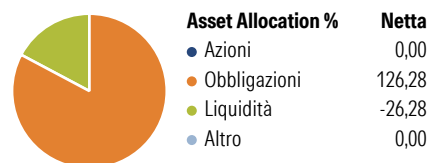
**Rendimenti**

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	1,10	3Y Sharpe Ratio	-0,23
3Y Beta	1,17	3Y Std Dev	6,92
3Y R-Squared	88,89	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,35	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,39	10Y Risk	Med

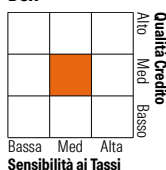
Basati su Morningstar US Government Bond TR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-2,10	-2,11	-2,73	2026	-	-	-	-
6-Mesi	0,72	-0,92	-0,48	2025	-1,58	-7,50	2,49	1,69
1-Anno	-6,49	-7,62	-7,22	2024	1,74	1,84	0,56	4,42
3-Anni Ann.ti	0,27	-0,39	-0,90	2023	-0,21	-0,94	-0,19	1,60
5-Anni Ann.ti	-0,11	-0,39	-1,09	2022	-3,34	1,84	1,38	-6,88
10-Anni Ann.ti	0,02	0,19	-0,06					

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

**Portafoglio 30/11/2025**

**Fixed Income Style**

Box™



Fondo

Duration Effettiva 5,28

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media AA

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	-27,9	BBB	1,54
AA	124,6	BB	0,00
A	9	B	0,13
	1,46	Below B	0,14
		Not Rated	0,00

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Federal National Mortgage...	—	15,16
Federal National Mortgage...	—	6,02
Federal National Mortgage...	—	5,87
GS USD Treasury Liq Res X Inc	—	5,81
United States Treasury Bills...	—	5,31
Federal National Mortgage...	—	4,55
Federal Home Loan Mortgage...	—	3,83
Government National Mortgage...	—	3,78
Federal Home Loan Mortgage...	—	3,20
Government National Mortgage...	—	3,12
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		56,67
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		687

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
Governativo	8,05
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	126,64
Enti Locali	0,05
Liquidità ed equivalenti	-34,40
Derivati	-0,34

**Coupon Range %**

	Fondo
0 coupon	2,43
Da 0 a 4 cedole	51,13
Da 4 a 6 cedole	39,21
Da 6 a 8 cedole	7,11
Da 8 a 10 cedole	0,11
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

**Scadenze %**

	Fondo
da 1 a 3	10,22
da 3 a 5	0,35
da 5 a 7	5,33
da 7 a 10	6,79
da 10 a 15	6,70
da 15 a 20	5,83
da 20 a 30	44,74
oltre 30	19,56

**Anagrafica**

Società di Gestione	Goldman Sachs Asset Management B.V.	Patrimonio Classe (Mln)	0,57 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 EUR
Telefono	+31-703781781	(29/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	https://am.gs.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	30/09/2002	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,04%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	Inc/Acc	Inc		
NAV (29/01/2026)	USD 1,95	ISIN	LU0154844384		
Patrimonio Netto (Mln)	186,95 USD				

(30/11/2025)