

Robeco QI Global Multi-Factor Equities Fund G €

Morningstar Medalist Rating™



Morningstar Categorie Index

Morningstar Global All Cap
Target Market Exposure NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

MSCI AC World TR EUR

Morningstar Rating™

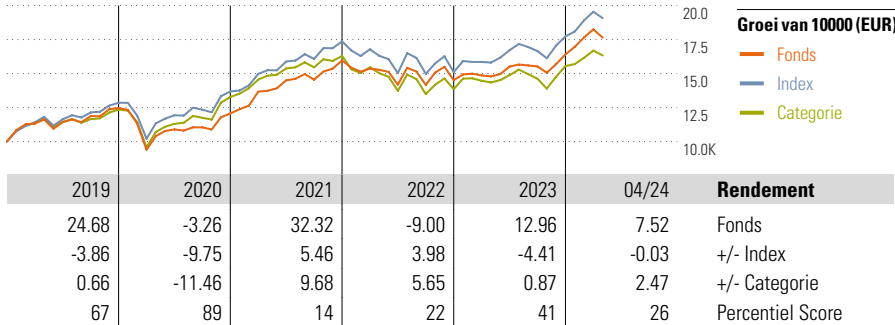
★★★★

Morningstar Categorie™

Aandelen Wereldwijd Small/Mid
Cap

Beleggingsdoelstelling

Robeco QI Global Multi-Factor Equities Fund invests in stocks in developed and emerging countries across the world. The selection of these stocks is based on a quantitative model. The fund's objective is to achieve a better return than the index. The fund follows a bottom-up driven investment strategy to gain efficient, well-diversified exposure to the proven factors value, momentum, low-volatility and quality. The fund uses enhanced factor definitions to avoid unrewarded risk and unwanted and unintended factor tilts.



Risicomaatstaven

Alpha	0.84	Sharpe Ratio	0.64
Beta	0.89	Std Deviatie	12.21
R-kwadraat	95.57	3-jr Risico	Laag
Informatie Ratio	0.25	5-jr Risico	- gem
Tracking Error	3.65	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar Global All Cap TME NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (14 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	3.77	-1.44	-0.65
6 Maanden	16.61	-0.30	1.27
1 jaar	21.89	-1.33	5.68
3 jr gean.	9.55	0.16	5.04
5 jr gean.	10.15	-1.39	1.52

Kwartaalrendementen

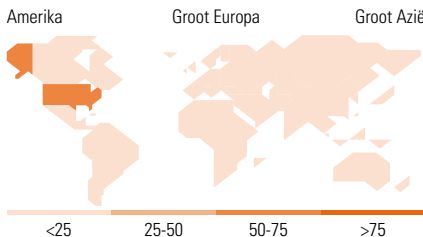
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	11.22	-	-	-
2023	2.36	4.39	0.04	5.67
2022	-3.66	-7.70	-0.15	2.49
2021	13.34	6.09	0.32	9.69
2020	-24.55	15.82	1.38	9.21

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	99.79	0.17	99.63
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	1.82	1.44	0.37
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	29.59
Groot	34.70
Midden	25.38
Klein	7.59
Micro	2.74
Gem Mkt Cap (mIn)	EUR 47855



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Microsoft Corp	Software	3.74
Apple Inc	Technologie	2.73
NVIDIA Corp	Technologie	2.43
Alphabet Inc Class A	Technologie	1.45
Meta Platforms Inc Class A	Technologie	1.33
Cadence Design Systems Inc	Technologie	1.02
Eli Lilly and Co	Geneesmiddelen	1.00
O'Reilly Automotive Inc	Automotive	0.99
Amazon.com Inc	Technologie	0.95
Gilead Sciences Inc	Geneesmiddelen	0.88
Totaal Aantal Aandelen		439
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		16.52

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	33.33
Basismaterialen	1.48
Cyclische consumentenproducten	13.99
Financiële dienstverlening	16.88
Vastgoed	0.99
Licht Cyclisch	47.53
Communicatiediensten	8.34
Energie	3.50
Industrie	9.65
Technologie	26.04
Defensief	19.14
Defensieve consumptiegoederen	4.85
Gezondheidszorg	12.31
Nutsbedrijven	1.98

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	64.88
Verenigde Staten	60.27
Canada	2.81
Latijns Amerika	1.80
Groot Europa	17.59
Verenigd Koninkrijk	1.99
West Europa – Euro	8.20
West Europa – Niet Euro	5.08
Emerging Europa	1.17
Midden-Oosten / Afrika	1.15
Groot Azië	17.53
Japan	7.53
Australazië	1.18
Azië - Ontwikkeld	5.83
Azië - Emerging	2.99

Fondsinformatie

Fondsgroep	Robeco Institutional...	Vestigingsland	Nederland	Min Aanvangsbedrag	1 Aandeel
Telefoon	+31 10 2241224	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	1 Aandeel
Website	www.robeco.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	30 sep 2015	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Jan Sytze Mosselaar	ISIN	NL0011354873		
Aanvangsdatum	1 jan 2022				
Koers (14 mei 2024)	EUR 183.51				
Fondsvermogen (mIn)	EUR 78.24				