

BNP Paribas Funds - Global Absolute Return Multi-Factor Bond Classic Cap

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The strategy implemented aims to beat the risk free rate over the medium term with a target volatility of 4.5% per annum through a market-neutral (Absolute Return) approach by exposing the sub-fund to the 10-year interest rates of high credit quality countries. The Investment Manager builds a portfolio of short-term fixed income instruments while taking a series of long/short positions on 10-year rates, as summed up below:

- 1) Core portfolio assets, in order to earn the risk free rate;
- 2) Overlay of long/short positions on 10-year government bond futures and interest rate swaps, in order to generate the absolute performance of the sub-fund;
- 3) Cash, for the purpose of margin calls management.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,94
3Y Beta	-	3Y Std Dev	4,54
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,58
6-Mesi	3,21
1-Anno	4,73
3-Anni Ann.ti	-2,69
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 06/06/2024

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	1,47	-	-	-
2023	2,04	-1,51	2,84	0,13
2022	-5,07	-2,19	-3,21	0,47
2021	-4,58	1,16	-0,52	-3,67

Portafoglio 30/04/2024



Asset Allocation %

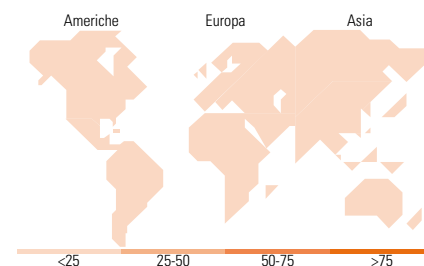
Azioni	0,00
Obbligazioni	35,35
Liquidità	64,65
Altro	0,00

Fixed Income

Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-



Titoli principali

Nome	Settore	%
Credit Agricole S.A. London...	-	8,65
Santander Consumer Finance,...	-	8,63
Mizuho Financial Group Inc....	-	8,55
BNP Paribas Mois ISR IC	-	8,46
Mitsubishi UFJ Financial...	-	5,17
Assicurazioni Generali...	-	3,58
Brambles Finance Ltd. 2.375%	-	3,53
Kraft Heinz Foods Company 1.5%	-	3,50
Goldman Sachs Group, Inc....	-	3,50
Credit Mutuel Arkea 1.25%	-	3,49
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		57,05
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		28

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	3,18
Societario	38,85
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	57,68
Derivati	0,29

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	0,18
Da 0 a 4 cedole	89,37
Da 4 a 6 cedole	10,45
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

Regione	Fondo
America	0,00
Stati Uniti	-
Canada	-
America Latina e Centrale	-
Europa	0,00
Regno Unito	-
Europa Occidentale - Euro	-
Europa Occidentale - Non Euro	-
Europa dell'Est	-
Africa	-
Medio Oriente	-
Asia	0,00
Giappone	-
Australasia	-
Asia - Paesi Sviluppatti	-
Asia - Emergente	-

Anagrafica

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	0,00 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 2646 3017	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bnpparibas-am.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	20/10/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,88%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	11/11/2020	ISIN	LU2155807337		
NAV (06/06/2024)	EUR 86,42				

BNP Paribas Funds - Global Absolute Return Multi-Factor Bond Classic Cap

Patrimonio Netto (Mln)

5,78 EUR

(30/04/2024)