

Robeco QI Global Multi-Factor Equities Fund X €

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

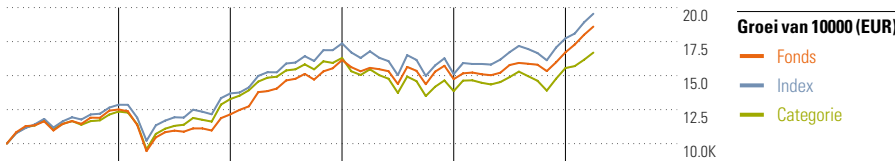
Beleggingsdoelstelling

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	1.40	Sharpe Ratio	0.80
Beta	0.88	Std Deviatie	11.97
R-kwadraat	95.63	3-jr Risico	Laag
Informatie Ratio	0.32	5-jr Risico	- gem
Tracking Error	3.70	10-jr Risico	-

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



	2019	2020	2021	2022	2023	03/24	Rendement
Fonds	25.11	-2.89	32.88	-8.71	13.37	11.32	Fonds
+/- Index	-3.44	-9.38	6.02	4.28	-4.01	1.13	+/- Index
+/- Categorie	1.08	-11.09	10.25	5.94	1.28	4.01	+/- Categorie
Percentiel Score	63	88	13	21	39	13	Percentiel Score

Rendementen (26 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	5.22	-0.72	1.33
6 Maanden	19.24	-0.79	1.77
1 jaar	22.86	-1.12	7.71
3 jr gean.	9.13	1.20	6.43
5 jr gean.	9.28	-0.91	2.07

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	11.32	-	-	-
2023	2.45	4.48	0.14	5.77
2022	-3.58	-7.61	-0.10	2.59
2021	13.45	6.24	0.41	9.80
2020	-24.47	15.92	1.47	9.31

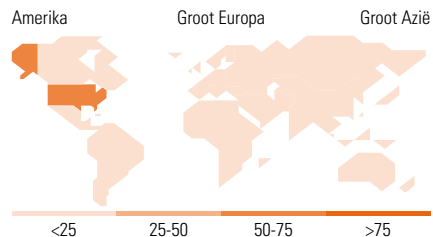
Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	99.35	0.00	99.35
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	1.08	0.43	0.65
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Aandelen Style Box™

	% Aand
Zeer Groot	28.87
Groot	34.07
Midden	26.69
Klein	7.59
Micro	2.78
Gem Mkt Cap (mln)	EUR 44693



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
Microsoft Corp	Software	3.43
Apple Inc	Software	3.00
NVIDIA Corp	Software	2.10
Meta Platforms Inc Class A	Software	1.38
Alphabet Inc Class A	Software	1.35
Cadence Design Systems Inc	Software	1.02
O'Reilly Automotive Inc	Automotive	1.00
Amazon.com Inc	Software	0.96
Gilead Sciences Inc	Pharmaceuticals	0.89
AbbVie Inc	Pharmaceuticals	0.85
Totaal Aantal Aandelen		442
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van Vermogen In Top 10 Posities		15.97

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	32.85
Basismaterialen	1.36
Cyclische consumentenproducten	14.46
Financiële dienstverlening	15.98
Vastgoed	1.04
Licht Cyclisch	47.65
Communicatiediensten	8.38
Energie	3.29
Industrie	10.13
Technologie	25.85
Defensief	19.50
Defensieve consumptiegoederen	5.29
Gezondheidszorg	12.22
Nutsbedrijven	1.99

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	64.45
Verenigde Staten	59.83
Canada	2.88
Latijns Amerika	1.74
Groot Europa	18.02
Verenigd Koninkrijk	1.99
West Europa – Euro	8.38
West Europa – Niet Euro	4.90
Emerging Europa	1.33
Midden-Oosten / Afrika	1.41
Groot Azië	17.53
Japan	7.47
Australazië	1.15
Azië - Ontwikkeld	5.90
Azië - Emerging	3.01

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	NL0011354881		
Aanvangsdatum	1 jan 2022				
Koers (26 apr 2024)	EUR 162.00				
Fondsvermogen (mln)	EUR 65.63				