

BNP Paribas Flexi I US Mortgage Classic Capitalisation

Morningstar Medalist Rating™
Negative

Morningstar Categorie Index
Morningstar US Government
Bond TR USD

Benchmark van het fonds
Bloomberg US MBS TR USD

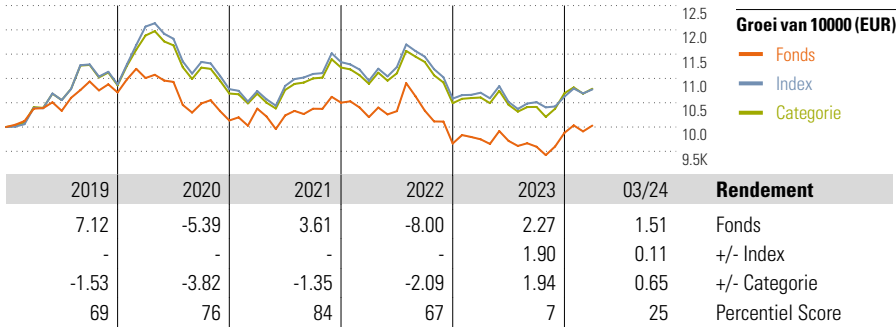
Morningstar Rating™
★★

Morningstar Categorie™
Obligaties USD Overheid

Wordt gebruikt in dit rapport als index

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	0.10	Sharpe Ratio	-0.30
Beta	1.22	Std Deviatie	7.06
R-kwadraat	88.36	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.40	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	3.00	10-jr Risico	Gem

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

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.85	-0.66	-0.27
6 Maanden	4.18	2.30	1.35
1 jaar	2.32	1.67	2.53
3 jr gean.	-1.07	-1.37	-0.49
5 jr gean.	-1.16	-1.59	-0.93

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.51	-	-	-
2023	0.90	-0.34	-1.23	2.98
2022	-2.82	1.20	0.10	-6.55
2021	2.41	-1.35	1.35	1.20
2020	2.77	-0.74	-4.05	-3.34

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	149.00	51.13	97.87
Kas/ geldmarkt	53.85	51.72	2.13
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	6.13
Kredietkwaliteit	Effectieve looptijd	10.11
	Gem Krediet	AA
	Kwaliteit	
Rentegevoeligheid		

Kredietkwaliteit	% Oblg		% Oblg
AAA	0.56	BBB	2.13
AA	92.49	BB	0.00
A	4.82	B	0.00
		Below B	0.00
		Geen Rating	0.00

Data per 29 feb 2024

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
Federal National Mortgage Association...	14.54
BNP Paribas InstiCash USD 1D LVNAV X Cap	4.20
Government National Mortgage Association.	3.53
Federal National Mortgage Association...	3.24
Government National Mortgage Association.	3.11
Federal National Mortgage Association...	3.10
Federal National Mortgage Association...	2.33
Government National Mortgage Association.	2.27
Government National Mortgage Association.	1.90
Federal National Mortgage Association...	1.85
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	197
% Van vermogen in top 10 posities	40.08

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	1.14
10 tot 15 jaar	6.27
15 tot 20 jaar	9.30
20 tot 30 jaar	81.75
Meer dan 30 jaar	0.48

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	0.03
0% tot 4%	63.94
4% tot 6%	27.09
6% tot 8%	8.24
8% tot 10%	0.70
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	BNP Paribas Asset...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	+352 2646 3017	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bnpparibas-am.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	0.90%
Oprichtingsdatum	25 sep 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Carey	ISIN	LU1080341065		
Aanvangsdatum	25 sep 2015				
Koers (26 apr 2024)	USD 1,564.23				
Fondsvermogen (mln)	USD 230.23				