

ALLOCATION PAR PAYS (%)

	Fonds
Etats-Unis	23,2
Royaume-Uni	22,5
France	8,7
Luxembourg	5,1
Netherlands (the)	4,9
Norvège	4,1
Italie	4,1
Allemagne	3,8
Espagne	2,6
Suède	1,7
Slovenia	1,5
Autriche	1,3
Israël	1,2
Tanzania, United Republic of	1,1
Autres	14,2

CARACTÉRISTIQUES DU PORTEFEUILLE

	Fonds
Échéance finale moyenne (années)	3,46
Echéance moyenne anticipée (années)	2,52
Rendement moyen à échéance (USD) %	6,61
Rendement moyen jusqu'à la date de rachat anticipée (USD) %	6,65
Rendement moyen jusqu'à échéance finale (EUR couvert) %	4,91
Rendement moyen jusqu'à la date de rachat anticipée (EUR couvert) %	5,03
Duration ajustée en fonction de l'option (années)	1,65
Duration du spread ajustée de l'option (années)	1,86

ALLOCATION PAR SECTEUR (%)

	Fonds
Télécoms	16,2
Bâtiment et construction	13,5
Services commerciaux	11,7
Énergie – pétrole et gaz	7,7
Alimentation et boissons	7,5
Fabrication d'automobiles, de pièces et d'équipements	6,8
Transports	6,6
Hôtels, jeux et loisirs	6,4
Santé & Pharmaceutiques	6,3
Produits chimiques	4,6
Papier, emballage et contenants	4,5
Distribution	2,9
Banques, assurances et immobiliers	2,3
Matériaux de bases & Exploitation minière	1,1
Autres	1,9

5 PRINCIPAUX ÉMETTEURS

Emetteur	(%)
Axalta Coating Systems	1,83
CPUK Finance Ltd	1,73
Sirius Xm Radio Llc	1,59
Tk Elevator Us Newco Inc	1,57
Trivium Packaging Fin	1,53

STATISTIQUES HISTORIQUES DU FONDS SUR 3 ANS

Ratio de Sharpe annualisé	2,27
Ecart type annualisé	1,93

RÉPARTITION PAR NOTATION (%)

	Fonds
A	0,2
BBB	1,7
BB	49,9
B	39,3
CCC	3,7
Liquidités et autres	5,2

RÉPARTITION DES POSITIONS PAR DEVISE (%)*

	Fonds
EUR	43,8
USD	38,6
GBP	17,3
NOK	0,3

*Toutes les devises sont couvertes contre la devise de base du fonds, qui est l'USD.

Source : BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

