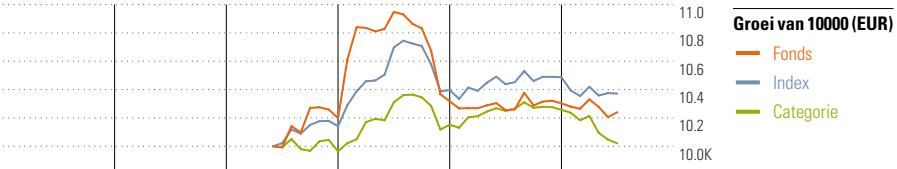
Robeco QI Global Dynamic Duration CH €

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR	JPM GBI Global IG TR Hdg EUR	—	Obligaties Wereldwijd Euro Hedged

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Beleggingsdoelstelling

Robeco Lux-o-rente belegt wereldwijd in solide staatsobligaties zoals die zijn opgenomen in JP Morgan global government bond index. Verder maakt het fonds gebruik van een uniek beleggingsmodel op basis waarvan de posities in Duitse, Amerikaanse en/of Japanse staatsobligaties worden vergroot of verkleind. De uitkomst van het model wordt bepaald door economische variabelen die de aantrekkingskracht van de obligatiemarkt beoordelen. Het valutarisico is volledig afgedekt naar de euro. Het model maakt gebruik van futures,...



2013	2014	2015	2016	2017	06/18	Rendement
-	-	-	1.16	-0.14	-0.60	Fonds
-	-	-	-1.36	-1.01	-	+/- Index
-	-	-	-0.70	-1.31	-	+/- Categorie
-	-	-	68	77	10	Percentiel Score

Risicomaatstaven			
Alpha	-0.71	Sharpe Ratio	0.33
Beta	1.28	Std Deviatie	3.84
R-kwadraat	66.98	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-0.14	5-jr Risico	-
Tracking Error	2.30	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar Gbl Core Bd GR Hdg EUR (waar van toepassing)

Rendementen (10 jul 2018)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.55	-1.06	-0.99
6 Maanden	-0.34	-3.79	-3.62
1 jaar	0.16	-1.09	-1.71
3 jr gean.	0.98	4.83	4.49
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2018	0.27	-0.87	-	-
2017	-0.47	-0.14	0.32	0.14
2016	6.24	1.03	-1.05	-4.76
2015	-	-	2.78	-0.69

Portefeuille 31 jan 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	133.08	3.59	129.49
Kas/ geldmarkt	121.12	150.61	-29.49
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

Tijdsduur	8.93
Effectieve Looptijd	10.38
Gem Krediet Kwaliteit	A

Kredietkwaliteit	% Oblg		% Oblg
AAA	12.88	BBB	6.03
AA	47.07	BB	0.00
A	34.02	B	0.00
		Below B	0.00
		Geen Rating	0.00

Data per31 jan 2024

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Future on 10 Year Japanese Government...	12.27
US Treasury Bond Future Mar 242024-03-19	10.48
Euro Schatz Future Mar 242024-03-07	5.92
Japan (Government Of) 0.1%2029-12-20	4.47
10 Year Treasury Note Future Mar...	3.80
United States Treasury Notes...	3.49
United States Treasury Notes 2%2026-11-15	3.46
United States Treasury Notes...	3.43
United States Treasury Notes...	3.38
United States Treasury Notes...	3.35
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	74
% Van Vermogen In Top 10 Posities	54.04

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	19.16
3 tot 5 jaar	10.60
5 tot 7 jaar	10.36
7 tot 10 jaar	12.36
10 tot 15 jaar	8.64
15 tot 20 jaar	5.15
20 tot 30 jaar	6.83
Meer dan 30 jaar	0.00

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.00
0% tot 4%	87.54
4% tot 6%	11.38
6% tot 8%	1.07
8% tot 10%	0.00
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	Robeco Institutional...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1 Aandeel
Telefoon	+31 10 2241224	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	1 Aandeel
Website	www.robeco.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	25 jun 2015	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Olaf Penninga	ISIN	LU1246241696		
Aanvangsdatum	1 dec 2010				
Koers (10 jul 2018)	EUR 99.03				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.02				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.