

FACTSHEET

RZL Euro Obligatiefonds



Fondsprofiel

RZL Euro Obligatiefonds belegt in euro staatsobligaties en in bedrijfsobligaties waarvan minimaal 90% met een minimale gemiddelde rating van BBB- en maximaal 10% met een lagere gemiddelde rating. De gewogen gemiddelde waardering voor alle beleggingen is minimaal A-. Aan alle debiteuren en/of vermogenstitels in het beleggingsuniversum wordt een ESG-score toegekend. De ESG-score van de portefeuille is altijd hoger dan de ESG-score van de benchmark. Het fonds heeft als beleggingsdoel een rendement te behalen dat ten minste gelijk is aan dat van de samengestelde benchmark en tegelijkertijd een zo hoog mogelijk ESG-score te realiseren.

Kerngegevens per 31 december 2020

| | |
|----------------------|--|
| Beleggingsinstelling | RZL Beleggingsfondsen N.V. |
| Valuta van notering | Euro |
| Oprichtingsdatum | 20-10-1997 |
| Fondsbeheerder | ACTIAM N.V. |
| Land van vestiging | Nederland |
| Benchmark | 50% iBoxx € Sovereign 1-10 Index (TR) en 50% iBoxx € Non Sovereign Index (TR) |
| Lopende kostenfactor | 0,70% (2019) |
| Beschikbaar via | Verzekeringproduct Reaal of Zwitserleven |



Rendement en risico karakteristieken

| | |
|------------------------|--------|
| Standaard deviatie 36m | 2,67% |
| Sharpe ratio 36m | 0,63 |
| Effectief rendement | -0,08% |
| Gemiddelde rating | A- |
| Modified duration | 5,06 |

Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)

Ondernemingen worden beoordeeld op sociaal-ethische principes op het gebied van mens, milieu en maatschappij. Onacceptabel gedrag ten aanzien van deze thema's kan leiden tot uitsluiting, waarbij ondernemingen tevens worden beoordeeld op de potentie en intentie om verandering aan te brengen.



De legenda geeft aan voor hoeveel procent het fonds voldoet aan de Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)

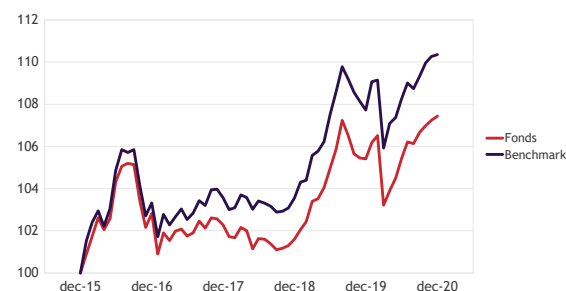
Rendement op basis van handelskoersen

| | |
|--------------------------------------|-------|
| 1 maand | 0,18% |
| 12 maanden | 1,91% |
| 3 jaar, geannualiseerd ¹⁾ | 1,65% |
| 5 jaar, geannualiseerd ¹⁾ | 1,44% |
| 2020 | 1,91% |

Koersen (euro) en fondsfeiten

| | |
|---------------------------------|-------------|
| Koers ultimo maand | 28,26 |
| Hoogste koers 12 maanden | 28,34 |
| Laagste koers 12 maanden | 26,83 |
| Intrinsieke waarde ultimo maand | 26,84 |
| Dividend over boekjaar 2020 | 0,00 |
| Fondsomvang | 556.143.523 |
| Uitstaande participaties | 20.719.753 |

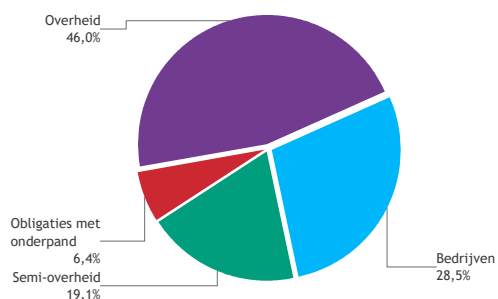
Geïndexeerd rendementsverloop



Debiteuren / ratings

| | |
|-----------------------------------|--------|
| Debiteuren (vijf grootste) | |
| Italië | 12,37% |
| Duitsland | 7,84% |
| Frankrijk | 7,78% |
| Oostenrijk | 4,58% |
| Spanje | 4,42% |
| Ratings | |
| AAA | 21,81% |
| AA | 28,67% |
| A | 18,04% |
| BBB | 31,06% |
| Overig | 0,42% |

Sectoren



Looptijd spreiding

