

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	Sì
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

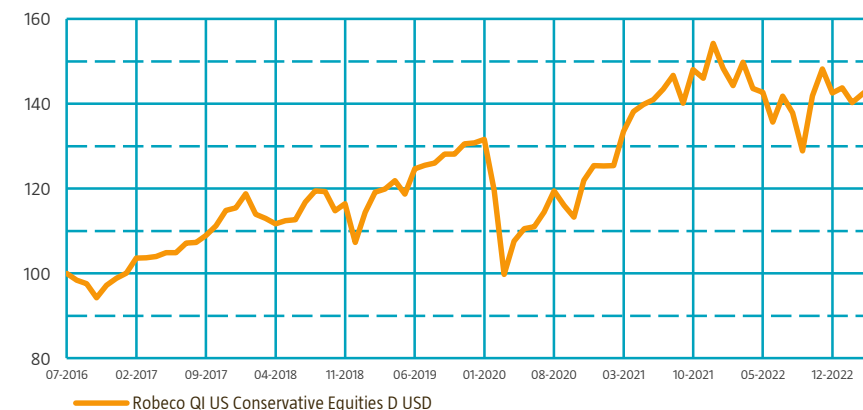
Spese correnti	1,01%
Commissioni di gestione	0,80%
Commissioni di performance	Nessuna
Commissioni amministrative	0,16%

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
Total		28,25

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

↑ Indice

Footprint target

↓ Indice

Per maggiori informazioni in merito al nostro appoggio 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
UCITS IV
Classe di Azioni

Aperto
Si
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 nei 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 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. 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.

Il valore degli investimenti è variabile. Le performance passate non garantiscono in alcun modo i risultati futuri. Si prega di visitare il sito www.robeco.it per maggiori informazioni, per il documento con le informazioni chiave per gli investitori (PRIIPS) e per il prospetto

Per maggiori informazioni visita: www.robeco.it

Page 3/3