

ABN AMRO Funds - Pzena European Equities A EUR Capitalisation

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
MSCI Europe Value NR EUR
Wordt gebruikt in dit rapport als index

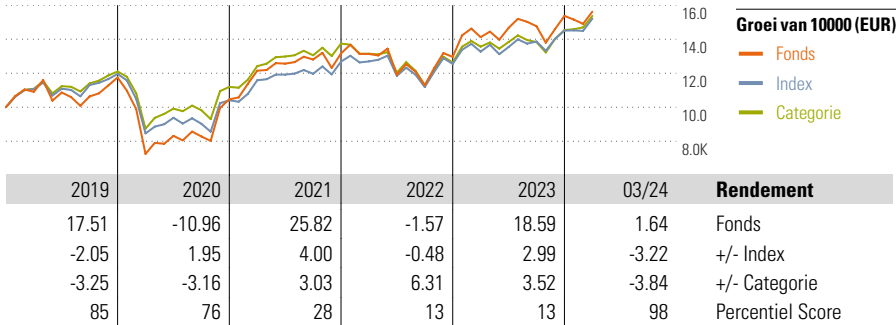
Benchmark van het fonds
MSCI Europe NR EUR

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	-1.95	Sharpe Ratio	0.52
Beta	1.19	Std Deviatie	16.50
R-kwadraat	94.51	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	-0.16	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	4.65	10-jr Risico	Hoog

Berekeningen met MSCI Europe Value NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.01	-4.20	-3.95
6 Maanden	13.74	-1.45	-2.54
1 jaar	9.34	-4.02	-3.24
3 jr gean.	8.41	-1.25	0.53
5 jr gean.	6.27	0.15	0.01

Kwartaalrendementen

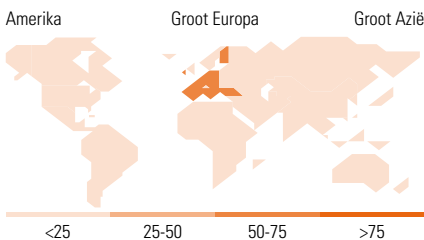
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.64	-	-	-
2023	8.99	3.82	0.69	4.08
2022	-0.24	-9.34	-5.17	14.76
2021	16.11	3.41	1.91	2.82
2020	-38.25	14.59	-0.40	26.34

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	96.93	0.00	96.93
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	3.13	0.06	3.07
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	15.15
Groot	39.86
Midden	39.49
Klein	5.51
Micro	0.00
Gem Mkt Cap (mIn)	EUR 18884



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Basf SE	Chemie	3.95
Michelin	Automobilie	3.43
Signify NV	Technologie	3.33
Amundi SA	Financiële dienstverlening	3.19
Daimler Truck Holding AG...	Transport	3.16
Rexel SA	Industrie	3.12
Sanofi SA	Geneesmiddelen	3.07
Enel SpA	Elektriciteit	2.95
Fresenius Medical Care AG	Geneesmiddelen	2.79
Randstad NV	Personenlijke diensten	2.76
Totaal Aantal Aandelen		45
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		31.75

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	48.03
Basismaterialen	9.79
Cyclische consumentenproducten	8.72
Financiële dienstverlening	29.52
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	28.41
Communicatiediensten	-
Energie	4.78
Industrie	15.63
Technologie	8.00
Defensief	23.56
Defensieve consumptiegoederen	6.23
Gezondheidszorg	12.75
Nutsbedrijven	4.58

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	2.09
Verenigde Staten	2.09
Canada	0.00
Latijns Amerika	0.00
Groot Europa	97.91
Verenigd Koninkrijk	24.99
West Europa – Euro	61.85
West Europa – Niet Euro	11.07
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 (26 apr 2024)	EUR 202.63				
Fondsvermogen (mIn)	EUR 5.58				