

ASR Pensioen Staatsobligatiefonds 15+ Jaar

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

Bank of Am/ML 5+Y AAA-AA Gov
EUR

Morningstar Rating™

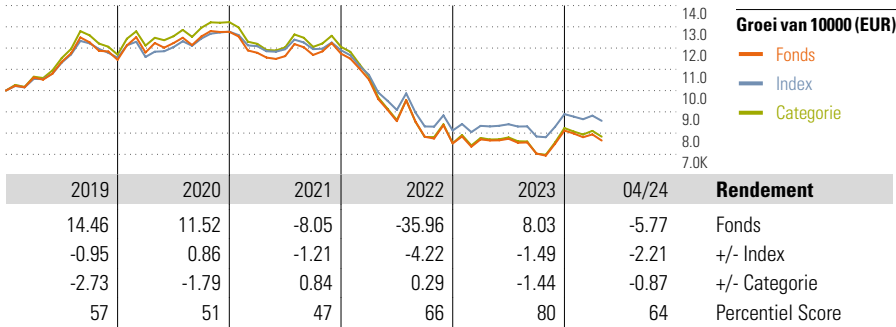
★★

Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Lang

Beleggingsdoelstelling

De doelstelling van het ASR Pensioen Staatsobligatiefonds 15+ Jaar is een belegging te bieden in een gediversifieerde portefeuille Investment Grade vastrentende titels en instrumenten met lange looptijden, voornamelijk uitgegeven door overheden en gedomineerd in euro. De benchmark is de Bank of America / Merrill Lynch 15+ Year AAA-AA Euro Government Index. Het beleggingsbeleid is erop gericht om over een drie-jaars periode een targetrendement te behalen dat minimaal gelijk is aan het rendement van de vastgestelde...



Risicomaatstaven

Alpha	0.10	Sharpe Ratio	-0.73
Beta	1.23	Std Deviatie	18.40
R-kwadraat	98.97	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	-0.68	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	3.85	10-jr Risico	-

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

Rendementen (30 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-3.51	-2.15	-1.95
6 Maanden	0.43	-2.41	-1.24
1 jaar	-0.46	-2.75	-0.79
3 jr gean.	-13.07	-2.76	-0.82
5 jr gean.	-6.95	-2.36	-0.60

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-2.21	-	-	-
2023	2.53	0.35	-9.00	15.38
2022	-10.37	-18.61	-8.57	-3.98
2021	-7.73	-1.32	0.45	0.54
2020	3.02	3.74	2.57	1.73

Portefeuille 30 apr 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	99.97	0.00	99.97
Kas/ geldmarkt	0.03	0.00	0.03
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

			Hoog	Kredietkwaliteit	Tijdsduur	-
			Met		Effectieve Looptijd	-
			Laag		Gem Krediet	-
					Kwaliteit	
Laag	Gem	Hoog				
Rentegevoeligheid						

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
France (Republic Of) 2%2048-05-25	9.36
Germany (Federal Republic Of)...	8.54
Germany (Federal Republic Of)...	7.38
France (Republic Of) 3%2054-05-25	6.53
Germany (Federal Republic Of)...	5.04
Germany (Federal Republic Of)...	3.85
France (Republic Of) 0.5%2044-06-25	3.78
Belgium (Kingdom Of) 3.5%2055-06-22	3.77
France (Republic Of) 4%2055-04-25	3.50
France (Republic Of) 4%2060-04-25	3.50
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	51
% Van Vermogen In Top 10 Posities	55.26

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	5.09
15 tot 20 jaar	11.57
20 tot 30 jaar	57.46
Meer dan 30 jaar	25.88

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	4.09
0% tot 4%	95.91
4% tot 6%	0.00
6% tot 8%	0.00
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	ASR Vermogensbeheer N.V.	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	030-2784120	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.asrvermogensbeheer.nl	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	2 nov 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Marèn Klap	ISIN	NL0012625032		
Aanvangsdatum	2 nov 2017				
Koers (30 mei 2024)	EUR 38.96				
Fondsvermogen (mln)	EUR 292.87				