

Robeco QI Emerging Markets Active Equities D USD

Gestore del fondo
Indice

Wilma de Groot, Tim Dröge, Han van der Boon, Daniel Haesen, Jan Sytze Mosselaar since: 29-01-2008
MSCI Emerging Markets Index (Net Return, USD)

Politica d'investimento

Robeco QI Emerging Markets Active Equities è un fondo a gestione attiva che investe in azioni di società dei mercati emergenti. La selezione di tali azioni si basa su un modello quantitativo. Obiettivo del fondo è ottenere regolarmente rendimenti migliori rispetto al benchmark. Il fondo si avvale di una strategia quantitativa di selezione dei titoli che classifica le azioni in base alla loro prevista performance relativa futura utilizzando molteplici fattori: value, qualità, momentum, revisioni degli analisti e segnali a breve termine. Le azioni con rating elevato sono sovrappesate rispetto al Benchmark e quelle con rating inferiore sono sottopesate, ottenendo un portafoglio ben diversificato.

General Facts

Morningstar	★★★★★
Tipologia di fondo	Azionario
Valuta	USD
Dimensione del fondo	USD 5.732.785,615
Dimensione della classe di azioni	USD 47.528,917
Azioni in circolazione	217.909
Data prima NAV	29-11-2010
Chiusura anno finanziario	31-12
Negoziabile giornalmente	Si
Dividendo pagato	No
Ex-ante tracking error limit	6,00%
Management company	Robeco Institutional Asset Management B.V.

Rendimenti

Valore di riferimento (until 31-12-2025) - Fonte: Robeco


Rendimenti

	Fondo	Indice
1 m	3,12%	2,99%
3 m	3,53%	4,73%
YTD	30,93%	33,57%
1 Anno	30,93%	33,57%
2 Anni	21,30%	19,83%
3 Anni	20,68%	16,40%
5 Anni	8,88%	4,20%
10 Anni	10,69%	8,42%
Since 11-2010	5,30%	4,24%
Annualizzati (per periodi superiori ad un anno)		

Sector Allocation

	Fondo	Indice
Tecnologia informatica	29,9%	28,3%
Finanziari	22,3%	22,3%
Beni discrezionali	11,0%	11,7%
Servizi di comunicazione	10,6%	9,3%
Industriali	8,4%	7,0%
Materie prime	6,8%	7,1%
Assistenza sanitaria	5,0%	3,1%
Energia	2,1%	3,9%
Prodotti di consumo di prima necessità	1,5%	3,7%
Servizi pubblici	1,4%	2,3%
Beni immobili (Real estate)	0,9%	1,3%

Country Allocation

	Fondo	Indice
Cina	27,8%	27,6%
Taiwan	19,0%	20,6%
Corea del Sud	15,1%	13,3%
India	14,0%	15,3%
Brasile	4,9%	4,3%
Arabia Saudita	3,7%	2,9%
Tailandia	2,8%	1,0%
Messico	2,2%	1,9%
Sud Africa	2,0%	3,8%
Turchia	1,6%	0,4%
Grecia	1,4%	0,6%
Malesia	1,2%	1,2%
Altro	4,3%	7,0%

Ripartizione per asset class

Equity	99,9%
Liquidità	0,1%

Costi del fondo

Spese correnti	1,52%
Commissioni di gestione	1,25%
Commissioni di performance	Nessuna
Commissioni amministrative	0,20%

Esposizione in portafoglio delle top 10/20/30

TOP 10	29,26%
TOP 20	35,60%
TOP 30	40,98%

Robeco QI Emerging Markets Active Equities

Le prime 10 posizioni per dimensioni Class D USD

Posizioni

Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Lt	
Tencent Holdings Ltd	
Samsung Electronics Co Ltd	
SK Hynix Inc	
Alibaba Group Holding Ltd	
China Construction Bank Corp	
Delta Electronics Inc	
Infosys Ltd ADR	
Vale SA ADR	
NetEase Inc	
Total	29,26

Statistiche del fondo

Ex-Post Tracking Error (%)	3 Anni	5 Anni
Information ratio	3,18	3,44
Indice di Sharpe	1,98	1,84
Alpha (%)	1,40	0,48
Beta	6,41	6,13
Standard deviation	12,75	14,99
Utile mensile max. (%)	8,87	14,14
Perdita mensile max. (%)	-4,51	-11,64

I summenzionati indici si basano su rendimenti al lordo delle commissioni.

Hit ratio

Rendimenti superiori alle aspettative (mesi)	3 Anni	5 Anni
Hit ratio (%)	25	43
Mercato al rialzo (mesi)	69,4	71,7
Rendimenti superiori alle aspettative - Mercato al rialzo (mesi)	25	36
Hit ratio - in condizioni di mercato rialzista (%)	15	21
Mercato al ribasso (mesi)	60,0	58,3
Months Outperformance Bear	11	24
Hit ratio - in condizioni di mercato ribassista (%)	10	22

I summenzionati indici si basano su rendimenti al lordo delle commissioni.

Morningstar

Copyright © Morningstar Benelux. Tutti i diritti riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono di proprietà esclusiva di Morningstar e/o dei relativi fornitori di contenuti; (2) non possono essere copiate né distribuite; e (3) non è garantito che siano esatte, complete o tempestive. Né Morningstar né i suoi fornitori di contenuti sono responsabili per alcun danno o perdita derivanti dall'utilizzo di dette informazioni. I rendimenti passati non sono indicativi dei possibili risultati futuri. Per ulteriori informazioni su Morningstar, vogliate consultare il sito www.morningstar.com.

Disclaimer

Prima della sottoscrizione, leggere il Prospetto ed il PRIIPS (documento contenente le informazioni chiave), che illustrano i rischi di investimento associati a questo fondo. Le informazioni contenute in questo documento non costituiscono un'offerta o una sollecitazione di offerta per l'acquisto di azioni del fondo. Gli acquisti relativi al fondo devono basarsi sul PRIIPS in italiano e sul Prospetto vigente. Copie gratuite dello Statuto, del Prospetto, dei PRIIPS e delle Relazioni annuali e semestrali sono disponibili presso i distributori incaricati e sul sito www.robeco.it. Le informazioni qui contenute non intendono sostituire una consulenza indipendente. Il valore degli investimenti è variabile. Le performance del passato non garantiscono in alcun modo i risultati futuri e sono indicate al lordo di commissioni e di tasse sui capital gains. Questo documento è pubblicato da Robeco Capital Growth Funds Sicav, società disciplinata ed autorizzata secondo la legge lussemburghese.

Profilo di sostenibilità

Full ESG Integration

Voto & engagement

Obiettivo ESG

Obiettivo di punteggio ESG

Footprint target

↑ better

↓ Indice

Forma giuridica

Società d'investimento a capitale variabile costituita in conformità con la Legge del Lussemburgo (SICAV)

Struttura del fondo

Aperto

UCITS IV

Si

Classe di Azioni

D USD

Registrato in

Austria, Belgio, Cile, Finlandia, Francia, Germania, Italia, Lussemburgo, Paesi Bassi, Norvegia, Singapore, Spagna, Svizzera, Regno Unito

Politica valutaria

Il rischio valutario non sarà coperto. Pertanto, le oscillazioni dei tassi di cambio influiranno direttamente sul prezzo delle azioni del fondo.

Gestione del rischio

La gestione del rischio è completamente integrata nel processo di investimento onde assicurare che le posizioni corrispondano alle linee guida predefinite.

Politica dei dividendi

Il fondo non distribuisce dividendi, ma trattiene tutto il reddito in portafoglio, di modo che la performance complessiva si rifletta nel prezzo.

Codici del fondo

ISIN	LU0565011698
Bloomberg	RCEMDDU LX
WKN	A1JU8F
Valoren	12084791