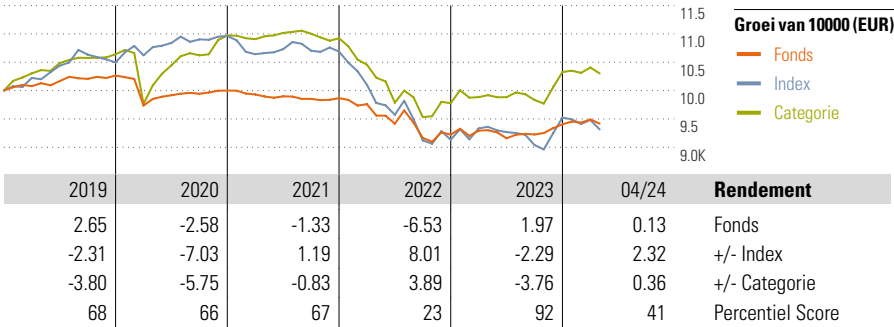


Amundi Funds - Global Macro Bonds & Currencies Low Vol AE-D

Morningstar Medalist Rating™ Negative	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	-0.09	Sharpe Ratio	-0.80
Beta	0.50	Std Deviatie	3.69
R-kwadraat	67.61	3-jr Risico	- gem
Informatie Ratio	0.76	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	3.62	10-jr Risico	- gem

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

Rendementen (30 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	-0.40	0.82	0.11	2024	0.91	-	-	-
6 Maanden	1.79	-1.53	-2.97	2023	0.76	-1.45	0.73	1.94
1 jaar	1.25	1.36	-2.39	2022	-1.08	-3.53	-2.68	0.64
3 jr gean.	-1.64	2.64	0.73	2021	-0.69	-0.33	-0.46	0.14
5 jr gean.	-1.45	0.25	-1.19	2020	-5.15	1.86	0.26	0.57

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™			Kredietkwaliteit	
	Laag	Gem	Hoog	Laag
	Rentegevoeligheid		Kredietkwaliteit	
			Tijdsduur	-
			Effectieve looptijd	-

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	-
Telefoon	+352 47 676667	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	https://first-eagle.am...	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	0.50%
Oprichtingsdatum	27 feb 2006	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	David Ric	ISIN	LU0244994728		
Aanvangsdatum	1 mei 2015				
Koers (30 apr 2024)	EUR 82.45				
Fondsvermogen (mln)	EUR 23.32				