

BNP Paribas Flexi I US Mortgage Privilege Capitalisation

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
Morningstar US Government
Bond TR USD
Wordt gebruikt in dit rapport als index

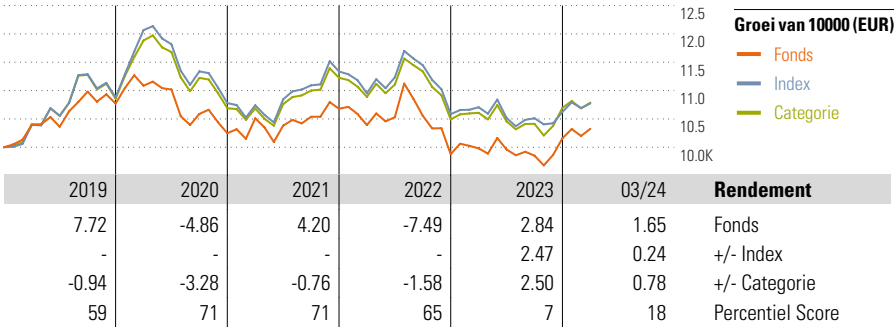
Benchmark van het fonds
Bloomberg US MBS TR USD

Morningstar Rating™
★★

Morningstar Categorie™
Obligaties USD Overheid

Beleggingsdoelstelling

The investment objective of the Sub-Fund is to attain as high a level of total return as may be consistent with the preservation of capital.



Risicomaatstaven

Alpha	0.65	Sharpe Ratio	-0.22
Beta	1.22	Std Deviatie	7.07
R-kwadraat	88.35	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.22	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	3.00	10-jr Risico	-

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

Rendementen (29 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.90	-0.02	0.19
6 Maanden	4.43	2.89	2.20
1 jaar	2.46	1.23	1.49
3 jr gean.	-0.45	-0.80	-0.45
5 jr gean.	-0.60	-1.22	-0.96

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.65	-	-	-
2023	1.03	-0.20	-1.10	3.12
2022	-2.69	1.33	0.24	-6.42
2021	2.55	-1.21	1.50	1.34
2020	2.92	-0.60	-3.91	-3.20

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	155.97	55.46	100.51
Kas/ geldmarkt	60.22	60.73	-0.51
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	5.76
Effectieve Looptijd	10.13	
Gem Krediet	AA	
Kwaliteit		

Kredietkwaliteit

it			
AAA	0.48	BBB	2.01
AA	92.39	BB	0.00
A	5.12	B	0.00
		Below B	0.00
		Geen Rating	0.00

Data per 31 mrt 2024

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
Federal National Mortgage Association...	24.56
BNP Paribas InstiCash USD 1D LVNAV X Cap	5.44
Government National Mortgage Association.	3.49
Government National Mortgage Association.	3.10
Federal National Mortgage Association...	3.06
Federal National Mortgage Association...	2.64
Federal National Mortgage Association...	2.28
Government National Mortgage Association.	1.88
Federal National Mortgage Association...	1.88
Government National Mortgage Association.	1.85
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	207
% Van Vermogen In Top 10 Posities	50.17

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	1.50
10 tot 15 jaar	5.27
15 tot 20 jaar	8.35
20 tot 30 jaar	84.03
Meer dan 30 jaar	0.41

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	0.00
0% tot 4%	59.46
4% tot 6%	32.28
6% tot 8%	7.62
8% tot 10%	0.61
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.03

Fondsinformatie

Fondsgroep	BNP Paribas Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	+352 2646 3017	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bnpparibas-am.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	25 sep 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Carey	ISIN	LU1080341578		
Aanvangsdatum	25 sep 2015				
Koers (29 apr 2024)	USD 104.32				
Fondsvermogen (mln)	USD 6.30				