

# ABN AMRO ESG Profielfonds Matig Offensief

een subfonds van ABN AMRO Funds

Morningstar categorie : Mixfondsen EUR Neutraal - Wereldwijd ★★☆☆

Morningstar-duurzaamheidsclassificatie : 

## Belangrijke informatie

|                                   |                                        |
|-----------------------------------|----------------------------------------|
| ► Koers (NIW)                     | EUR 210,955                            |
| ► Grootte fonds                   | EUR 871 miljoen                        |
| ► ISIN code                       | LU0121970809                           |
| ► Duratie                         | 3,86                                   |
| ► Gemiddelde kredietrating        | A                                      |
| ► Rendement tot vervaldatum (YTM) | 3,63                                   |
| ► SFDR Classificatie:             | Art. 8 – ESG-conform beleggingsproduct |

## Fondsprofiel

► **Strategie:** Het subfonds is een 'matig offensief' beleggingsfonds dat toegang biedt tot een optimaal gespreide portefeuille die bestaat uit een mix van vermogenscategorieën zoals aandelen, obligaties, alternatieve beleggingen en korte termijn schuldeffecten (liquiditeiten). Het is een actief beheerd fonds dat de meest aantrekkelijke, zorgvuldig geselecteerde beleggingsstrategieën van wereldwijd vooraanstaande vermogensbeheerders combineert.

Het subfonds promoot milieu en maatschappelijke kenmerken en komt in aanmerking als een beleggingsproduct dat valt onder artikel 8(1) van Verordening (EU) 2019/2088 betreffende informatieverstrekking over duurzaamheid in de financiële dienstensector. In dat opzicht wordt het beleggingsuniversum bepaald door onder andere uitsluitingsfilters en een 'best-in-class' -benadering of selectiviteit.

► **Doelstelling:** ABN AMRO Profielfonds 4 streeft ernaar op de middellange tot lange termijn beter te presteren dan zijn samengestelde benchmark 55% (50% MSCI Europe + 40% MSCI World ex Europe + 10% MSCI Emerging Markets) + 5% Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate EUR hedged + 2,5% JP Morgan EMBI EUR Hedged + 2,5% JP Morgan CEMBI EUR Hedged + 25% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index 1-10 years + 10% Euribor 1m Capitalized.

## Portfolio Manager(s)

|                                                         |             |
|---------------------------------------------------------|-------------|
| <b>Kevin Sorel</b>                                      |             |
| <b>Ervaring in de industrie sinds</b>                   | <b>2006</b> |
| <b>Werkzaam bij ABN AMRO Investment Solutions sinds</b> | <b>2007</b> |

## Fondsgegevens

|                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|---------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Aandelenklasse            | Klasse A                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| Oprichtingsdatum          | 11/06/2001                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| Rechtsvorm                | Luxemburgse SICAV                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| Type deelbewijs           | Kapitalisatie                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| Benchmark                 | 55% (50% MSCI Europe + 40% MSCI World ex Europe + 10% MSCI Emerging Markets) + 5% Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate EUR hedged + 2,5% JP Morgan EMBI EUR Hedged + 2,5% JP Morgan CEMBI EUR Hedged + 25% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index 1-10 years + 10% Euribor 1m Capitalized |
| Referentiemunt            | EUR                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| Koersfrequentie           | Dagelijks                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| Betaalagent               | State Street Bank Luxembourg                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| Administrateur            | State Street Bank Luxembourg                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| Maximale beheervergoeding | 0,80%                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Lopende kosten            | 0,89%                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Max. toetredingskosten    | 5,00%                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Max. uittredingskosten    | 1,00%                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| Minimale inleg            | EUR 100                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| Cut-off tijd              | 16:00 CET, D-1                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| Bloomberg ticker          | AAMDVPA:LX                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

## Rendement\*



|              | Fonds   | Benchmark | Relatief rendement |
|--------------|---------|-----------|--------------------|
| 1 mnd        | 3,82%   | 4,00%     | -0,18%             |
| 3 mnd        | 4,14%   | 3,87%     | 0,27%              |
| YTD          | 3,82%   | 4,00%     | -0,18%             |
| 1 jaar       | -7,22%  | -4,68%    | -2,54%             |
| 3 jaars      | 4,37%   | 9,35%     | -4,99%             |
| 5 jaars      | 11,50%  | 23,08%    | -11,58%            |
| Sinds 2011** | 86,98%  | 112,27%   | -25,29%            |
| 2022         | -13,48% | -10,39%   | -3,10%             |
| 2021         | 13,09%  | 13,37%    | -0,29%             |
| 2020         | 2,07%   | 3,55%     | -1,48%             |
| 2019         | 16,63%  | 16,63%    | 0,00%              |
| 2018         | -6,96%  | -3,15%    | -3,82%             |

\*\* De huidige beleggingsstrategie op zijn plaats is sinds 17 mei 2010

\* In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. Het rendement van het fonds is berekend na aftrek van kosten, met uitzondering van de toetredingskosten.

## Risico statistieken

|                | Fonds  |         | Benchmark |         |
|----------------|--------|---------|-----------|---------|
|                | 1 jaar | 3 jaars | 1 jaar    | 3 jaars |
| Volatiliteit   | 10,13% | 12,82%  | 9,71%     | 11,36%  |
| Tracking error | 1,70%  | 2,50%   | -         | -       |
| Sharpe Ratio   | -0,73  | 0,13    | -0,51     | 0,28    |

**Volatiliteit** is een statistische maatstaf voor de spreiding van de rendementen van een portefeuille of een marktindex. In de meeste gevallen geldt: hoe hoger de volatiliteit, hoe risicovoller.

**Tracking Error** is de standaardafwijking van het verschil tussen het rendement van de portefeuille en het gewenste rendement van de beleggingsbenchmark.

**Sharpe Ratio** is een ratio dat wordt gebruikt om de voor risico's gecorrigeerde performance te meten. Het wordt berekend door het rendement van een portefeuille te verminderen met het risicovrije percentage en het resultaat hiervan te delen door de standaarddeviatie van de portefeuillerendementen.



| Asset mix (%) |        |           | Top 10 posities (%)                   |       | Valuta (%)       |        |           |
|---------------|--------|-----------|---------------------------------------|-------|------------------|--------|-----------|
|               | Fonds  | Benchmark |                                       | %     |                  | Fonds  | Benchmark |
| Aandelen      | 49,15% | 55,00%    | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.01% 3...   | 1,02% | EUR EURO         | 57,40% | 58,98%    |
| Obligaties    | 36,42% | 35,00%    | MICROSOFT CORP                        | 0,95% | USD USA DOLLAR   | 26,59% | 18,74%    |
| Liquiditeiten | 14,43% | 10,00%    | GERMANY (FEDERAL REPUBLIC)            | 0,82% | GBP GB POUND     | 5,18%  | 6,51%     |
|               |        |           | FRANCE (REPUBLIC OF)                  | 0,71% | CHF CHE FRANC    | 2,62%  | 4,11%     |
|               |        |           | FRANCE (REPUBLIC OF) 0.5 25/05/2025   | 0,64% | JPY JAPANESE YEN | 1,42%  | 1,68%     |
|               |        |           | APPLE INC                             | 0,61% | Overige          | 6,79%  | 9,98%     |
|               |        |           | NESTLE                                | 0,60% |                  |        |           |
|               |        |           | GERMANY (FEDERAL REPUBLIC) 0.000% ... | 0,55% |                  |        |           |
|               |        |           | PRUDENTIAL PLC                        | 0,55% |                  |        |           |
|               |        |           | ALPHABET INC                          | 0,54% |                  |        |           |
|               |        |           | Top 10 totaal                         | 6,98% |                  |        |           |

| Aandelen   Sectors (%)             |        |           | Aandelen   Landen (%) |        |           | Aandelen   Kapitalisatie (%) |        |           |
|------------------------------------|--------|-----------|-----------------------|--------|-----------|------------------------------|--------|-----------|
|                                    | Fonds  | Benchmark |                       | Fonds  | Benchmark |                              | Fonds  | Benchmark |
| Informatietechnologie              | 18,92% | 15,16%    | Verenigde Staten      | 35,24% | 32,66%    | Micro cap (<0.5Mld. €)       | 0,18%  | 0,02%     |
| Financiële Dienstverlening         | 17,48% | 16,38%    | Verenigd Koninkrijk   | 12,04% | 11,13%    | Small cap (0.5 tot 2Mld. €)  | 1,81%  | 0,04%     |
| Industrie                          | 13,81% | 11,66%    | Frankrijk             | 8,90%  | 9,05%     | Mid cap (2 tot 5Mld. €)      | 6,16%  | 1,53%     |
| Gezondheidszorg                    | 12,85% | 13,22%    | Duitsland             | 6,83%  | 6,38%     | Large cap (5 tot 20Mld. €)   | 21,40% | 17,83%    |
| Cyclische Consumentengoederen      | 10,59% | 11,18%    | Zwitserland           | 5,80%  | 8,27%     | Mega cap (>20Mld. €)         | 70,45% | 80,58%    |
| Niet-Cyclische Consumentengoederen | 7,82%  | 9,44%     | Nederland             | 3,61%  | 3,79%     |                              |        |           |
| Materialen                         | 6,51%  | 6,22%     | Italië                | 3,00%  | 1,58%     |                              |        |           |
| Communicatiediensten               | 5,99%  | 5,70%     | Japan                 | 2,86%  | 3,06%     |                              |        |           |
| Vastgoed                           | 2,46%  | 1,90%     | Spanje                | 2,48%  | 1,95%     |                              |        |           |
| Energie                            | 1,97%  | 5,69%     | China                 | 2,04%  | 3,11%     |                              |        |           |
| Nutsbedrijven                      | 1,31%  | 3,45%     | Overige               | 17,21% | 19,02%    |                              |        |           |
| Fondsen                            | 0,30%  | 0,00%     |                       |        |           |                              |        |           |

| Obligaties   Sectors (%) |        |           | Obligaties   Landen (%) |        |           | Obligaties   Ratings (%) |        |           |
|--------------------------|--------|-----------|-------------------------|--------|-----------|--------------------------|--------|-----------|
|                          | Fonds  | Benchmark |                         | Fonds  | Benchmark |                          | Fonds  | Benchmark |
| Schatkistobligaties      | 52,11% | 36,60%    | Duitsland               | 20,18% | 14,37%    | AAA                      | 23,33% | 18,19%    |
| agentschappen            | 2,87%  | 7,72%     | Frankrijk               | 15,99% | 16,33%    | AA                       | 15,75% | 20,04%    |
| Lokale autoriteiten      | 0,28%  | 2,62%     | Italië                  | 10,72% | 9,99%     | A                        | 10,64% | 10,86%    |
| Soeverein                | 7,92%  | 6,77%     | Spanje                  | 9,85%  | 7,58%     | BBB                      | 17,52% | 22,24%    |
| Supranationaal           | 3,41%  | 3,82%     | Verenigde Staten        | 7,14%  | 11,03%    | BB                       | 12,37% | 10,60%    |
| Industrieel              | 14,13% | 22,79%    | Supranationaal          | 3,23%  | 3,16%     | B                        | 3,39%  | 7,48%     |
| Nutsbedrijven            | 2,13%  | 2,08%     | Verenigd Koninkrijk     | 2,99%  | 2,45%     | CCC                      | 0,59%  | 1,83%     |
| Financiële instellingen  | 11,99% | 11,04%    | Nederland               | 2,73%  | 4,11%     | CC                       | 0,13%  | 0,17%     |
| ABS                      | 0,00%  | 0,01%     | Canada                  | 2,54%  | 1,49%     | C                        | 0,00%  | 0,02%     |
| CMBS                     | 0,00%  | 0,00%     | Mexico                  | 2,12%  | 0,80%     | D                        | 0,00%  | 0,09%     |
| Gedekte obligaties       | 3,09%  | 5,50%     | Overige                 | 22,50% | 28,70%    | Niet beoordeeld          | 0,71%  | 0,19%     |
| Niet geclassificeerd     | 2,06%  | 1,05%     |                         |        |           | Niet beschikbaar         | 15,57% | 8,28%     |

Waarschuwing

Niet bindend document.  
Dit document wordt ter informatie verstrekt en vormt in geen geval een voorstel of aanbeveling om financiële instrumenten te kopen of te verkopen. U dient zelf na te gaan of de wetgeving die op u van toepassing is u niet verbiedt om het product te kopen/te verkopen en/of te verhandelen en of de belegging afgestemd is op uw doelstellingen en op uw eigen wettelijke en fiscale situatie. Deze ICB biedt geen enkele garantie. Schommelingen van de wisselkoersen kunnen de waarde van uw belegging positief of negatief beïnvloeden. Voor een gedetailleerde beschrijving van de risico's van het product, bevelen wij u aan het hoofdstuk "risicoprofiel" van het prospectus te raadplegen. Voorafgaand aan iedere inschrijving op deze ICB dient men kennis genomen te hebben van het van kracht zijnde prospectus, dat op aanvraag beschikbaar is bij ABN AMRO Investment Solutions of op de website [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com). ABN AMRO Investment Solutions, portefeuillebeheervennootschap, erkend door de Autorité des Marchés Financiers (AMF) onder het nummer GP 99-27. Naamloze vennootschap met Directie en Raad van Toezicht met een kapitaal van 4.324.048 euro. Hoofdkantoor: 3, avenue Hoche 75008 Parijs, Frankrijk.  
De toegang tot de producten en diensten kan voor bepaalde personen of in bepaalde landen onderworpen zijn aan beperkingen. Neem voor nadere inlichtingen contact op met uw gebruikelijke adviseur. Sterren toegekend door Morningstar Inc, alle rechten voorbehouden. Notation Overall per vorige maand ultimo. **Bron: ABN AMRO Investment Solutions, State Street.**  
© 2022 Morningstar. Alle rechten voorbehouden. De hierin opgenomen informatie: (1) behoort toe aan Morningstar en/of zijn contentaanbieders; (2) mag niet worden vernoemd of verspreid; en (3) wordt niet gegarandeerd als zijnde juist, volledig of actueel. Noch Morningstar noch zijn contentaanbieders zijn verantwoordelijk voor eventuele schade of verliezen die uit het gebruik van deze informatie voortvloeien. Resultaten uit het verleden bieden geen garantie voor de toekomst. Star Rating per 30/12/2022. Sustainability Rating per 30/11/2022.

| Obligaties   Duraties (%) |        |           |
|---------------------------|--------|-----------|
|                           | Fonds  | Benchmark |
| <1 jaar                   | 12,28% | 8,34%     |
| 1-3 jaar                  | 27,02% | 29,80%    |
| 3-5 jaar                  | 23,82% | 25,02%    |
| 5-7 jaar                  | 10,37% | 16,56%    |
| 7-10 jaar                 | 15,47% | 16,43%    |
| 10-15 jaar                | 3,99%  | 0,82%     |
| >15 jaar                  | 7,06%  | 3,02%     |