

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

Morningstar Medalist Rating™

Neutral

Morningstar Categorie Index

Morningstar Global Core Bond
GR Hedged 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

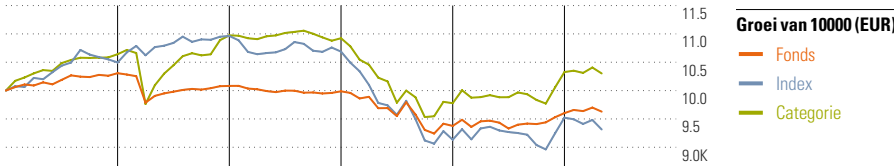
Beleggingsdoelstelling

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	0.34	Sharpe Ratio	-0.69
Beta	0.50	Std Deviatie	3.69
R-kwadraat	67.82	3-jr Risico	- gem
Informatie Ratio	0.88	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	3.61	10-jr Risico	- gem

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



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
Fonds	3.07	-2.18	-0.94	-6.12	2.42	0.27	Fonds
+/- Index	-1.89	-6.63	1.58	8.42	-1.85	2.45	+/- Index
+/- Categorie	-3.39	-5.35	-0.44	4.30	-3.31	0.49	+/- Categorie
Percentiel Score	64	63	58	20	90	41	Percentiel Score

Rendementen (2 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.06	0.96	0.24
6 Maanden	1.73	-1.45	-2.92
1 jaar	1.47	1.50	-2.29
3 jr gean.	-1.16	3.03	1.10
5 jr gean.	-1.00	0.65	-0.80

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.01	-	-	-
2023	0.86	-1.33	0.84	2.06
2022	-0.98	-3.42	-2.58	0.76
2021	-0.59	-0.23	-0.33	0.21
2020	-5.04	1.97	0.37	0.65

Portefeuille 31 dec 2023

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	74.52	1.99	72.53
Kas/ geldmarkt	94.20	69.11	25.09
Overig	2.52	0.15	2.38

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Tijdsduur			
Effectieve Looptijd			
Gem Krediet			
Kwaliteit			
Rentegevoeligheid			

Kredietkwaliteit

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
Italy (Republic Of) 1.75%2024-05-30	13.62
United States Treasury Notes...	12.01
Italy (Republic Of)2024-06-14	8.44
Italy (Republic Of)2024-01-12	4.71
UniCredit S.p.A.2026-09-22	4.42
Germany (Federal Republic Of)2024-06-19	4.22
Italy (Republic Of)2024-01-31	3.21
Caixabank S.A.2034-05-30	2.35
Saipem Finance International B.V...	2.13
ING Groep N.V.2026-05-23	2.13
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	64
% Van Vermogen In Top 10 Posities	57.23

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	30.53
3 tot 5 jaar	9.01
5 tot 7 jaar	4.44
7 tot 10 jaar	7.53
10 tot 15 jaar	3.31
15 tot 20 jaar	0.10
20 tot 30 jaar	5.58
Meer dan 30 jaar	0.01

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	19.51
0% tot 4%	72.70
4% tot 6%	3.08
6% tot 8%	4.20
8% tot 10%	0.45
10% tot 12%	0.04
Meer dan 12%	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	Amundi Luxembourg S.A.	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	500,000
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	LU0210817879		
Aanvangsdatum	1 mei 2015				
Koers (2 mei 2024)	EUR 1,104.27				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.02				