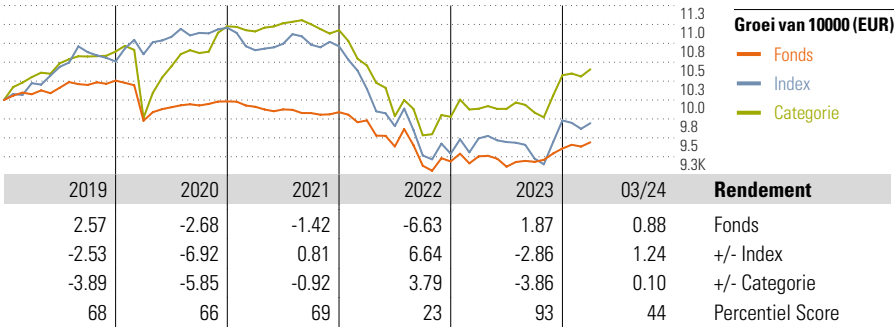


Amundi Funds - Global Macro Bonds & Currencies Low Vol SE-C

Morningstar Medalist Rating™ Negative	Morningstar Categorie Index Bloomberg Global Aggregate TR Hdg EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Euro Short Term Rate	Morningstar Rating™ ★★	Morningstar Categorie™ Global Flexible Bond - EUR Hedged
--	--	--	----------------------------------	---

Beleggingsdoelstelling

De beleggingsdoelstelling van het CAAM Funds Arbitrage Var2 is het realiseren van een totaalrendement in euro door actief een portefeuille te beheren die hoofdzakelijk samengesteld is uit obligaties en andere schuldbewijzen. Dit Subfonds streeft naar een prestatie die het over een beleggingshorizon van minstens één jaar meer dan 1% op jaarbasis beter doet dan de dagelijks vastgestelde EONIA (Euro Overnight Index Average).



Risicomaatstaven			
Alpha	-0.58	Sharpe Ratio	-0.77
Beta	0.51	Std Deviatie	3.68
R-kwadraat	63.94	3-jr Risico	- gem
Informatie Ratio	0.44	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	3.45	10-jr Risico	Laag

Berekeningen met Bloomberg Global Aggregate TR Hdg EUR (waar van toepassing)

Rendementen (23 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	0.19	0.92	0.23	2024	0.88	-	-	-
6 Maanden	2.29	-1.77	-3.36	2023	0.73	-1.47	0.70	1.93
1 jaar	1.61	0.99	-2.02	2022	-1.11	-3.55	-2.71	0.62
3 jr gean.	-1.66	2.15	0.75	2021	-0.71	-0.35	-0.49	0.12
5 jr gean.	-1.48	-0.14	-1.18	2020	-5.18	1.84	0.24	0.54

Portefeuille 30 nov 2023

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	86.82	3.04	83.78
Kas/ geldmarkt	74.91	60.93	13.99
Overig	2.33	0.10	2.24

Morningstar Vastrentende Style Box™																
<table border="1"><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td></td><td></td><td></td></tr></table>														Kredietkwaliteit	Tijdsduur	
Effectieve Looptijd	-															
Gem Krediet	-															
Kwaliteit																
Rentegevoeligheid																
Laag	Gem	Hoog														

Kredietkwaliteit	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
0% PIK				16.82
0% tot 4%				75.96
4% tot 6%				3.27
6% tot 8%				3.53
8% tot 10%				0.38
10% tot 12%				0.04
Meer dan 12%				0.01

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Italy (Republic Of) 1.75%2024-05-30	13.51
United States Treasury Notes...	12.04
Italy (Republic Of)2024-06-14	8.37
Italy (Republic Of)2024-01-12	5.10
UniCredit S.p.A.2026-09-22	4.38
Germany (Federal Republic Of)2024-06-19	4.18
Italy (Republic Of)2024-01-31	3.18
Caixabank S.A.2034-05-30	2.24
ING Groep N.V.2026-05-23	2.10
France (Republic Of)2024-07-10	2.09
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	71
% Van Vermogen In Top 10 Posities	57.18

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	26.94
3 tot 5 jaar	7.61
5 tot 7 jaar	3.71
7 tot 10 jaar	6.93
10 tot 15 jaar	2.74
15 tot 20 jaar	0.09
20 tot 30 jaar	4.68
Meer dan 30 jaar	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	Amundi Luxembourg S.A.	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+352 47 676667	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://first-eagle.am...	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	18 apr 2005	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	David Ric	ISIN	LU0210817440		
Aanvangsdatum	1 mei 2015				
Koers (23 apr 2024)	EUR 100.63				
Fondsvermogen (mln)	EUR 1.21				