

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio A Inc USD

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Governativi USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Government Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

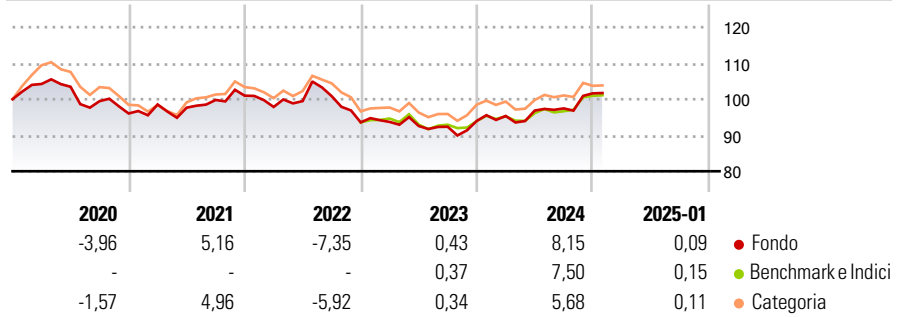
Bloomberg US Securitised GR USD

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	1,30	3Y Sharpe Ratio	-0,26
3Y Beta	1,22	3Y Std Dev	6,99
3Y R-Squared	93,54	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,07	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,49	10Y Risk	-Med

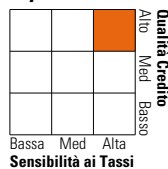
Basati su Morningstar US Government Bond TR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,15	4,87	4,82	2025	-	-	-	-
6-Mesi	5,50	5,06	4,82	2025	1,47	1,58	0,60	4,30
1-Anno	7,13	6,77	6,48	2024	0,12	-1,20	-0,22	1,75
3-Anni Ann.ti	1,48	1,73	1,09	2023	-3,11	1,66	1,39	-7,23
5-Anni Ann.ti	-0,15	0,28	-0,26	2022	2,60	-0,89	2,19	1,21
10-Anni Ann.ti	1,07	1,75	1,24	2021				

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

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 %

	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)	1,13 USD	Investimento Min. Ingresso	1.500 EUR
Telefono	+31-703781781	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	https://www.gsam.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	1,29%
Data di Partenza	19/02/2003	UCITS	Si	Spese correnti	1,29%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	30/09/2002	ISIN	LU0154844541		
NAV (07/02/2025)	USD 6,23				
Patrimonio Netto (Mln)	209,40 USD				

(31/12/2024)