



Fondsprofiel

ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Europa belegt op een duurzame wijze in aandelen van beursgenoteerde Europese ondernemingen. Het fonds wordt beheerd op basis van een systematisch beleggingsbeleid. Het doel is, om rekening houdend met de van toepassing zijnde uitsluitingscriteria, het rendement van de index, de MSCI Europe Index Net EUR, zo veel als mogelijk te benaderen. Er wordt uitsluitend belegd in aandelen die niet zijn uitgesloten op basis van de Algemene en Aanvullende Uitsluitingscriteria zoals die door ACTIAM zijn geformuleerd. Dit geeft een afwijking (tracking error) ten opzichte van de index. De vrijkomende middelen vanuit de uitgesloten ondernemingen worden op een zodanige wijze belegd dat de tracking error geminimaliseerd wordt. Securities lending is niet toegestaan en het valutarisico wordt niet afgedekt.

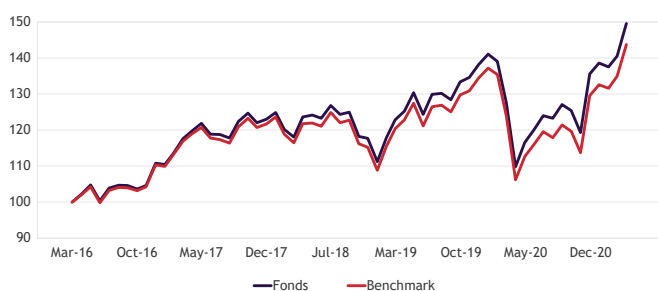
Rendement en Risico karakteristieken

Standaard deviatie 36 maanden	16,31%
Sharpe ratio 36 maanden	0,51
Tracking error	0,93%

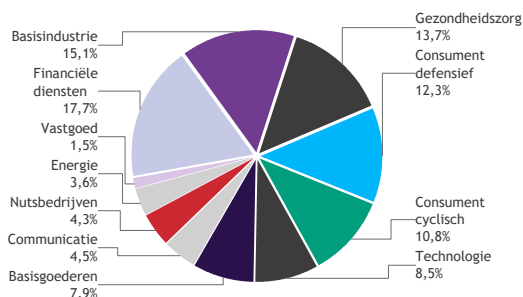
Rendement op basis van intrinsieke waarde

	fonds		benchmark		
1 maand	6,42%		6,47%		
2021	7,94%		8,35%		
12 maanden	36,25%		35,32%		
3 jaars, geannualiseerd ¹	8,21%		7,26%		
10 jaars, geannualiseerd ¹	7,73%		7,08%		
Sinds start, geannualiseerd ¹	5,87%		5,25%		
	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds ¹	3,21%	11,02%	-9,57%	26,78%	-1,73%
Benchmark	2,58%	10,24%	-10,57%	26,05%	-3,32%

Geïndexeerd rendementsverloop



Sectorverdeling



Kerngegevens

Morningstar rating ²	★★★★★
Beleggingsinstelling	ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Europa ³
ISIN-code	NL0014332553
Valuta	Euro
Beursnotering	Euronext Amsterdam
Oprichtingsdatum	12-06-2008
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Benchmark	MSCI Europe Index Net EUR
Lopende kostenfactor	0,08% (2020)

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.



100%



100 - 85%



85 - 65%



< 65%

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

Koersen in euro en fondsfeiten

Koers ultimo maand	24,28
Hoogste koers 12 maanden	24,28
Laagste koers 12 maanden	17,33
Dividend over boekjaar 2019	1,20
Intrinsieke waarde ultimo maand	24,17
Fondsomvang	1.051.944.115
Uitstaande participaties	43.514.962
Aantal holdings	381
Aantal ESG uitsluitingen	55

Top 10 Holdings

Nestle -Reg	3,24%
Asm Lithography Holding	2,57%
Roche Holding -Genuss	2,39%
Novartis -Reg	1,98%
Unilever	1,57%
Siemens	1,44%
Astrazeneca	1,40%
Total Se	1,39%
Sap	1,34%
Sanofi	1,26%

Valutaverdeling

EUR	51,95%
GBP	22,54%
CHF	15,03%
SEK	5,58%
DKK	3,69%
NOK	1,14%
USD	0,08%

Landenverdeling

Verenigd Koninkrijk	21,55%
Frankrijk	16,93%
Zwitserland	15,46%
Duitsland	14,91%
Nederland	7,44%
Zweden	5,25%
Spanje	3,85%
Denemarken	3,73%
Italië	3,30%
Overig	7,57%