

ABN AMRO ESG Profile 2

un compartiment de ABN AMRO Funds

Catégorie Morningstar : Allocation EUR Prudente - International ★★

Note Morningstar de durabilité :

Informations clés

► Valeur liquidative	EUR 98,42
► Actif net	EUR 167 M
► Code ISIN	LU1586379015
► Duration	4,41
► Rating moyen du fonds	A
► YTM moyen	3,98
► Classification SFDR	Art, 8 – produit d'investissement ESG

Profil du fonds

► Ce compartiment est un fonds dit « défensif » donnant accès à un portefeuille diversifié de façon optimale et pouvant être composé d'une combinaison de classes d'actifs comme des actions, des obligations, des placements alternatifs et des titres de créance à court terme. Le compartiment promeut les caractéristiques environnementales et sociales et remplit les conditions requises pour être qualifié de produit d'investissement conformément à l'article 8, paragraphe 1, du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers. À cet égard, l'univers éligible est déterminé par les critères suivants tels que Filtres d'exclusion et Une approche sélective ou approche « best in class ».

► **Objectif:** ABN AMRO Funds Profile 2 vise à augmenter la valeur de ses actifs à moyen terme en combinant les stratégies d'investissement les plus attractives issues d'une sélection rigoureuse des acteurs de premier plan au niveau mondial. Le gestionnaire peut dévier de l'allocation indiquée ci-dessus en faisant des choix tactiques basés sur ses anticipations de marché. Le fonds fait l'objet d'une gestion active qui bénéficie de l'expertise et de la politique d'investissement responsable d'ABN AMRO Investment Solutions.

Gestionnaire (s) du portefeuille

Kevin Sorel	
Expérience dans l'industrie depuis	2006
Dans l'entreprise depuis	2007

Caractéristiques principales

Catégorie d'actions	Classe A
Date de création	17/12/2019
Nature juridique	SICAV de droit Luxembourgeois
Affectation des revenus	Capitalisation
Indice	20% (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 + 60% 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	1,00%
Frais estimés courants	1,2%
Frais d'entrée max	5,00%
Frais de sortie max	1,00%
Investissement minimal	EUR 100
Souscription / Rachat	16h00 CET, J-1
Code Bloomberg	AAMP2A2 LX

Performances*



	Fonds	Indice	Ecart
1 mois	-0,62%	0,20%	-0,82%
3 mois	3,06%	3,08%	-0,02%
YTD	0,43%	0,53%	-0,10%
1 an	6,14%	7,45%	-1,31%
3 ans	-2,98%	1,23%	-4,21%
5 ans	-	-	-
10 ans	-	-	-
Depuis création	-1,58%	3,82%	-5,40%
2023	6,82%	8,46%	-1,64%
2022	-12,60%	-10,83%	-1,77%
2021	3,42%	3,97%	-0,55%
2020	1,60%	2,81%	-1,21%
2019	-	-	-

* 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	4,20%	5,91%	3,77%	5,73%
Tracking error	1,04%	1,17%	-	-
Ratio de Sharpe	0,57	-0,37	0,97	-0,14

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.



Répartition par Classe d'actifs

	Fonds	Indice
Obligations	75,49%	70,00%
Actions	19,70%	20,00%
Liquidités	4,81%	10,00%

Principales positions

Nom	%
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.01% 3...	2,08%
FRANCE (REPUBLIC OF)	1,42%
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.75% 2...	1,28%
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND	1,08%
EUROPEAN ECONOMIC COMMUNITY 0.800%...	1,06%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC)	1,01%
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 3.25% 3...	0,92%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC) 2.300% ...	0,88%
GERMANY (FEDERAL REPUBLIC) 1.300% ...	0,85%
SPAIN (KINGDOM OF) 0.700% 30/04/2032	0,79%
Total Top 10	11,36%

Devise (%)

	Fonds	Indice
EUR EURO	83,05%	85,17%
USD DOLLAR USA	10,47%	7,01%
GBP POUND GBR	1,89%	2,18%
CHF FRANC CHE	1,26%	1,43%
JPY YEN JPN	0,51%	0,59%
Autres	2,81%	3,61%

Actions | Secteur (%)

	Fonds	Indice
Technologies de l'Information	21,64%	17,30%
Finance	16,52%	17,08%
Industrie	14,03%	12,99%
Soins de Santé	12,29%	12,61%
Consommation Discrétionnaire	12,19%	11,24%
Biens de Conso. de Base	7,12%	8,30%
Services de Communication	6,82%	5,70%
Matériaux	6,15%	5,35%
Energie	2,38%	4,83%
Immobilier	0,58%	1,59%
Services aux Collectivités	0,29%	3,01%

Actions | Géographique (%)

	Fonds	Indice
Etats-Unis	37,59%	33,51%
France	9,69%	9,18%
Royaume-Uni	8,83%	10,06%
Allemagne	8,47%	6,54%
Suisse	7,09%	7,79%
Pays-Bas	3,90%	4,17%
Italie	2,58%	1,79%
Japon	2,52%	2,97%
Chine	2,25%	2,32%
Espagne	2,19%	1,97%
Autres	14,88%	19,69%

Actions | Capitalisation (%)

	Fonds	Indice
Micro capitalisation (<0.5Mds. €)	0,00%	0,00%
Petite capitalisation (0.5 à 2Mds. €)	1,05%	0,05%
Moyenne capitalisation (2 à 5Mds. €)	4,02%	1,30%
Grande capitalisation (5 à 20Mds. €)	17,41%	15,96%
Mega capitalisation (>20Mds. €)	77,52%	82,68%

Obligations | Secteur (%)

	Fonds	Indice
Treasury	50,92%	43,40%
Agences	2,77%	7,19%
Autorités locales	0,84%	2,97%
Souverain	5,49%	4,06%
Supranational	3,54%	4,88%
Industrie	11,86%	16,86%
Services aux Collectivités	3,08%	2,05%
Institution financières	17,32%	11,00%
ABS	0,00%	0,01%
CMBS	0,00%	0,00%
Covered	2,68%	7,03%
Non Classés	1,50%	0,55%

Obligations | Géographique (%)

	Fonds	Indice
France	19,97%	19,07%
Allemagne	13,50%	16,80%
Espagne	12,09%	8,63%
Italie	9,93%	11,51%
Etats-Unis	5,14%	7,23%
Pays-Bas	4,86%	4,68%
Royaume-Uni	3,70%	2,22%
Supra National	3,30%	4,06%
Belgique	2,81%	2,61%
Autriche	2,50%	2,19%
Autres	22,20%	21,00%

Obligations | Rating (%)

	Fonds	Indice
AAA	18,61%	22,37%
AA	19,34%	22,70%
A	12,44%	11,41%
BBB	24,16%	22,36%
BB	7,12%	5,14%
B	1,19%	3,74%
CCC	0,18%	1,05%
CC	0,05%	0,08%
C	0,00%	0,02%
D	0,00%	0,08%
NR	0,65%	0,01%
NA	16,24%	11,04%

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 influencer 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: 119-121, boulevard Haussmann 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.

© 2024 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 31/01/2024. Note Sustainability à la date du 31/12/2023.

Obligations | Duration (%)

	Fonds	Indice
<1	9,01%	6,27%
>1 <3	24,71%	31,06%
>3 <5	22,82%	26,01%
>5 <7	9,86%	17,36%
>7 <10	21,92%	17,50%
>10 <15	6,44%	0,38%
>15	5,23%	1,43%