

# ABN AMRO Profilfonds B

ein Teilfonds des Fonds ABN AMRO Multi-Manager

Monatsbericht 28. Februar 2019 | Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR ausgewogen - Global ★★★★★

## Fondsmerkmale

|                                     |                  |
|-------------------------------------|------------------|
| ▶ NAV                               | EUR 105,89       |
| ▶ Nettovermögen                     | EUR 1086 Million |
| ▶ ISIN code                         | LU1253566647     |
| ▶ Duration                          | 4,94             |
| ▶ Fonds Durchschnittliche Bewertung | BBB+             |
| ▶ YTM durchschnittlich              | 2,92             |

## Fondsprofil

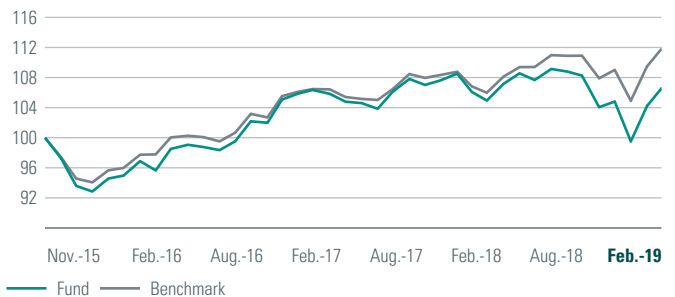
▶ **Strategie** : Der ABN AMRO Profilfonds B ist ein "moderat aggressiver" Investmentfonds, der ein alternatives Portfolio aus Anleihen, alternativen Anlagen und kurzfristigen Schuldverschreibungen bietet. Es ist ein aktiver Fonds, der die attraktivsten und sorgfältigsten Anlagestrategien von weltweit führenden Vermögensverwaltern kombiniert. In Anbetracht der Marktumstände können bestimmte Anlagestile hervorgehoben werden.

▶ **Ziel**: ABN AMRO Profilfonds B zielt darauf ab, seine Composite-Benchmark 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.

## Informationen zum Fonds

|                                 |   |
|---------------------------------|---|
| Anteilsklasse                   | ABN AMRO Profilfonds B  |
| Auflegungsdatum                 | 04/11/2015  |
| Rechtsform                      | Luxemburger SICAV   |
| Anteilstyp                      | Ausschüttend  |
| Benchmark                       | 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 |
| Währung                         | EUR   |
| Bewertung                       | Täglich   |
| Verwahrstelle                   | State Street Bank Luxembourg  |
| Delegierung der Kontoverwaltung | State Street Bank Luxembourg  |
| Maximale Verwaltungsgebühr      | 1,25%   |
| Laufende Kosten                 | 1,43%   |
| Ausgabeaufschlag                | 5,00%   |
| Rücknahmegebühren               | 1,00%   |
| Mindestanlage                   | EUR 100   |
| Zeichnung / Rücknahme           | 16:00 CET   |
| Bloomberg Code                  | AADVP4B:LX  |

## Performance\*



|              | Fonds  | Benchmark | Differenz |
|--------------|--------|-----------|-----------|
| 1 Monat      | 2,27%  | 2,14%     | 0,13%     |
| 3 Monat      | 1,68%  | 2,57%     | -0,89%    |
| Lfd. Jahr    | 7,09%  | 6,57%     | 0,52%     |
| 1 Jahr       | 0,43%  | 4,66%     | -4,22%    |
| 3 Jahre      | 14,77% | 18,86%    | -4,10%    |
| 5 Jahre      | -      | -         | -         |
| 10 Jahre     | -      | -         | -         |
| Seit Auflage | 8,11%  | 13,28%    | -5,16%    |
| 2018         | -7,52% | -3,15%    | -4,37%    |
| 2017         | 5,31%  | 5,00%     | 0,31%     |
| 2016         | 5,06%  | 5,93%     | -0,87%    |
| 2015         | -      | -         | -         |
| 2014         | -      | -         | -         |

## Risikokennziffern

|                | Fonds  |         | Benchmark |         |
|----------------|--------|---------|-----------|---------|
|                | 1 Jahr | 3 Jahre | 1 Jahr    | 3 Jahre |
| Volatilität    | 7,31%  | 6,57%   | 6,17%     | 5,34%   |
| Tracking error | 1,54%  | 1,71%   | -         | -       |
| Sharpe - Ratio | 0,11   | 0,76    | 0,80      | 1,16    |

\* Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Entwicklung. Wertentwicklung auf Basis des Netto-Inventarwertes ohne Ausgabeaufschlag, nach Abzug der Verwaltungsvergütung.

## Portfolio Manager(s)

Kevin Sorel

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Branchenerfahrung seit    | 2006 |
| Im Unternehmen tätig seit | 2007 |



**Anlageklassen (%)**

|            | Fund   | Benchmark |
|------------|--------|-----------|
| Aktien     | 53,63% | 55,00%    |
| Anleihen   | 28,40% | 35,00%    |
| Liquidität | 14,97% | 10,00%    |
| Andere     | 3,01%  | 0,00%     |

**Größte Positionen (%)**

|                                      | %     |
|--------------------------------------|-------|
| BARCLAYS ROLL YIELD COMMODITIES FUND | 3,01% |
| CAP GEMINI SA                        | 0,51% |
| PRUDENTIAL PLC                       | 0,51% |
| MICROSOFT CORP                       | 0,48% |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA                | 0,43% |
| TOTAL SA                             | 0,42% |
| TECHNIPFMC PLC COMMON STOCK USD1.0   | 0,41% |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD            | 0,39% |
| HSBC HOLDINGS PLC                    | 0,39% |
| DANAHER CORP                         | 0,38% |
| Top 10 Gesamt                        | 6,94% |

**Währung (%)**

|                      | Fund   | Benchmark |
|----------------------|--------|-----------|
| EUR EURO             | 58,32% | 56,25%    |
| USD US-DOLLAR        | 21,81% | 20,51%    |
| GBP BRITISCHES PFUND | 5,68%  | 7,64%     |
| JPY JAPANISCHER YEN  | 2,52%  | 2,32%     |
| HKD HONGKONG-DOLLAR  | 2,47%  | 1,64%     |
| Sonstige             | 9,20%  | 11,63%    |

**Aktien | Sektor (%)**

|                         | Fund   | Benchmark |
|-------------------------|--------|-----------|
| Finanzwesen             | 19,56% | 18,13%    |
| Industriesektor         | 16,43% | 11,42%    |
| Gesundheitswesen        | 12,35% | 11,88%    |
| Informationstechnologie | 11,11% | 11,40%    |
| Konsumgüter zyklisch    | 10,79% | 10,29%    |
| Konsumgüter             | 8,15%  | 10,34%    |
| Energieversorger        | 7,34%  | 7,10%     |
| Kommunikationsdienste   | 6,53%  | 7,28%     |
| Gebrauchsgüter          | 3,93%  | 6,07%     |
| Versorgungssektor       | 2,28%  | 3,57%     |
| Immobiliensektor        | 1,52%  | 2,53%     |
| Nicht klassifiziert     | 0,00%  | 0,00%     |

**Aktien | Länder (%)**

|                | Fund   | Benchmark |
|----------------|--------|-----------|
| USA            | 32,72% | 31,08%    |
| Großbritannien | 12,19% | 12,27%    |
| Frankreich     | 9,32%  | 8,70%     |
| Deutschland    | 6,02%  | 6,89%     |
| China          | 5,71%  | 2,79%     |
| Japan          | 5,24%  | 4,23%     |
| Niederlande    | 5,10%  | 3,83%     |
| Schweiz        | 3,15%  | 7,58%     |
| Italien        | 2,56%  | 1,61%     |
| Südkorea       | 2,08%  | 1,37%     |
| Sonstige       | 15,91% | 19,65%    |

**Aktien | Kapitalisierung (%)**

|                            | Fund   | Benchmark |
|----------------------------|--------|-----------|
| Micro cap (<0.5Mrd€)       | 0,66%  | 0,00%     |
| Small cap (0.5 nach 2Mrd€) | 4,70%  | 0,19%     |
| Middle cap (2 nach 5Mrd€)  | 10,23% | 2,75%     |
| Large cap (5 nach 20Mrd€)  | 30,32% | 24,88%    |
| Mega cap (>20Mrd€)         | 54,09% | 72,18%    |

**Anleihen | Sektor (%)**

|                                  | Fund   | Benchmark* |
|----------------------------------|--------|------------|
| US Staatsanleihen                | 41,24% | 0,00%      |
| Öffentliche Institutionen        | 7,15%  | 1,39%      |
| Kommunalobligationen             | 0,36%  | 0,00%      |
| Staatsanleihen                   | 11,19% | 5,65%      |
| Supranationale                   | 0,35%  | 0,00%      |
| Industrieanleihen                | 22,17% | 0,02%      |
| Versorgungsanleihen              | 2,24%  | 0,01%      |
| Finanzanleihen                   | 13,94% | 0,00%      |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,23%  | 0,00%      |
| Mortgage Backed Securities       | 0,47%  | 0,00%      |
| Nicht klassifiziert              | 0,48%  | 92,92%     |
| Nicht definiert                  | 0,17%  | 0,00%      |

**Anleihen | Länder (%)**

|                | Fund   | Benchmark* |
|----------------|--------|------------|
| Frankreich     | 12,84% | 0,00%      |
| Deutschland    | 12,41% | 0,00%      |
| USA            | 10,23% | 0,00%      |
| Italien        | 8,66%  | 0,00%      |
| Spanien        | 7,24%  | 0,00%      |
| Großbritannien | 5,00%  | 0,03%      |
| Niederlande    | 3,65%  | 0,02%      |
| Belgien        | 3,21%  | 0,00%      |
| Mexiko         | 2,31%  | 0,34%      |
| Indonesien     | 1,59%  | 0,31%      |
| Sonstige       | 32,87% | 99,31%     |

**Anleihen | Ratings (%)**

|     | Fund   | Benchmark* |
|-----|--------|------------|
| AAA | 11,53% | 0,00%      |
| AA  | 13,94% | 0,10%      |
| A   | 12,10% | 0,82%      |
| BBB | 35,20% | 2,55%      |
| BB  | 9,91%  | 1,38%      |
| B   | 12,86% | 2,07%      |
| CCC | 2,62%  | 0,08%      |
| CC  | 0,04%  | 0,00%      |
| C   | 0,00%  | 0,01%      |
| D   | 0,06%  | 0,06%      |
| NR  | 0,69%  | 92,86%     |
| NA  | 1,05%  | 0,06%      |

**Wichtige Hinweise**

\*Informationen zum Anleihen-Anteil der Benchmark sind in Produktion.  
Unverbindliche Informationen.  
Die vorliegenden Informationen stellen weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten dar. Bitte prüfen Sie selbst, ob die für Sie geltenden Vorschriften den Kauf oder Verkauf bzw. den Vertrieb des Produktes zulassen und ob die Investition mit Ihren Zielen sowie mit den für Sie geltenden gesetzlichen und steuerlichen Anforderungen übereinstimmt. Für diesen Investmentfonds werden keinerlei Garantien gewährt. Wechselkursschwankungen können den Wert Ihrer Investition positiv oder negativ beeinflussen. Nähere Einzelheiten zu den Produktisiken entnehmen Sie bitte dem Abschnitt „Risikoprofil“ des Verkaufsprospektes. Jede Anlage in diesen Fonds sollte erst nach Kenntnisnahme des geltenden Verkaufsprospektes erfolgen, der auf einfache Anfrage bei ABN AMRO Investment Solutions oder auf [www.abnamroinvestmentsolutions.com](http://www.abnamroinvestmentsolutions.com) erhältlich ist. Die Portfolioverwaltungsgesellschaft ABN AMRO Investment Solutions wurde unter der Nummer GP 99-27 von der französischen Finanzmarktaufsichtsbehörde AMF zugelassen. Aktiengesellschaft (nach niederländischem Recht) (naamloze vennootschap) mit Vorstand und Aufsichtsrat und einem Kapital in Höhe von EUR 4.324.048. Hauptverwaltung: 3, avenue Hoche, 75008 Paris, Frankreich.  
Der Zugriff auf die Produkte und Dienstleistungen kann für bestimmte Personen bzw. Länder Einschränkungen unterliegen. Nähere Einzelheiten hierzu erfahren Sie bei Ihrem üblichen Ansprechpartner.  
Sterne-Rating von Morningstar Inc, alle Rechte vorbehalten. Notation Overall ab Ende des Vormonats. **Quelle: ABN AMRO Investment Solutions, State Street.**

**Anleihen | Laufzeiten(%)**

|         | Fund   | Benchmark* |
|---------|--------|------------|
| <1      | 8,35%  | 92,93%     |
| >1 <3   | 23,06% | 0,86%      |
| >3 <5   | 22,01% | 1,29%      |
| >5 <7   | 17,71% | 1,06%      |
| >7 <10  | 16,88% | 1,53%      |
| >10 <15 | 4,53%  | 0,52%      |
| >15     | 7,47%  | 1,81%      |