



Fund Profile

Zwitserleven Duurzaam Index Aandelenfonds Europa investes direct en indirect, via ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Europa, in een duurzame manier in aandelen van listede Europese bedrijven. Het fonds wordt beheerd op een systematische manier. Het doel is om de rendementen van de MSCI Europe Index Net EUR zo dicht mogelijk te benaderen, rekening houdend met de exclusiecriteria. Investigingen worden alleen gemaakt in aandelen die niet zijn uitgesloten op basis van de algemene en aanvullende exclusiecriteria zoals vastgelegd in de Algemene en Aanvullende Exclusiecriteria zoals vastgelegd in de Algemene en Aanvullende Exclusiecriteria van ACTIAM. Dit resulteert in een afwijking (tracking error) met betrekking tot de index. Het geld dat beschikbaar wordt gemaakt door de exclusie van bedrijven wordt geïnvesteerd op een manier die de tracking error minimaliseert. Shorten is niet toegestaan en het wisselkoersrisico wordt niet gehedged.

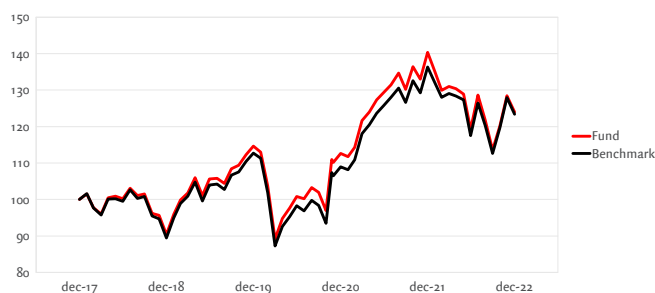
Performance and risk characteristics

	Fund	Benchmark
Standard deviation 36m	18,26%	18,30%
Sharpe ratio 36m	0,14	0,16
Tracking error (ex-ante)	1,07%	
Percentage ESG exclusions	8,92%	

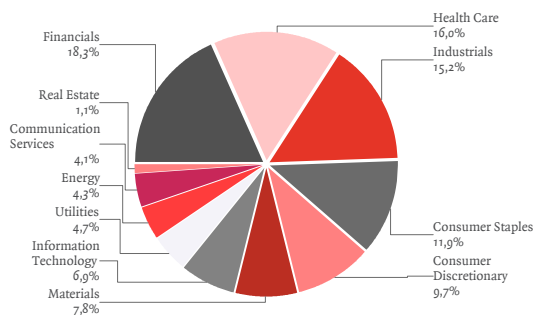
Net Performance²

	Fund		Benchmark		
1 month	-3,43%		-3,51%		
3 months	9,19%		9,55%		
12 months	-11,66%		-9,49%		
3 years, annualised	2,67%	¹⁾	3,07%		
5 years, annualised	4,40%	¹⁾	4,30%		
2022	-11,66%		-9,49%		
	2017	2018	2019	2020	2021
Fund	11,04%	-9,59%	26,76%	-1,72%	24,65%
Benchmark	10,24%	-10,57%	26,05%	-3,32%	25,13%

Price Index Fund²



Sectors



Key Information as of December 31st 2022

Investment Institution	Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen
Currency	Euro
Inception Date	11-25-2020
Fund Manager	ACTIAM N.V.
Asset Manager	ACTIAM N.V.
Country of Residence	The Netherlands
Benchmark	MSCI Europe Index Net EUR
Ongoing charges figure	0,020% (2021)
Obtainable via	Insurance product Zwitserleven

Prices (Euro) and Facts

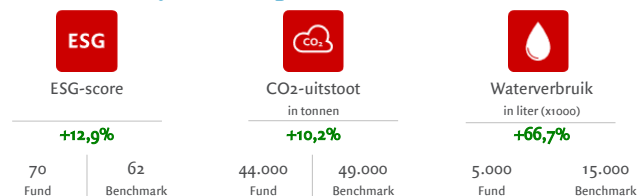
Net Asset Value End of Month	27,94
Highest price 12 months	32,07
Lowest price 12 months	25,25
Fund size	560.191.593
Outstanding participations	20.046.500
SFDR classification	9

Fundamental Investment Principles (ESG-criteria)*

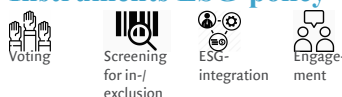


* Click the symbols for more information

Sustainability and Impact³



Instruments ESG-policy



(*Click the symbols for more information)

Top Holdings

Nestle -Reg	3,45%	Asml Holding Nv	2,36%
Astrazeneca	2,53%	Novartis -Reg	2,34%
Novo Nordisk A/S-B	2,46%	Unilever	1,45%
Lvmh Moet Hennessy Louis V	2,43%	Hsbc Holdings	1,42%
Roche Holding -Genuss	2,40%	Sanofi	1,34%

Currency and country allocation

EUR	50,08%	United Kingdom	22,19%
GBP	22,74%	France	17,21%
CHF	15,64%	Switzerland	16,00%
SEK	5,18%	Germany	12,37%
DKK	4,49%	Netherlands	6,89%
Other	1,86%	Others	25,33%