

Robeco QI Global Dynamic Duration EH CHF

Morningstar Medalist Rating™
 Bronze

Morningstar Categorie Index
Morningstar Global Core Bond
GR Hedged CHF
Wordt gebruikt in dit rapport als index

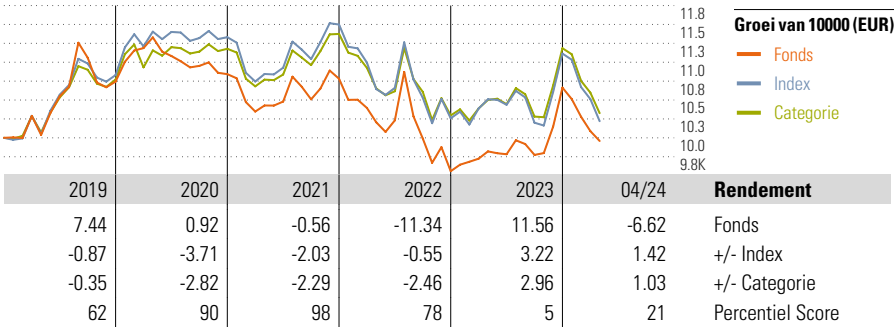
Benchmark van het fonds
JPM GBI Global IG TR Hdg EUR

Morningstar Rating™
★★★

Morningstar Categorie™
Obligaties Wereldwijd CHF
Hedged

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,...



Risicomaatstaven			
Alpha	-0.54	Sharpe Ratio	-0.31
Beta	0.84	Std Deviatie	8.23
R-kwadraat	77.44	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	0.15	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	2.82	10-jr Risico	Bov gem

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

Rendementen (15 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-3.26	0.18	0.03
6 Maanden	0.54	0.77	0.60
1 jaar	1.05	3.12	2.07
3 jr gean.	-1.46	0.13	-0.42
5 jr gean.	-0.32	-0.56	-0.46

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-5.40	-	-	-
2023	1.73	0.60	-0.10	9.11
2022	-3.58	-1.58	-2.35	-4.32
2021	-4.57	1.28	0.28	2.59
2020	4.13	-0.94	-1.18	-1.00

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™

Hoog

Med

Laag

Laag

Gem

Hoog

Kredietkwaliteit

Rentegevoeligheid

Tijdsduur

Effectieve Looptijd

Gem Krediet

Kwaliteit

8.93

10.38

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

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

Data per 31 jan 2024

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	CHF	Min Additioneel	1 Aandeel
Website	www.robeco.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	2 jan 2006	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Olaf Penninga	ISIN	LU0239949844		
Aanvangsdatum	1 dec 2010				
Koers (15 mei 2024)	CHF 78.63				
Fondsvermogen (mln)	CHF 1.10				

© 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.