

Robeco 3D European Equity UCITS ETF EUR Acc

L'ETF Robeco 3D European Equity UCITS est un Sous-fonds géré de manière active qui investit dans les actions d'entreprises cotées sur les marchés européens et qui appliquera la stratégie d'investissement « 3D » du gérant, qui cherche à prendre en compte le risque, le rendement et la durabilité dans le portefeuille du Sous-fonds. Le portefeuille du Sous-fonds sera optimisé à l'aide d'un processus quantitatif afin de viser des rendements supérieurs à l'Indice de référence, des caractéristiques de durabilité supérieures à l'Indice de référence et de gérer le risque par rapport à l'Indice de référence. Les trois dimensions du risque, du rendement et de la durabilité sont prises en compte ensemble dans le modèle quantitatif de classement de titres propriétaire du gérant.



Wilma de Groot, Machiel Zwanenburg, Vania Sulman, Wouter Tilgenkamp, Koen Rijnen, Dean Walsh
Gère le fonds depuis le 2024-10-10

La législation MiFID actuelle nous empêche de communiquer des données de performance pour les fonds disposant d'un historique de performances de moins de 12 mois.

Indice

MSCI Europe Index

General Information

Primary ticker	3D3D
ISIN	IE0007WLHX89
Product structure	Physical
Fund management approach	Active
Investment strategy type	Enhanced
Asset Class	Actions
SFDR classification	8
Fund base currency	EUR
Share class currency	EUR
Actif du fonds	EUR 11.909.083
Montant de la catégorie d'action	EUR 11.909.083
Share class outstanding shares	2.200.000
Share class inception date	2024-10-10
Date de clôture de l'exercice	12-31
Share class ongoing charges	0,25%
Use of Income	Capitalisation
Tracking error ex-ante max.	-
Management company	Robeco Institutional Asset Management B.V.

Objectif d'investissement

L'ETF Robeco 3D EU Equity UCITS est un Sous-fonds géré de manière active qui investit dans les actions d'entreprises cotées sur les marchés européens et qui appliquera la stratégie d'investissement "3D" du gérant, qui cherche à prendre en compte le risque, le rendement et la durabilité dans le portefeuille du Sous-fonds. Le portefeuille du Sous-fonds sera optimisé à l'aide d'un processus quantitatif afin de viser des rendements supérieurs à l'Indice de référence, des caractéristiques de durabilité supérieures à l'Indice de référence et de gérer le risque par rapport à l'Indice de référence. Les trois dimensions du risque, du rendement et de la durabilité sont prises en compte ensemble dans le modèle quantitatif de classement de titres propriétaire du gérant.

Profil de durabilité

- Exclusions+
- Intégration ESG
- Vote
- Objectif ESG

Pour plus d'informations sur les exclusions, consultez <https://www.robeco.com/exclusions/>

10 principales positions

Le Top 10 du fonds est essentiellement le reflet des sociétés considérablement pondérées au sein de l'indice.

Cotation

25-08-31	EUR	5,43
High Ytd (25-08-22)	EUR	5,54
Plus bas de l'année (25-04-09)	EUR	4,54

Statut légal

Fund Legal Structure	Irish Collective Asset-management Vehicle
Domicile	Irlande
Fund UCITS Compliant	Oui
Type de part	A EUR
Robeco UCITS ICAV	

Ce fonds est un sous-fonds de l'ICAV Robeco UCITS.

Autorisé à la commercialisation

Autriche, Danemark, Finlande, France, Allemagne, Irlande, Italie, Luxembourg, Pays-Bas, Norvège, Espagne, Suède, Suisse, Royaume-Uni

Politique de change

Le Sous-fonds est exposé aux fluctuations des taux de change des devises dans lesquelles les actifs du Sous-fonds sont libellés. Dans la gestion du Sous-fonds, les résultats monétaires escomptés seront pris en considération lorsqu'il s'agira de décider de l'allocation/la sélection des titres par pays.

Gestion du risque

Affectation des résultats

Capitalisation

Codes du fonds

ISIN	IE0007WLHX89
Bloomberg	3D3D GT
Sedol	BMCCWQ7
Valoren	139095768

10 principales positions

Positions

SAP SE
Novartis AG
AstraZeneca PLC
Roche Holding AG
Siemens AG
ASML Holding NV
Nestle SA
Schneider Electric SE
HSBC Holdings PLC
UniCredit SpA
Total

Secteur	%
Technologies de l'Information	2,76
Santé	2,51
Santé	2,43
Santé	2,31
Industrie	2,27
Technologies de l'Information	2,20
Biens de Consommation de Base	2,02
Industrie	1,67
Finance	1,49
Finance	1,46
Total	21,13

Top 10/20/30 Pondération

TOP 10	21,13%
TOP 20	34,08%
TOP 30	43,87%

Trading information

Exchange name	Trading currency	Bloomberg ticker	Ticker	SEDOL
LSE - United Kingdom	GBP	-	3DEG LN	BSPS156
SIX - SIX Swiss Exchange AG	CHF	3D3DCHIV	3D3DCHF SW	BS2H5K9
SIX - SIX Swiss Exchange AG	USD	3D3DUSIV	3D3D SW	BS2H5L0
XETRA - Germany	EUR	3D3DEUIV	3D3D GY	BMCCWQ7
Borsa Italiana	EUR	3D3DEUIV	3D3D IM	BS2H5M1

Allocation sectorielle

Le fonds vise à maintenir des positions sectorielles neutres face à l'indice.

Allocation sectorielle		Deviation index	
Finance	24,4%	0,8%	
Industrie	18,2%	-1,0%	
Santé	14,5%	0,9%	
Biens de Consommation de Base	9,3%	-0,6%	
Consommation Discrétionnaire	8,0%	0,0%	
Technologies de l'Information	7,7%	1,0%	
Services de communication	5,0%	0,8%	
Matériels	4,5%	-1,0%	
Énergie	3,4%	-1,0%	
Services aux Collectivités	3,3%	-1,0%	
Immobilier	1,8%	1,0%	

Allocation géographique

Le fonds vise à maintenir des positions sectorielles neutres face à l'indice.

Allocation géographique		Deviation index	
Royaume-Uni	20,3%	-2,3%	
France	17,0%	0,5%	
Allemagne	16,2%	0,8%	
Suisse	13,5%	-1,0%	
Pays-Bas	7,3%	0,5%	
Espagne	6,3%	0,9%	
Italie	5,5%	0,6%	
Suède	4,9%	-0,6%	
Finlande	2,3%	0,7%	
Danemark	2,3%	-0,7%	
Norvège	1,6%	0,7%	
Belgique	1,5%	-0,1%	
Autres	1,3%	0,0%	

Politique d'investissement

L'ETF Robeco 3D European Equity UCITS est un Sous-fonds géré de manière active qui investit dans les actions d'entreprises cotées sur les marchés européens et qui appliquera la stratégie d'investissement « 3D » du gérant, qui cherche à prendre en compte le risque, le rendement et la durabilité dans le portefeuille du Sous-fonds. Le portefeuille du Sous-fonds sera optimisé à l'aide d'un processus quantitatif afin de viser des rendements supérieurs à l'Indice de référence, des caractéristiques de durabilité supérieures à l'Indice de référence et de gérer le risque par rapport à l'Indice de référence. Les trois dimensions du risque, du rendement et de la durabilité sont prises en compte ensemble dans le modèle quantitatif de classement de titres propriétaire du gérant.

Le Sous-fonds promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales au sens de l'Article 8 du Règlement (UE) 2019/2088 du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur financier. Le Sous-fonds tient explicitement compte de la contribution d'une entreprise aux Objectifs de développement durable des Nations Unies (ODD). Le Sous-fonds vise à obtenir des résultats économiques tout en prenant en compte des caractéristiques environnementales, sociales et de gouvernance décrites plus en détail dans le prospectus.

CV du gérant

Wilma de Groot est responsable des Actions Core Quant, responsable de la gestion de portefeuille Actions quantitatives et co-responsable des Actions quantitatives. Elle est responsable des stratégies actions quantitatives et se spécialise dans les anomalies d'évaluation des actifs, la construction de portefeuilles et l'intégration de la durabilité. Elle a publié dans diverses revues académiques, notamment le Journal of Impact and ESG Investing, le Journal of Banking and Finance, le Journal of International Money and Finance, le Journal of Empirical Finance et le Financial Analysts Journal. Elle est conférencière invitée dans plusieurs universités. Wilma a rejoint Robeco en tant qu'analyste quantitative en 2001. Wilma est titulaire d'un Doctorat en finance de l'Université Érasme de Rotterdam et d'un Master en économétrie de l'Université de Tilburg. Elle est en outre titulaire d'un CFA® (Chartered Financial Analyst). Machiel Zwanenburg est gérant de portefeuille Actions quantitatives. Il est spécialisé dans la sélection quantitative de titres et la construction de portefeuilles. L'un de ses domaines d'expertise est l'intégration de la durabilité dans les actions quantitatives. Précédemment, il a occupé le poste de gestionnaire de risques et celui de responsable des risques de portefeuilles clients chez Robeco. Il a rejoint Robeco en 1999 en tant que membre de l'équipe Recherche quantitative. Il est titulaire d'un Master en économétrie de l'Université Érasme de Rotterdam et d'un Master en économie de la London School of Economics. Vania Sulman est gérante de portefeuille Actions quantitatives. Elle est spécialisée dans la sélection de titres et l'intégration de la durabilité dans les portefeuilles personnalisés. Elle a rejoint Robeco en 2022. Précédemment, elle a travaillé en tant qu'analyste de données pendant trois ans et, avant cela, en tant qu'analyste quantitative spécialisée dans la sélection de titres quantitative chez Robeco. Elle a rejoint le secteur et Robeco en 2016. Elle est titulaire d'un Master (cum laude) en finance quantitative de l'Université Érasme de Rotterdam. Wouter Tilgenkamp est gérant de portefeuille Actions quantitatives. Wouter a rejoint Robeco en 2016 en tant que data scientist. Il a commencé sa carrière financière en 2014 en tant que trader de produits dérivés chez Optiver. Il est titulaire d'un Bachelor of Science en mathématiques appliquées de l'Université de technologie de Delft et d'un Master en finance quantitative de l'Université Érasme de Rotterdam. Koen Rijnen est gérant de portefeuille Actions quantitatives. Il est spécialisé dans la construction de portefeuille et l'intégration de la durabilité dans les actions quantitatives. Il a rejoint Robeco en 2022. Précédemment, il était expert en couverture et gestionnaire de bilan chez Aegon. Il a démarré sa carrière dans les services de consultance en 2015 et a rejoint le secteur de l'investissement en 2018. Koen est titulaire d'un Master (cum laude) en génie hydraulique de l'Université de Technologie de Delft, aux Pays-Bas. Il est en outre titulaire d'un CFA® (Chartered Financial Analyst). Dean Walsh est gérant de portefeuille Actions quantitatives. Dean est spécialisé dans la sélection quantitative de titres, la construction de portefeuilles et l'intégration de la durabilité. Avant de rejoindre Robeco en 2023, il a travaillé chez Mercer Global Investments en tant que gérant de portefeuille de devises et en tant que directeur de l'unité Portfolio Intelligence. À ce titre, il a dirigé la recherche quantitative, notamment les travaux sur les portefeuilles factoriels, l'investissement durable et aligné sur l'Accord de Paris, et la gestion des risques. Il a rejoint le secteur en 2013 auprès de JP Morgan. Dean est titulaire d'une maîtrise en finance quantitative de l'University College Dublin. Il est en outre titulaire d'un CFA® (Chartered Financial Analyst) et d'un CAIA® (Chartered Alternative Investment Analyst).

MSCI disclaimer

Source MSCI. MSCI ne fait aucune représentation ni ne donne aucune garantie, expresse ou implicite, et décline toute responsabilité en ce qui concerne les données contenues dans le présent document. Les données MSCI ne peuvent en aucun cas être redistribuées ou utilisées pour servir de base à d'autres indices ou à toute valeur mobilière ou à tout produit financier. Le présent rapport n'est pas approuvé, validé, examiné ou produit par MSCI. Aucune des données MSCI n'est destinée à constituer un conseil en matière d'investissement ni une recommandation visant à prendre (ou à ne pas prendre) toute décision d'investissement et ne doit être invoquée en tant que telle.

Morningstar

Copyright © Morningstar Benelux. Tous droits réservés. Les informations ci-incluses : (1) sont la propriété de Morningstar et/ou de ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être reproduites ou distribuées ; et (3) ne sont pas garanties comme étant exactes, complètes ou à propos. Ni Morningstar ni ses fournisseurs de données ne sont responsables d'éventuels dommages ou des pertes qui pourraient découler de l'utilisation de ces informations. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Pour plus d'informations sur Morningstar, veuillez consulter www.morningstar.com.

Le présent document a été préparé avec soin par Robeco Institutional Asset Management B.V. (Robeco). Les informations contenues dans cette publication sont basées sur des sources d'information considérées comme fiables. Robeco ne peut être tenu responsable quant à l'exactitude et l'exhaustivité des faits, opinions, prévisions et résultats indiqués dans celle-ci. Bien que le présent document ait été préparé avec le plus grand soin, nous déclinons toute responsabilité en cas de dommages de quelque nature que ce soit résultant d'informations erronées ou incomplètes. Le présent document peut être modifié sans avertissement. La valeur des investissements peut fluctuer. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs. Si la devise dans laquelle la performance passée est indiquée n'est pas celle du pays dans lequel vous résidez, vous devez être conscient qu'en raison des fluctuations de taux de change, la performance indiquée peut être inférieure ou supérieure une fois convertie dans votre devise locale. Sauf indication contraire, les performances sont i) nettes de frais sur la base des cours et ii) avec dividendes réinvestis. Pour plus de renseignements, veuillez consulter le prospectus et le Document d'information clé du fonds. Ceux-ci sont disponibles auprès des agences de Robeco et sur le site web www.robeco.com. Les frais courants mentionnés dans la présente publication expriment le total des coûts associés à la gestion et à l'exploitation du fonds, y compris les frais de gestion, les frais d'administration, les frais de dépôt et les frais bancaires, et sont ceux indiqués dans le dernier rapport annuel du fonds à la date de clôture. Les informations contenues dans le présent document sont destinées uniquement aux investisseurs professionnels au sens de la loi néerlandaise relative au contrôle des marchés financiers (Wet financieel toezicht) ou aux autres personnes autorisées à recevoir ce type d'informations, conformément à toute autre loi applicable. Robeco Institutional Asset Management B.V. est titulaire d'une licence de gestionnaire d'OPCVM et de FIA délivrée par l'autorité néerlandaise des marchés financiers d'Amsterdam.