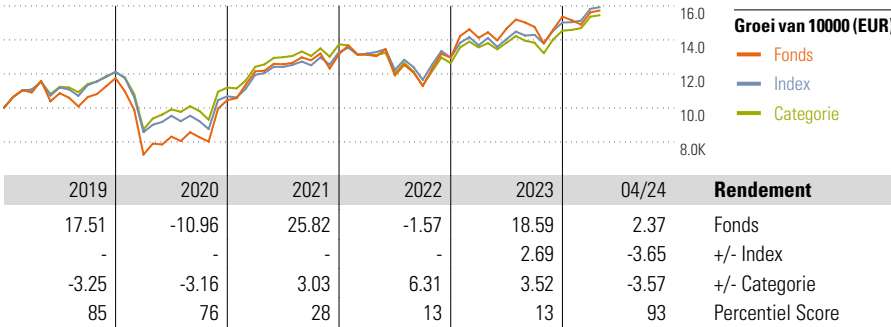


ABN AMRO Funds - Pzena European Equities A EUR Capitalisation

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Developed Markets Europe Value Target Market Exposure NR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds MSCI Europe NR EUR	Morningstar Rating™ ★★	Morningstar Categorie™ Aandelen Europa Large Cap Waarde
---	---	--	----------------------------------	--

Beleggingsdoelstelling

To provide long term capital appreciation with a diversified and actively managed portfolio of European equities, without any specific restriction on tracking error.



Risicomaatstaven			
Alpha	-2.16	Sharpe Ratio	0.52
Beta	1.21	Std Deviatie	16.50
R-kwadraat	93.57	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.17	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	5.00	10-jr Risico	Hoog
Berekeningen met Morningstar DM Europe Val TME NR EUR (waar van toepassing)			

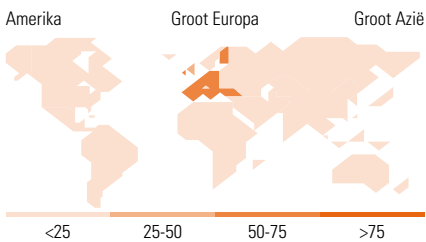
Rendementen (30 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	11.42	2.67	2.69
6 Maanden	13.70	0.54	0.18
1 jaar	16.69	-4.41	-2.02
3 jr gean.	9.56	-0.27	1.30
5 jr gean.	9.66	0.73	1.19

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.64	-	-	-
2023	8.99	3.82	0.69	4.08
2022	-0.24	-9.34	-5.17	14.76
2021	16.11	3.41	1.91	2.82
2020	-38.25	14.59	-0.40	26.34

Portefeuille 30 apr 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	97.70	0.00	97.70
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	2.30	0.00	2.30
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™	% Aand
Zeer Groot	15.11
Groot	37.29
Midden	40.71
Klein	6.89
Micro	0.00
Gem Mkt Cap (mln)	EUR 17691



Top 10 Onderliggende posities	Sector	% Port
Basf SE	Chemie	3.30
Sanofi SA	Geneesmiddelen	3.19
Amundi SA	Beleidsmaatschappijen	3.17
Fresenius Medical Care AG	Geneesmiddelen	3.15
Enel SpA	Elektriciteit	3.03
Michelin	Automobilie	2.97
Rexel SA	Handel	2.96
HSBC Holdings PLC	Banken	2.69
Signify NV	Technologie	2.63
Reckitt Benckiser Group PLC	Geneesmiddelen	2.63
Totaal Aantal Aandelen		48
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		29.72

Sectorverdeling	% Aand
Cyclisch	47.91
Basismaterialen	8.70
Cyclische consumentenproducten	10.07
Financiële dienstverlening	29.14
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	28.28
Communicatiediensten	-
Energie	3.99
Industrie	15.87
Technologie	8.42
Defensief	23.81
Defensieve consumptiegoederen	6.78
Gezondheidszorg	12.44
Nutsbedrijven	4.59

Regioverdeling	% Aand
Amerika	1.95
Verenigde Staten	1.95
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	98.05
Verenigd Koninkrijk	26.35
West Europa – Euro	59.97
West Europa – Niet Euro	11.73
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.00
Groot Azië	0.00
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.00
Azië - Emerging	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	ABN AMRO Investment...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	100
Telefoon	01 56 21 60 60	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	100
Website	www.abnamroinvestments...	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	4 apr 2013	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kevin Sorel	ISIN	LU0849850408		
Aanvangsdatum	4 apr 2013				
Koers (30 mei 2024)	EUR 215.51				
Fondsvermogen (mln)	EUR 5.74				