

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

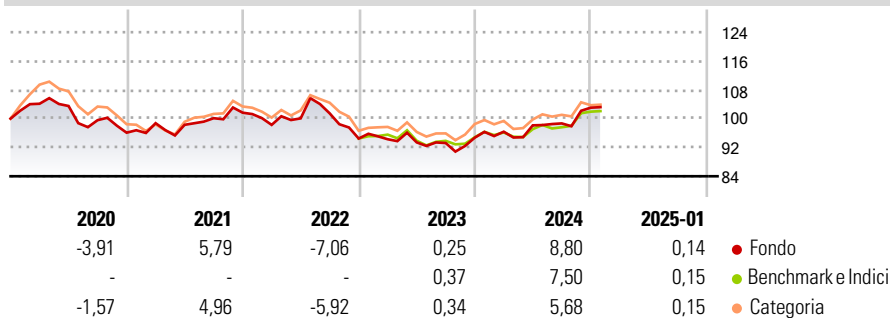
Benchmark Dichiarato
Bloomberg US Securitised GR USD

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

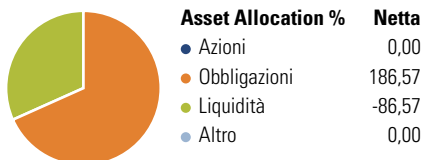
3Y Alpha	1,59	3Y Sharpe Ratio	-0,20
3Y Beta	1,21	3Y Std Dev	7,12
3Y R-Squared	90,71	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,07	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,81	10Y Risk	-Med

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

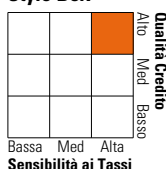
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,87	4,97	4,58	2025	-	-	-	-
6-Mesi	3,50	3,54	2,69	2025	1,74	1,84	0,56	4,42
1-Anno	6,69	6,18	6,03	2024	-0,21	-0,94	-0,19	1,60
3-Anni Ann.ti	1,35	1,59	0,42	2023	-3,34	1,84	1,38	-6,88
5-Anni Ann.ti	0,04	0,36	-0,52	2022	2,74	-0,46	1,87	1,53
10-Anni Ann.ti	1,31	1,70	1,18	2021				

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



Fixed Income Style Box™



Fondo
Duration Effettiva 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 %

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

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	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 %

	Fondo
da 1 a 3	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)	0,55 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.	1,04%
Data di Partenza	30/09/2002	UCITS	Si	Spese correnti	1,04%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	ISIN	LU0154844384		
NAV (04/02/2025)	USD 1,87				
Patrimonio Netto (Mln)	209,40 USD				

(31/12/2024)