Ficha a 31.12.2020

CANDRIAM
A NEW YORK LIFE INVESTMENTS COMPANY

# Candriam Bonds Total Return

## Clase: N (EUR)

www.candriam.com

## PERFIL DE RIESGO

Para entender completamente el perfil de riesgo del fondo, le aconsejamos a los inversores a revisar atentamente el folleto oficial y la descripción de los riesgos subyacentes. El valor de la inversión puede declinar debido en particular a los siguientes riesgos: Riesgo de crédito, Riesgo tipos de interés, Riesgo de Divisas, Riesgos vinculados con los países emergentes, Riesgo Convertible Equidad, riesgo de liquidez y de Riesgo de contraparte.

## DATOS ESTATÍSTICOS

| | Fondo |
|---|---|
| Yield to Worst (%) | 0.87 |
| MD to worst | 1.65 |
| Duration spread | 2.77 |
| Credit exposure ** (%) | 48.12 |
| Medio rating | A- |
| Exposición acciónes (%) | 3.26 |
| Var (99% / 1 day) (%) | 0.40 |
| Var (99% / 20 dias) (%) | 1.78 |

** Emisores corporativos y financieros y derivados de crédito netas

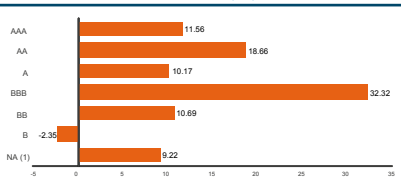
## PERFORMANCE IN EUR (%)

| Rentabilidad acumulada | Fondo | Índice |
|---|---|---|
| 1 mes | 0.32 | 0.13 |
| 3 meses | 0.83 | 0.39 |
| 6 meses | 1.64 | 0.79 |
| YTD | 1.29 | 1.58 |
| 1 año | 1.29 | 1.58 |
| 3 años | -1.13 | 4.99 |
| 5 años | -1.04 | 8.58 |
| Lanzamiento | 26.84 | - |

| Rentabilidad anualizado | Fondo |
|---|---|
| 1 año | 1.29 |
| 3 años | -0.38 |
| 5 años | -0.21 |
| Lanzamiento | 1.69 |

| Drawdown | Fondo |
|---|---|
| Largest 3 Year rolling day-to-day Drawdown | -7.67 |
| Fecha de NAV más alto | 29/01/2018 |
| Fecha de NAV inferior | 19/03/2020 |
| Fecha de "recovery" | - |
| Plazo de recuperación (días) | - |

## DESGLOSE POR RATING* (%)




(1) Instrumentos NR, derivados sin crédito y cash disponible.
* La « 2nd Best » nota se calcula diariamente en base al instrumento. Se utiliza la nota de tres agencias de calificación crediticia de renombre internacional.

## OBJETIVO Y POLÍTICA DE INVERSIÓN

Candriam Bonds Total Return ofrece una cartera de renta fija muy diversificada, con un enfoque flexible y el propósito de generar un retorno positivo en un horizonte de inversión de tres años renovables. El fondo invierte fundamentalmente en una extensa variedad de mercados: mercados monetarios, renta gubernamental, bonos ligados a la inflación, renta corporativa de grado de inversión, renta fija de alto rendimiento (máx. 40%), mercados emergentes en divisa dura y divisa local (máx. 40%), bonos convertibles (máx. 25%). La exposición total a bonos convertibles, mercados emergentes y renta fija con nota inferior a BBB-/Baa3 no puede superar el 60%, mientras que la duración general puede variar de -5 a +10 años (aunque los límites que se aplican a nivel interno son -4/+8 años). El fondo puede usar derivados.

ÍNDICE DE REFERENCIA : EONIA + 200BP P.A. (CAPITALIZADO) CON UN HORIZONTE DE INVERSIÓN DE MÍNIMO 3 AÑOS

**El índice de referencia se indica por motivos puramente informativos, el proceso de inversión no consiste en replicarlo**

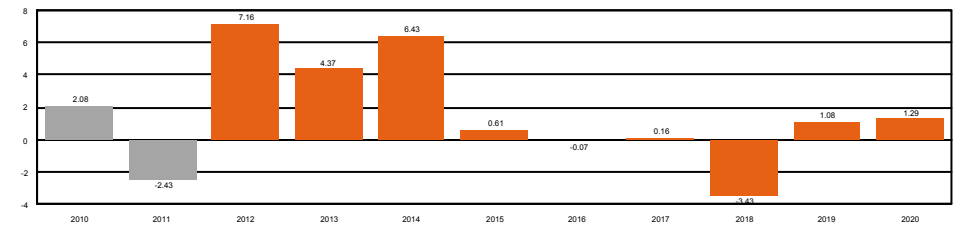
## RESULTADOS MOSTRADOS IN EUR

Los resultados mostrados en esta página no constituyen un indicador fiable para resultados futuros y no son constantes en el tiempo. Los valores liquidativos de los activos son facilitados por la contabilidad y por los índices de los proveedores de datos oficiales. Resultados de actuaciones acumuladas sobre la base de cálculo anual de gastos e impuestos.

**Año de introducción de la cuota : 2006**

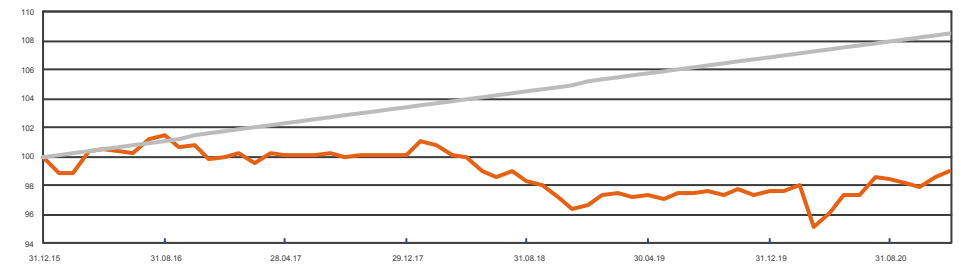
**Moneda : EUR**

### Año calendario de retorno (%)




Requisitos de rendimiento alcanzados en virtud del número que se aplican falda; El proceso de inversión han cambiado desde septiembre de 2011.

### RENTABILIDAD DESDE 5 AÑOS EN EUR (%)




## ASIGNACIÓN DE ACTIVOS (%)

| | Mercados Desarrollados | | Mercados Emergentes | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Inv. Grade | High Yield | Inv. Grade | High Yield | Otro(1) | Total |
| Soberano | 15.14 | - | 9.58 | 1.05 | - | 25.77 |
| Inflation-Linked | - | - | - | - | - | 0.00 |
| Corporate: Financials | 15.37 | 0.70 | 0.11 | 0.02 | - | 16.21 |
| Corporate: Non-financials | 14.31 | 21.23 | 0.35 | 0.26 | - | 36.14 |
| Credit derivatives | 5.07 | -9.09 | -4.72 | -1.58 | - | -10.32 |
| IR derivatives (Duration & Yield Curve management) | -27.63 | - | - | - | 0.22 | -27.41 |
| Convertibles | 4.17 | 1.92 | - | - | - | 6.09 |
| Derivativos renta variable (delta hedging of convertibles) | - | - | - | - | - | 0.00 |
| Cash nocional (en compensación de derivados) | - | - | - | - | 37.46 | 37.46 |
| Instrumentos a corto plazo (2) | - | - | - | - | - | 0.00 |
| Instrum.monet.& otros (3) | - | - | - | - | 16.05 | 16.05 |
| Grand Total | 26.44 | 14.75 | 5.32 | -0.24 | 53.74 | 100.00 |

(1) Instrumentos NR, derivados sin crédito, cash disponible y nocional Cash, en compensación de derivados.
(2) Fondo Money Market, Certificate of Deposit, Commercial Paper, Treasury Bill, Asset Backed Commercial Paper & Floating Rate Notes (<2 años).
(3) Dinero en efectivo + efectivo disponible bloqueados como deposite para derivados + net P / L para derivados

**FOR PROFESSIONAL INVESTORS ONLY**

En caso de que los resultados se expresen en una divisa diferente a la del país de residencia del inversor, los beneficios mencionados pueden aumentar o disminuir como resultado de la fluctuación monetaria. Candriam recomienda a los inversores que consulten, a través de nuestra web www.candriam.com, los datos fundamentales para el inversor, los folletos informativos y cualquier otra información relevante antes de invertir en uno de nuestros fondos, incluido el valor liquidativo neto ("VL" o NAV" en sus siglas en inglés) de los mismos. Esta información está disponible en inglés y en un idioma nacional de cada país donde el fondo está autorizado para su comercialización.

CANDRIAM
A NEW YORK LIFE INVESTMENTS COMPANY

# Candriam Bonds Total Return

## Clase: N (EUR)

www.candriam.com

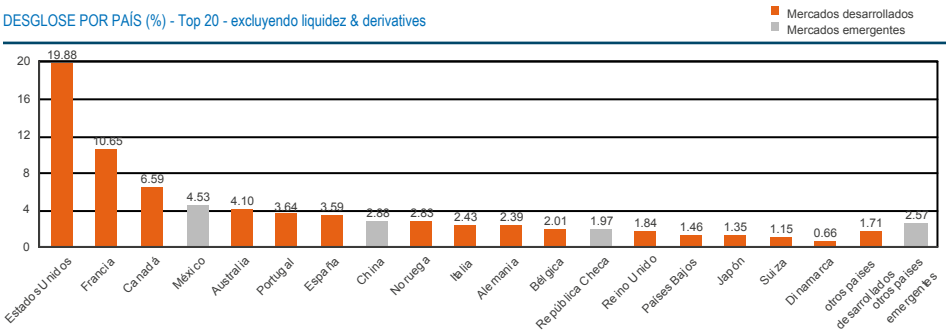
## CARACTERÍSTICAS

| | | |
|---|---|---|
| Fecha de emisión | | 07.11.2006 |
| Forma legal | | Sicav de derecho luxemburgés con múltiples compartimentos |
| Comisión de gestión (max. en %) | | 1.30 |
| Clase de acción | | Cap |
| Patrimonio (M EUR) | | 1076.55 |
| VL por acción cap. (EUR) | | 126.84 |
| Moneda de valoración | | EUR |
| Valoración | | diario (D) |
| ISIN Code | C | LU0252131148 |
| Ticker Bloomberg | C | DEXTRUN LX Equity |
| Número CNMV | C | 266 |

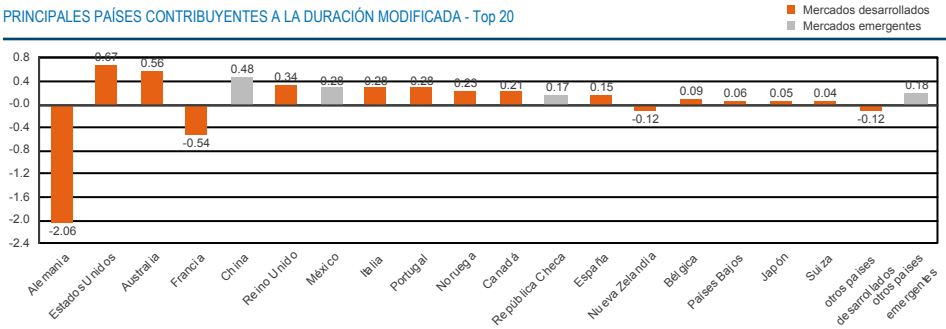
## INFORMACIONES PRÁCTICAS

| | |
|---|---|
| Hora de corte | D antes 12h |
| Fecha de suscripción | D+3 |
| Fecha de reembolso | D+3 |

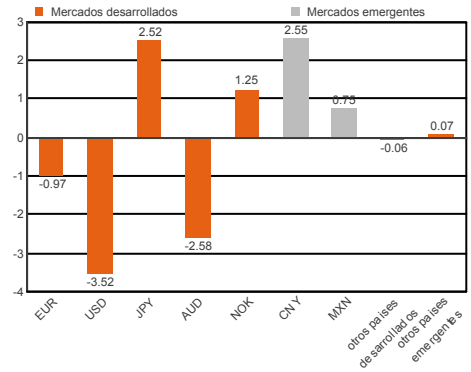
DESGLOSE POR PAÍS (%) - Top 20 - excluyendo liquidez & derivatives



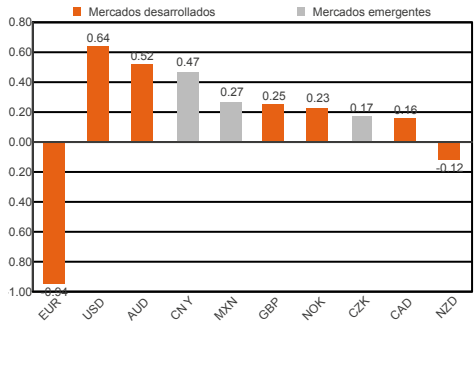

PRINCIPALES PAÍSES CONTRIBUYENTES A LA DURACIÓN MODIFICADA - Top 20




DIVISA : desvicion por divisa frente a 100% EUR




CONTRIBUCIÓN A LA DURACIÓN MODIFICADA POR DIVISA




10 PRINCIPALES EMISORES (%)- excluyendo fondos

| Titulo | Peso |
|---|---|
| CANADA | 5.19 |
| UNITED MEXICAN STATES | 4.39 |
| COMMONWEALTH OF AUSTRALIA | 3.53 |
| PORTUGUESE REPUBLIC | 3.05 |
| KINGDOM OF NORWAY | 2.83 |
| CZECH REPUBLIC | 1.97 |
| TELEFONICA SA | 0.97 |
| GROUPE CREDIT MUTUEL | 0.89 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC | 0.82 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | 0.81 |

FOR PROFESSIONAL INVESTORS ONLY

Este documento se ofrece únicamente a título informativo. No constituye una oferta para comprar o vender instrumentos financieros. No se trata tampoco de una recomendación de inversión, ni confirma ningún tipo de transacción, excepto las que se acuerden expresamente. A pesar de que Candriam selecciona cuidadosamente los datos y las fuentes de este documento, no se puede excluir a priori la existencia de algún error u omisión. Candriam no se hace responsable de ninguna pérdida directa o indirecta como resultado del uso de este documento. Los derechos de propiedad intelectual de Candriam se deben respetar en todo momento, no pudiéndose reproducir el contenido del documento sin una autorización previa por escrito.