ABN AMRO Responsible Profile 4

un compartiment de ABN AMRO Funds

Catégorie Morningstar : Allocation EUR Modérée - International ★★★★

Note Morningstar de durabilité :

Informations clés

▶ Valeur liquidative	EUR 104,259
▶ Actif net	EUR 54 M
▶ Code ISIN	LU1890807602
▶ Duration	4,55
▶ Rating moyen du fonds	A-
▶ YTM moyen	4,10
▶ Classification SFDR	Art, 8 – produit d'investissement ESG

Profil du fonds

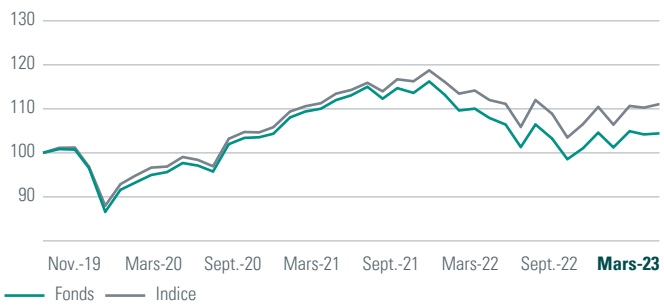
▶ le compartiment est un fonds d'investissement « modérément agressif » permettant d'accéder à un portefeuille optimalement diversifié composé d'un mix de classes d'actifs telles que les actions, les obligations, les placements alternatifs et les titres de créance à court terme. La sélection des investissements s'effectue à l'aune de critères ESG (Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance) et de critères financiers.

▶ Objectif: le compartiment vise à fournir une appréciation du capital à long terme avec un portefeuille diversifié et géré activement de diverses classes d'actifs offrant une large répartition des risques, sans aucune restriction spécifique en matière d'écart de suivi. Il sélectionnera des titres respectant les critères de responsabilité Environnementale, Sociale et de Gouvernance (ESG). Le portefeuille sera composé soit d'émetteurs de premier plan pour leurs pratiques ESG exemplaires soit d'émetteurs attractifs au vu de leurs progrès dans les domaines ESG. Le compartiment pourra investir un pourcentage limité dans des sociétés ou des valeurs (obligations vertes, sociales, durables ou respectant les ODD) susceptibles d'avoir un impact positif net sur la durabilité.

Caractéristiques principales

Catégorie d'actions	Classe A
Date de création	28/11/2019
Nature juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Affectation des revenus	Capitalisation
Indice	55% (50% MSCI Europe + 40% MSCI World ex Europe + 10% MSCI Emerging Markets) + 5% Bloomberg Barclays Global High Yield Corporate EUR hedged + 2,5% JP Morgan EMBI EUR Hedged + 2,5% JP Morgan CEMBI EUR Hedged + 25% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond Index 1-10 years + 10% Euribor 1m Capitalized
Devise	EUR
Valorisation	Quotidienne
Dépositaire	State Street Bank Luxembourg
Valorisateur	State Street Bank Luxembourg
Frais de gestion max	1,40%
Frais estimés courants	1,63%
Frais d'entrée max	5,00%
Frais de sortie max	1,00%
Investissement minimal	EUR 100
Souscription / Rachat	16h00 CET, J-1
Code Bloomberg	AAMSP4A LX

Performances*



	Fonds	Indice	Ecart
1 mois	0,23%	0,73%	-0,50%
3 mois	3,15%	4,38%	-1,23%
YTD	3,15%	4,38%	-1,23%
1 an	-5,10%	-2,71%	-2,39%
3 ans	20,59%	26,24%	-5,65%
5 ans	-	-	-
10 ans	-	-	-
Depuis création	4,26%	10,70%	-6,44%
2022	-12,89%	-10,39%	-2,50%
2021	12,39%	13,37%	-0,98%
2020	2,53%	3,55%	-1,02%
2019	-	-	-
2018	-	-	-

* Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les performances sont nettes de frais hors frais de souscription.

Ratios de risque

	Fonds		Indice	
	1 an	3 ans	1 an	3 ans
Volatilité	8,87%	9,48%	9,15%	9,46%
Tracking error	1,41%	1,16%	-	-
Ratio de Sharpe	-0,65	0,68	-0,38	0,85

La Volatilité est une mesure statistique de la dispersion des rendements pour un portefeuille ou un indice de marché. Dans la plupart des cas, plus la volatilité est élevée, plus le risque est élevé.
Le Tracking error est l'écart-type de la différence entre le rendement du portefeuille et le rendement de référence de l'investissement souhaité.
Le Ratio de Sharpe est un ratio utilisé pour mesurer la performance ajustée au risque. Il est calculé en soustrayant le taux sans risque du taux de rendement d'un portefeuille et en divisant le résultat par l'écart-type des rendements du portefeuille.

Gestionnaire (s) du portefeuille

Kevin Sorel

Expérience dans l'industrie depuis	**2006**
Dans l'entreprise depuis	2007

Risque plus faible — Risque plus élevé

Rendement potentiellement plus faible — Rendement potentiellement plus élevé

1	2	3	**4**	5	6	7

ABN AMRO Responsible Profile 4

31 mars 2023

Répartition par Classe d'actifs

	Fonds	Indice
Actions	49,61%	55,00%
Obligations	33,60%	35,00%
Liquidités	16,79%	10,00%

Principales positions

Nom	%
MICROSOFT CORP	1,02%
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.01% 3...	0,96%
FRANCE (REPUBLIC OF)	0,68%
APPLE INC	0,68%
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.75% 2...	0,65%
NESTLE	0,61%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC)	0,59%
ALPHABET INC	0,53%
SALESFORCE.COM INC	0,51%
ROCHE HOLDING AG	0,51%
Total Top 10	6,76%

Devise (%)

	Fonds	Indice
EUR EURO	56,28%	59,05%
USD DOLLAR USA	26,38%	18,94%
GBP POUND GBR	5,34%	6,33%
CHF FRANC CHE	2,90%	4,06%
HKD DOLLAR HKG	1,94%	1,40%
Autres	7,16%	10,21%

Actions | Secteur (%)

	Fonds	Indice
Technologies de l'Information	17,61%	14,86%
Finance	16,06%	15,99%
Industrie	14,01%	12,11%
Soins de Santé	13,11%	13,24%
Services de Communication	10,35%	9,59%
Consommation Discrétionnaire	10,25%	9,39%
Biens de Conso. de Base	7,06%	8,36%
Matériaux	6,61%	5,93%
Immobilier	2,33%	1,72%
Energie	1,58%	5,33%
Services aux Collectivités	0,89%	3,48%
Fonds	0,12%	0,00%

Actions | Géographique (%)

	Fonds	Indice
Etats-Unis	33,55%	32,87%
Royaume-Uni	11,48%	10,84%
France	8,87%	9,17%
Allemagne	6,90%	6,43%
Suisse	6,06%	8,15%
Pays-Bas	3,47%	3,81%
Chine	3,36%	3,04%
Japon	3,02%	3,04%
Italie	2,89%	1,57%
Espagne	2,58%	2,00%
Autres	17,83%	19,07%

Actions | Capitalisation (%)

	Fonds	Indice
Micro capitalisation (<0.5Mds. €)	0,08%	0,02%
Petite capitalisation (0.5 à 2Mds. €)	1,64%	0,05%
Moyenne capitalisation (2 à 5Mds. €)	6,88%	1,78%
Grande capitalisation (5 à 20Mds. €)	21,41%	18,22%
Mega capitalisation (>20Mds. €)	69,99%	79,93%

Obligations | Secteur (%)

	Fonds	Indice
Treasury	54,65%	36,31%
Agences	1,96%	7,71%
Autorités locales	0,08%	2,63%
Souverain	7,48%	6,74%
Supranational	2,05%	3,95%
Industrie	17,54%	22,69%
Services aux Collectivités	3,22%	2,12%
Institution financières	10,43%	11,09%
ABS	0,00%	0,01%
CMBS	0,00%	0,00%
Covered	1,12%	5,69%
Non Classés	1,47%	1,08%

Obligations | Géographique (%)

	Fonds	Indice
France	21,19%	16,27%
Italie	12,71%	10,09%
Allemagne	12,38%	14,29%
Espagne	10,29%	7,50%
Etats-Unis	7,19%	11,07%
Pays-Bas	4,39%	4,13%
Royaume-Uni	2,96%	2,45%
Belgique	2,58%	2,15%
Autriche	2,19%	1,84%
Supra National	2,05%	3,31%
Autres	22,08%	26,88%

Obligations | Rating (%)

	Fonds	Indice
AAA	14,45%	18,49%
AA	21,50%	19,87%
A	6,29%	10,92%
BBB	21,02%	22,13%
BB	13,12%	10,50%
B	3,21%	7,47%
CCC	0,44%	1,76%
CC	0,09%	0,17%
C	0,00%	0,06%
D	0,00%	0,09%
NR	0,45%	0,18%
NA	19,44%	8,35%

Obligations | Duration (%)

	Fonds	Indice
<1	9,63%	8,63%
>1 <3	26,01%	30,06%
>3 <5	26,91%	24,72%
>5 <7	9,31%	16,38%
>7 <10	17,20%	16,39%
>10 <15	3,74%	0,85%
>15	7,20%	2,97%

Avertissement

Document non contractuel.
Ce document d'information ne constitue en aucun cas une offre ou recommandation d'achat ou de vente d'instruments financiers. Il vous appartient de vérifier que la réglementation qui vous est applicable n'interdit pas l'achat/la vente et/ou la commercialisation du produit et de vous assurer de l'adéquation de l'investissement en fonction des objectifs et des considérations légales et fiscales qui vous sont propres. Cet OPC ne bénéficie d'aucune garantie. Les fluctuations de taux de change peuvent influer à la hausse ou à la baisse sur la valeur de votre placement. Pour une description détaillée des risques du produit, nous vous recommandons de vous référer à la section « profil de risque » du prospectus. Toute souscription dans cet OPC doit se faire après avoir pris connaissance du prospectus en vigueur, disponible sur simple demande auprès d'ABN AMRO Investment Solutions ou sur www.abnamroinvestmentsolutions.fr. ABN AMRO Investment Solutions, société de gestion de portefeuilles, agréé par l'Autorité des Marchés Financiers (AMF) sous le numéro n° GP 99-27. Société anonyme à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 4 324 048 Euros. Siège social: 3, avenue Hoche 75008 Paris, France
L'accès aux produits et services peut faire l'objet de restrictions à l'égard de certaines personnes ou de certains pays. Pour plus d'information, il vous appartient de contacter votre interlocuteur habituel. Etoiles communiquées par Morningstar Inc, tous droits réservés. Notation Overall. **Source: ABN AMRO Investment Solutions, State Street.**
© 2023 Morningstar. Tous droits réservés. Les informations contenues dans les présentes : (1) sont la propriété de Morningstar et/ou de ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent pas être copiées ou distribuées ; et (3) ne sont pas réputées comme étant complètes, exactes ou à propos.Ni Morningstar, ni ses fournisseurs de contenu ne sont responsables de tout dommage ou toutes pertes découlant d'une quelconque utilisation de ces informations.Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. Etoiles Morningstar à la date du 28/02/2023. Note Sustainability à la date du 31/01/2023.