

Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portfolio R Inc USD

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Government
Bond TR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Bloomberg US Securitised GR
USD

Morningstar Rating™

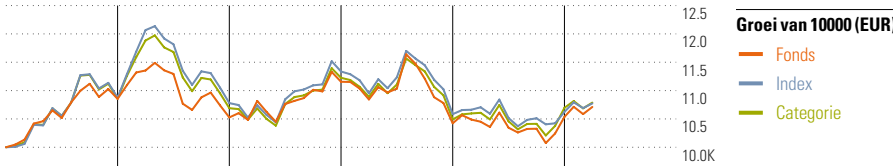
★★★★

Morningstar Categorie™

Obligaties USD Overheid

Beleggingsdoelstelling

De Goldman Sachs US Mortgage Backed Securities Portefeuille belegt in Amerikaanse door hypothecaire schuldvordering of activa gedekte vorderingen.



	2019	2020	2021	2022	2023	03/24	Rendement
	8.54	-3.01	5.97	-6.57	1.08	1.67	Fonds
	-	-	-	-	0.71	0.26	+/- Index
	-0.12	-1.43	1.01	-0.65	0.75	0.80	+/- Categorie
	47	58	33	47	17	17	Percentiel Score

Risicomaatstaven

Alpha	0.53	Sharpe Ratio	-0.19
Beta	1.16	Std Deviatie	6.81
R-kwadraat	90.97	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.17	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	2.41	10-jr Risico	- gem

Berekeningen met Morningstar US Govt Bd TR USD (waar van toepassing)

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.53	-0.33	0.05
6 Maanden	5.03	3.16	2.20
1 jaar	1.45	0.79	1.66
3 jr gean.	-0.17	-0.47	0.40
5 jr gean.	0.08	-0.36	0.31

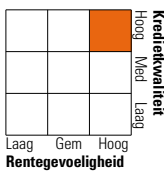
Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.67	-	-	-
2023	0.27	-1.01	-0.17	2.02
2022	-2.80	1.76	1.58	-7.02
2021	2.75	-0.49	2.33	1.29
2020	4.61	-0.54	-3.65	-3.25

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	148.95	49.20	99.75
Kas/ geldmarkt	0.25	0.00	0.25
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™



Tijdsduur	6.03
Effectieve Looptijd	-
Gem Krediet	AA
Kwaliteit	

Kredietkwaliteit	% Oblg		% Oblg
AAA	96.37	BBB	1.55
AA	1.49	BB	0.00
A	0.46	B	0.00
		Below B	0.13
		Geen Rating	0.00

Data per 29 feb 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Federal National Mortgage Association...	6.74
Government National Mortgage Association.	6.03
10 Year Treasury Note Future June...	6.00
Federal National Mortgage Association...	4.97
Government National Mortgage Association.	4.01
Federal National Mortgage Association...	3.51
Government National Mortgage Association.	2.94
Government National Mortgage Association.	2.51
Federal National Mortgage Association...	2.45
Us 5yr Note (Cbt) Jun24 Xcbt...	2.36
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	793
% Van Vermogen In Top 10 Posities	41.51

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	0.00
3 tot 5 jaar	2.83
5 tot 7 jaar	1.19
7 tot 10 jaar	5.03
10 tot 15 jaar	12.67
15 tot 20 jaar	2.85
20 tot 30 jaar	37.98
Meer dan 30 jaar	31.67

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	7.66
0% tot 4%	52.52
4% tot 6%	22.34
6% tot 8%	17.21
8% tot 10%	0.27
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Goldman Sachs Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000
Telefoon	+31-703781781	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	https://www.gsam.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	3 dec 2012	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Not Disclosed	ISIN	LU0830685821		
Aanvangsdatum	30 sep 2002				
Koers (26 apr 2024)	USD 8.01				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.85				