

Algebris UCITS Funds plc - Algebris Financial Income Fund BD USD Inc Hedged

Morningstar Categorie Index

Morningstar EAA USD Mod Target
Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

No benchmark

Morningstar Rating™

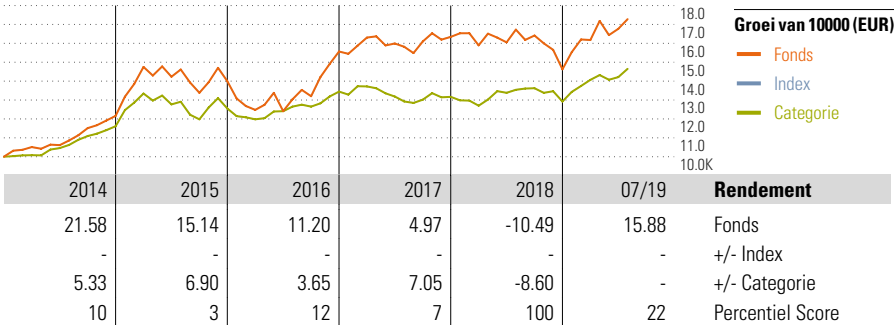
—

Morningstar Categorie™

Mixfondsen USD Neutraal

Beleggingsdoelstelling

The Fund's objective is to maximise income and generate superior risk-adjusted returns over an investment cycle of approximately 3 to 5 years by investing in high dividend-yielding equity stocks and bonds.



Risicomaatstaven

Alpha	-0.50	Sharpe Ratio	0.73
Beta	1.34	Std Deviatie	11.73
R-kwadraat	43.50	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	0.09	5-jr Risico	-
Tracking Error	8.89	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EAA USD Mod Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (16 aug 2019)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.34	-2.86	-2.47
6 Maanden	5.37	-4.26	-3.80
1 jaar	1.33	-11.80	-9.24
3 jr gean.	8.66	3.09	4.58
5 jr gean.	9.37	3.43	5.08

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	10.59	3.65	-	-
2018	-2.74	1.01	2.24	-10.88
2017	4.74	-1.93	0.67	1.50
2016	-10.86	-0.52	6.36	17.91
2015	21.32	-3.51	-5.98	4.60

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	32.41	0.01	32.40
Obligaties	35.73	0.04	35.69
Kas/ geldmarkt	21.74	0.00	21.74
Overig	10.17	0.00	10.17

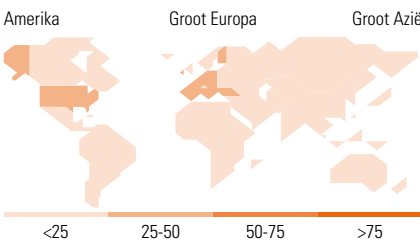
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Wrd	Gem	Groei
Stijl			
Klein			
Mid			
Groot			

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog
Rentegevoeligheid			
Laag			
Med			
Hoog			



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Banco Santander SA	Bank	2.23
Standard Chartered PLC	Bank	1.89
NatWest Group PLC	Bank	1.86
Caixabank S.A. 5.25%	Bank	1.70
Equitable Holdings Inc	Bank	1.56
PNC Financial Services Group...	Bank	1.27
Bank of Ireland Group PLC	Bank	1.18
Barclays PLC 8.875%	Bank	1.18
HSBC Holdings PLC	Bank	1.17
Banco Bilbao Vizcaya...	Bank	1.16
Totaal Aantal Aandelen		50
Totaal Aantal Obligaties		93
% Van Vermogen In Top 10 Posities		15.20

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	100.00
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	97.18
Vastgoed	2.82
Licht Cyclisch	0.00
Communicatiediensten	-
Energie	-
Industrie	-
Technologie	-
Defensief	0.00
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	-

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	36.34
Verenigde Staten	34.36
Canada	0.00
Latijns Amerika	1.98
Groot Europa	63.66
Verenigd Koninkrijk	22.08
West Europa – Euro	41.58
West Europa – Niet Euro	0.00
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.00
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.00
Azië - Emerging	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Algebris (UK) Limited	Vestigingsland	Ierland	Min Aanvangsbedrag	500,000
Telefoon	+44 20 78511740	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	-	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	20 aug 2013	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Mark Conrad	ISIN	IE00BBHX5V42		
Aanvangsdatum	13 aug 2013				
Koers (16 aug 2019)	USD 113.56				
Fondsvermogen (mln)	USD 1.94				