AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio I Acc

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
Morningstar Global Target Market Exposure NR USD
Wordt gebruikt in dit rapport als index

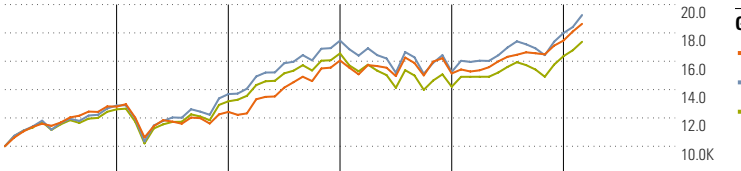
Benchmark van het fonds
MSCI World NR USD

Morningstar Rating™
★★★★★

Morningstar Categorie™
Aandelen Wereldwijd Large Cap Gemengd

Beleggingsdoelstelling

The Portfolio seeks to increase the value of investment over time through capital growth. Under normal market conditions, the Portfolio typically invests in equity securities of companies that are organised, have substantial business activities in developed countries as well as Emerging Markets, that the Investment Manager believes have lower volatility. These companies may be of any market capitalisation and industry. The Portfolio's investments may include convertible securities, depositary receipts and ETFs. The...



2019	2020	2021	2022	2023	02/24	Rendement
27.98	-2.93	29.23	-5.70	15.31	6.77	Fonds
-0.78	-9.19	1.66	6.96	-2.69	-0.32	+/- Index
1.89	-7.62	3.38	8.51	-0.14	0.56	+/- Categorie
40	88	36	6	55	44	Percentiel Score

Risicomaatstaven			
Alpha	3.92	Sharpe Ratio	1.13
Beta	0.81	Std Deviatie	11.94
R-kwadraat	92.12	3-jr Risico	Laag
Informatie Ratio	0.72	5-jr Risico	Laag
Tracking Error	4.96	10-jr Risico	Laag

Berekeningen met Morningstar Gbl TME NR USD (waar van toepassing)

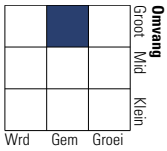
Rendementen (28 mrt 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	10.03	-	0.00
6 Maanden	14.33	-	-2.08
1 jaar	26.74	-	3.37
3 jr gean.	12.68	-	4.25
5 jr gean.	11.05	-	1.03

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2023	1.47	6.20	1.53	5.39
2022	-2.02	-4.91	0.28	0.93
2021	7.22	6.13	3.29	9.96
2020	-16.98	10.50	2.06	3.67
2019	13.71	2.71	6.58	2.81

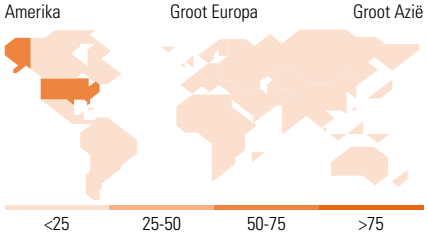
Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	100.00	0.00	100.00
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	0.00	0.00	0.00
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™



	% Aand
Zeer Groot	52.58
Groot	31.75
Midden	15.67
Klein	0.00
Micro	0.00
Gem Mkt Cap (mln)	USD 139059



Top 10 Onderliggende posities	Sector	% Port
Microsoft Corp		5.68
Broadcom Inc		3.27
Alphabet Inc Class C		3.04
Apple Inc		2.60
Novo Nordisk A/S Class B		2.34
Merck & Co Inc		2.22
AutoZone Inc		2.19
Shell PLC		2.14
Visa Inc Class A		2.02
Wolters Kluwer NV		1.75
Totaal Aantal Aandelen		98
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		27.25

Sectorverdeling	% Aand
Cyclisch	**28.43**
Basismaterialen	0.25
Cyclische consumentenproducten	8.99
Financiële dienstverlening	18.68
Vastgoed	0.51
Licht Cyclisch	**49.77**
Communicatiediensten	8.27
Energie	3.94
Industrie	10.86
Technologie	26.70
Defensief	**21.81**
Defensieve consumptiegoederen	4.83
Gezondheidszorg	14.59
Nutsbedrijven	2.39

Regioverdeling	% Aand
Amerika	**65.20**
Verenigde Staten	60.25
Canada	4.95
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	**26.83**
Verenigd Koninkrijk	7.03
West Europa – Euro	13.39
West Europa – Niet Euro	5.99
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.42
Groot Azië	**7.97**
Japan	3.16
Australazië	0.82
Azië - Ontwikkeld	3.15
Azië - Emerging	0.85

Fondsinformatie

Fondsgroep	AllianceBernstein...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	+352 46 39 36 151	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.abglobal.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	11 dec 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kent Hargis	ISIN	LU0861579349		
Aanvangsdatum	11 dec 2012				
Koers (28 mrt 2024)	USD 47.19				
Fondsvermogen (mln)	USD 331.63				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.