

# Ostrum SRI Euro Sovereign Bonds RC

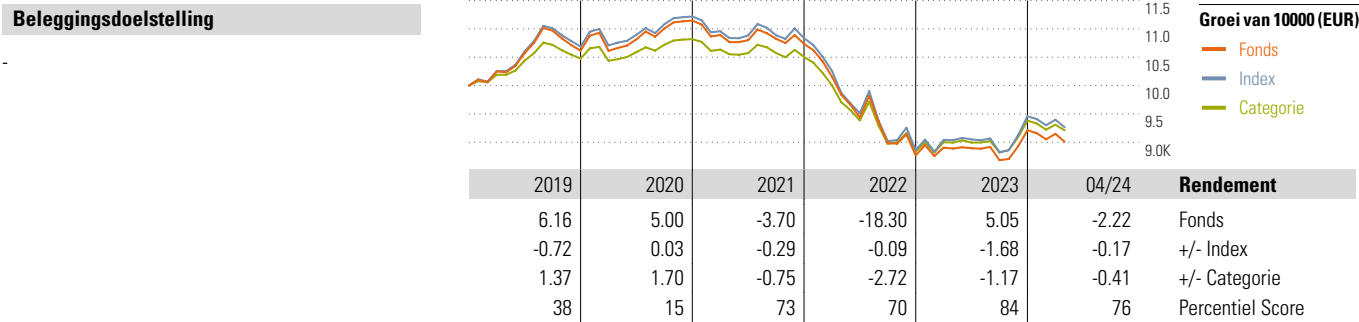
Morningstar Medalist Rating™  
**Neutral**

Morningstar Categorie Index  
Morningstar Eurozone Treasury  
Bond GR EUR  
  
Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds  
JPM EMU Global

Morningstar Rating™  
★★★

Morningstar Categorie™  
Obligaties Euro Overheid



| Risicomaatstaven |       |              |       | Rendementen (2 mei 2024) |       |        |       | Kwartaalrendementen |       |       |       |       |
|------------------|-------|--------------|-------|--------------------------|-------|--------|-------|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| Alpha            | -1.26 | Sharpe Ratio | -1.01 | 3 Maanden                | -0.83 | +/-Idx | 0.04  | 2024                | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
| Beta             | 0.92  | Std Deviatie | 7.06  | 6 Maanden                | 3.13  | -0.75  | -0.18 | 2023                | 1.54  | -0.11 | -2.36 | 6.09  |
| R-kwadraat       | 98.89 | 3-jr Risico  | Gem   | 1 jaar                   | 1.34  | -1.32  | -0.81 | 2022                | -5.36 | -7.12 | -4.81 | -2.37 |
| Informatie Ratio | -0.71 | 5-jr Risico  | Gem   | 3 jr gean.               | -5.69 | -0.71  | -1.21 | 2021                | -2.29 | -0.84 | 0.22  | -0.84 |
| Tracking Error   | 0.95  | 10-jr Risico | Gem   | 5 jr gean.               | -2.47 | -0.56  | -0.44 | 2020                | -0.03 | 1.92  | 1.76  | 1.27  |

Berekeningen met Morningstar EZN Trsy Bd GR EUR (waar van toepassing)

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

|                | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 99.10  | 0.07    | 99.04   |
| Kas/ geldmarkt | 1.01   | 0.05    | 0.96    |
| Overig         | 0.26   | 0.25    | 0.01    |

Morningstar Vastrentende Style Box™

Laag Gem Hoog

Rentegevoeligheid

Tijdsduur

Effectieve looptijd

Gem Krediet

Kwaliteit

7.50

9.39

BBB

Kredietkwalite it

% Oblg

% Oblg

AAA

14.47

BBB

21.83

AA

39.78

BB

0.00

A

19.19

B

0.00

Below B

0.00

Geen Rating

4.73

Data per

31 mrt 2024

Top 10 Onderliggende posities

|                                   | % Port |
|-----------------------------------|--------|
| Germany (Federal Republic Of)     | 1.3%   |
| France (Republic Of)              | 0%     |
| France (Republic Of)              | 0%     |
| France (Republic Of)              | 0.75%  |
| Italy (Republic Of)               | 4.1%   |
| Spain (Kingdom of)                | 3.5%   |
| Italy (Republic Of)               | 3.7%   |
| Spain (Kingdom of)                | 1.95%  |
| Italy (Republic Of)               | 3.8%   |
| Ireland (Republic Of)             | 1.35%  |
| Totaal Aantal Aandelen            | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties          | 86     |
| % Van vermogen in top 10 posities | 37.32  |

Maturity-verdeling

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 3.97   |
| 3 tot 5 jaar     | 28.61  |
| 5 tot 7 jaar     | 17.67  |
| 7 tot 10 jaar    | 12.72  |
| 10 tot 15 jaar   | 14.36  |
| 15 tot 20 jaar   | 5.77   |
| 20 tot 30 jaar   | 10.02  |
| Meer dan 30 jaar | 1.32   |

Couponverdeling

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 15.14  |
| 0% tot 4%    | 75.08  |
| 4% tot 6%    | 9.78   |
| 6% tot 8%    | 0.00   |
| 8% tot 10%   | 0.00   |
| 10% tot 12%  | 0.00   |
| Meer dan 12% | 0.00   |

| Fondsinformatie     |                       |                |              |                           |                 |
|---------------------|-----------------------|----------------|--------------|---------------------------|-----------------|
| Fondsgroep          | Natixis Investment... | Vestigingsland | Frankrijk    | Min Aanvangsbedrag        | 1/10000 Aandeel |
| Telefoon            | +33 1 78408000        | Fondsvaluta    | EUR          | Min Additioneel           | 1/10000 Aandeel |
| Website             | www.im.natixis.com    | UCITS          | ja           | Jaarlijkse Management Fee | 0.15%           |
| Oprichtingsdatum    | 30 dec 1993           | Inc/Acc        | Acc          |                           |                 |
| Fondsmanager        | Olivier de Larouzière | ISIN           | FR0000003196 |                           |                 |
| Aanvangsdatum       | 6 okt 2008            |                |              |                           |                 |
| Koers (2 mei 2024)  | EUR 478.22            |                |              |                           |                 |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 519.17            |                |              |                           |                 |