

Persbericht

Dit persbericht is een vertaling van het Engelstalige persbericht. De Engelse tekst is leidend.

Robeco introduceert multi-factor credits fonds

Rotterdam, 17 juni 2015 - Robeco kondigt de introductie aan van een multi-factor credits fonds. *Robeco Global Multi-Factor Credits* maakt factorbeleggen mogelijk voor beleggers in bedrijfsobligaties. Beleggers kunnen met het fonds inspelen op soortgelijke factoren die succesvol zijn gebleken in aandelenmarkten, zoals lage volatiliteit, waarde en momentum.

Robeco Global Multi-Factor Credits belegt in een gespreide en gebalanceerde portefeuille van 150 tot 200 investment-grade bedrijfsobligaties die goed scoren op de hierboven genoemde factoren. Het fonds streeft naar een hoger rendement met een marktconform risicoprofiel. Hoewel het fonds voornamelijk in investment-grade bedrijfsobligaties belegt, kan het tot een maximum van tien procent beleggen in bedrijfsobligaties met een BB-rating. Hierdoor heeft het fonds de mogelijkheid te beleggen in interessante 'fallen angels' en 'rising stars'. Robeco Global Multi-Factor Credits richt zich op de professionele belegger die op zoek is naar stijldiversificatie in een gebalanceerde portefeuille.

Het fonds wordt beheerd door het Robeco Credits Team. De fondsmanager, Patrick Houweling, is sinds 2003 werkzaam bij Robeco. Houweling was al verantwoordelijk voor het beheer van Robeco's Conservative Credits strategie, die inspeelt op de laag-risico anomalie in markten voor bedrijfsobligaties. In een academische studie die vorig jaar werd gepubliceerd, laten Houweling en Robeco collega Jeroen van Zundert zien dat factorstrategieën ook aantrekkelijk kunnen zijn in markten voor bedrijfsobligaties. Naast de drie factoren lage volatiliteit, waarde en momentum, die door Robeco worden toegepast in factorstrategieën voor aandelenmarkten, speelt Robeco Global Multi-Factor Credits ook in op de 'size' factor. Hierdoor kan deze strategie inspelen op een liquiditeitseffect, dat in minder liquide markten zoals die voor bedrijfsobligaties een grotere rol speelt dan in aandelenmarkten.

Patrick Houweling: *"Bij Robeco hebben we nauwkeurig de mogelijkheden onderzocht om factorbeleggen ook buiten de traditionele aandelenmarkten toe te passen. Wij zijn daarom erg verheugd dat we onze theorie nu in praktijk brengen met de introductie van dit factorbeleggen-fonds voor bedrijfsobligaties. Het fonds belegt op basis van Robeco's kwantitatieve multi-factor model, dat bedrijfsobligaties rangschikt naar lage volatiliteit-, waarde- en momentumkarakteristieken.*

Kwantitatief beleggen bij Robeco

Robeco is pionier op het gebied van kwantitatief beleggen en past al sinds de jaren '90 kwantitatieve modellen toe. Deze modellen worden ingezet bij zowel traditioneel beheerde beleggingsproducten als bij producten die volledig kwantitatief worden beheerd. Met 21 gespecialiseerde onderzoekers en twaalf portefeuillemanagers op het gebied van kwantitatief beleggen, en met EUR 32 miljard belegd vermogen in puur kwantitatief beheerde strategieën per eind maart 2015, is Robeco één van Europa's grootste aanbieders van kwantitatieve beleggingsstrategieën.

Perscontact

Robeco Corporate Communications

Kantoor: 010 224 2241

E-mail: cc@robeco.nl

Over Robeco Groep

Robeco is een middelgrote wereldwijde vermogensbeheerder. Het bedrijf biedt, via een breed aanbod aan strategieën, een mix aan beleggingsoplossingen aan institutionele en particuliere beleggers overal ter wereld. Op 31 maart 2014 had Robeco EUR 281 aan vermogen onder beheer, waarvan 47% afkomstig is van institutionele partijen. In 2014 boekte Robeco een nettowinst van EUR 228 miljoen.

Het hoofdkantoor van Robeco staat in Rotterdam. Robeco telt 1.218 werknemers in 15 landen (eind 2014). Het bedrijf heeft een sterke aanwezigheid in Europa, de VS en Azië, en een groeiende aanwezigheid in de belangrijkste opkomende markten, zoals Azië, India en Latijns-Amerika.

Robeco is in 1929 in Nederland opgericht als Rotterdamsch Beleggings Consortium. Tegenwoordig is Robeco het expertisecentrum voor vermogensbeheer voor ORIX Corporation, Robeco's meerderheidsaandeelhouder gevestigd in Tokio, Japan. De volgende dochterondernemingen en joint ventures zijn onderdeel van de Robeco Groep: Robeco Investment Management, Corestone Investment Management, Harbor Capital Advisors, Transtrend, RobecoSAM en Canara Robeco Asset Management Company. Meer informatie is te vinden op www.robeco.com