

BNP Paribas LDI Solution Duration Matching 35-50 Y Euro P

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar Eurozone 10+ Yr
Core Bond GR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

Morningstar Rating™

★

Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Lang

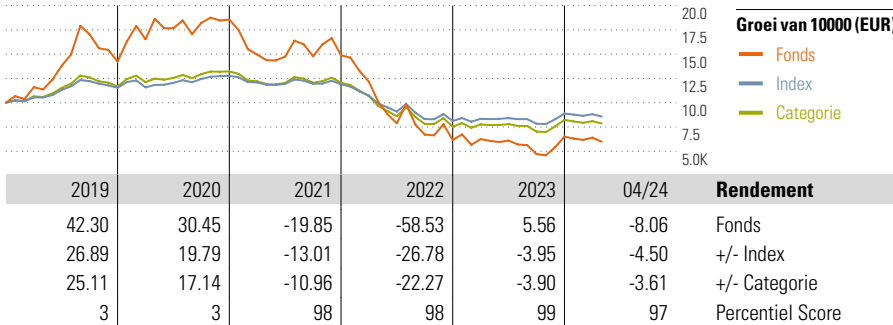
Beleggingsdoelstelling

The sub-fund invests mainly in government bonds with long duration, interest rate swaps, money market instruments, money market funds, and fixed income futures denominated in Euro. It aims to passively replicate a leveraged portfolio of zero-bonds with an overall unleveraged duration of 42.5 years. The sub-fund may also invest up to 10% of its assets in UCITS or UCIs. The sub-fund may use leverage on its portfolio only to replicate the leveraged portfolio used as referential in order to fulfil its investment objective.

Risicomaatstaven

Alpha	5.90	Sharpe Ratio	-0.57
Beta	2.60	Std Deviatie	39.56
R-kwadraat	95.55	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.60	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	25.17	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met Morningstar EZN 10+Y Core Bd GR EUR (waar van toepassing)



Rendementen (2 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-2.03	-1.35	-0.08
6 Maanden	27.54	19.58	20.04
1 jaar	-1.57	-4.93	-2.62
3 jr gean.	-24.93	-14.91	-13.52
5 jr gean.	-11.66	-7.78	-6.61

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-1.64	-	-	-
2023	1.55	-2.54	-22.69	37.96
2022	-18.27	-35.15	-14.76	-8.20
2021	-19.44	-1.36	0.18	0.69
2020	16.20	6.91	3.10	1.85

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	82.33	9.01	73.32
Kas/ geldmarkt	27.05	0.37	26.68
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	-
	Gem Krediet	-
	Kwaliteit	-
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog
Laag	Gem	Hoog

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
France (Republic Of) 1.75%2066-05-25	13.49
Germany (Federal Republic Of) 0%2050-08-11	10.62
Netherlands (Kingdom Of) 0%2052-01-15	8.92
Austria (Republic of) 3.8%2062-01-26	8.73
Netherlands (Kingdom Of) 2%2054-01-15	8.67
France (Republic Of) 0.5%2072-05-25	7.58
BNP Paribas InstiCash € 1D LVNAV I Cp	6.79
France (Republic Of) 4%2060-04-25	5.94
Germany (Federal Republic Of)...	4.36
Austria (Republic of) 0.7%2071-04-20	2.61
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	35
% Van Vermogen In Top 10 Posities	77.71

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	0.00
3 tot 5 jaar	0.00
5 tot 7 jaar	0.00
7 tot 10 jaar	0.00
10 tot 15 jaar	0.00
15 tot 20 jaar	1.68
20 tot 30 jaar	42.44
Meer dan 30 jaar	53.73

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	29.37
0% tot 4%	70.61
4% tot 6%	0.00
6% tot 8%	0.00
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.02

Fondsinformatie

Fondsgroep	BNP Paribas Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+352 2646 3017	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bnpparibas-am.com	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	8 jul 2005	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Maarten Hoedjes	ISIN	LU0223260588		
Aanvangsdatum	1 feb 2018				
Koers (2 mei 2024)	EUR 274.80				
Fondsvermogen (mln)	EUR 4.75				