

# Robeco QI US Conservative Equities D USD

**Gestore del fondo**  
**Indice**

 Pim van Vliet, Arlette van Ditshuizen, Maarten Polfliet, Jan Sytze Mosselaar, Arnoud Klep since: 28-03-2014  
 MSCI North America Index (Total Return, USD)

## General Facts

Morningstar	★★★
Tipologia di fondo	Azionario
Valuta	USD
Dimensione del fondo	USD 115.276.505
Dimensione della classe di azioni	USD 3.708.923
Azioni in circolazione	25.647
Data prima NAV	07-07-2016
Chiusura anno finanziario	31-12
Negoziabile giornalmente	Si
Dividendo pagato	No
Ex-ante tracking error limit	-
Management company	Robeco Institutional Asset Management B.V.

## Rendimenti

	Fondo	Indice
1 m	1,34%	1,32%
3 m	0,26%	2,05%
YTD	1,11%	8,86%
1 Anno	0,39%	1,18%
2 Anni	2,13%	-0,21%
3 Anni	10,25%	13,74%
5 Anni	5,23%	10,50%
Since 07-2016	5,65%	11,69%

Annualizzati (per periodi superiori ad un anno)

## Rendimenti annuali

	Fondo	Indice
2022	-7,59%	-19,53%
2021	23,01%	26,44%
2020	-4,08%	19,94%
2019	21,85%	30,70%
2018	-7,06%	-5,73%
2020-2022	2,92%	6,86%
2018-2022	4,31%	8,50%

Annualizzati (anni)

## Valore del fondo (NAV)

30-04-23	USD	145,52
High Ytd (13-02-23)	USD	146,13
Valore minimo YTD (17-03-23)	USD	137,57

## Costi del fondo

Spese correnti	1,01%
Commissioni di gestione	0,80%
Commissioni di performance	Nessuna
Commissioni amministrative	0,16%

## Esposizione in portafoglio delle top 10/20/30

TOP 10	28,25%
TOP 20	46,45%
TOP 30	59,56%

## Rendimenti

Valore di riferimento (until 30-04-2023) - Fonte: Robeco



## Sector Allocation

	Fondo	Indice
Assistenza sanitaria	22,1%	13,6%
Tecnologia informatica	16,0%	25,1%
Finanziari	15,7%	13,9%
Prodotti di consumo di prima necessità	15,4%	7,0%
Industriali	11,7%	8,9%
Beni discrezionali	8,3%	9,7%
Energia	5,0%	5,3%
Servizi di comunicazione	2,3%	8,0%
Servizi pubblici	2,1%	2,8%
Materie prime	1,5%	3,1%

## Country Allocation

	Fondo	Indice
Stati Uniti d'America	90,2%	95,3%
Canada	9,8%	4,7%
Liquidità e altri strumenti	0,0%	-

## Ripartizione per asset class

Equity	97,6%
Liquidità	2,4%

# Robeco QI US Conservative Equities D USD

**Gestore del fondo  
Indice**

Pim van Vliet, Arlette van Ditshuizen, Maarten Polfliet, Jan Sytze Mosselaar, Arnoud Klep since: 28-03-2014  
MSCI North America Index (Total Return, USD)

---

**Politica d'investimento**

Robeco QI US Conservative Equities è un fondo gestito in maniera attiva che investe in titoli azionari a bassa volatilità dell'America Settentrionale. La selezione di tali azioni si basa su un modello quantitativo. Il fondo intende ottenere rendimenti pari o superiori a quelli del Benchmark con un minor rischio atteso di ribassi, controllando al contempo il rischio relativo applicando dei limiti (su Paesi e settori) alla misura dello scostamento dal Benchmark. Obiettivo del fondo è ottenere un rendimento migliore rispetto all'indice. I titoli azionari a basso rischio selezionati sono caratterizzati da elevati rendimenti azionari, valutazioni interessanti, un forte momentum oltre che revisioni positive degli analisti. Ciò comporta un portafoglio diversificato a bassa rotazione di titoli difensivi, per ottenere rendimenti azionari stabili e un reddito elevato.

---

## Robeco QI US Conservative Equities

## Le prime 10 posizioni per dimensioni Class D USD

Posizioni	Sector	%
Apple Inc	Tecnologia informatica	3,52
Merck & Co Inc	Assistenza sanitaria	3,21
Exxon Mobil Corp	Energia	3,15
PepsiCo Inc	Prodotti di consumo di prima necessità	3,15
Oracle Corp	Tecnologia informatica	2,99
Cisco Systems Inc	Tecnologia informatica	2,67
Procter & Gamble Co/The	Prodotti di consumo di prima necessità	2,53
Gilead Sciences Inc	Assistenza sanitaria	2,44
Johnson & Johnson	Assistenza sanitaria	2,31
Royal Bank of Canada	Finanziari	2,29
<b>Total</b>		<b>28,25</b>

## Statistiche del fondo

	3 Anni	5 Anni
Ex-Post Tracking Error (%)	7,93	7,51
Information ratio	-0,30	-0,55
Indice di Sharpe	0,74	0,31
Alpha (%)	1,38	-1,87
Beta	0,68	0,75
Standard deviation	13,52	15,39
Utile mensile max. (%)	10,12	10,12
Perdita mensile max. (%)	-6,41	-16,41

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

## Hit ratio

	3 Anni	5 Anni
Rendimenti superiori alle aspettative (mesi)	18	27
Hit ratio (%)	50,0	45,0
Mercato al rialzo (mesi)	22	40
Rendimenti superiori alle aspettative - Mercato al rialzo (mesi)	6	11
Hit ratio - in condizioni di mercato rialzista (%)	27,3	27,5
Mercato al ribasso (mesi)	14	20
Months Outperformance Bear	12	16
Hit ratio - in condizioni di mercato ribassista (%)	85,7	80,0

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

## Profilo di sostenibilità

	Esclusione
	Full ESG Integration
	Voto & engagement
	Obiettivo ESG
	Obiettivo di punteggio ESG
	Footprint target
	↑ Indice
	↓ Indice

Per maggiori informazioni in merito al nostro approccio di esclusione si rimanda al sito <https://www.robeco.com/exclusions/>

## 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

Belgio, Finlandia, Italia, Lussemburgo, Svizzera

## 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 sempre alle linee guida predefinite.

## Politica dei dividendi

Questa categoria di azioni non prevede la distribuzione di dividendi.

## Codici del fondo

ISIN	LU1439788933
Bloomberg	RUSEQDU LX
Valoren	33078125

## 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](http://www.morningstar.com).

## Disclaimer

Prima della sottoscrizione, leggere il Prospetto ed il PRIIPS ( Documento di Informazioni Chiave per gli Investitori ), 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](http://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.