



Fondsprofiel

Zwitserleven Duurzaam Index Aandelenfonds Europa belegt direct en indirect, via ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Europa, 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

	Fonds	Benchmark
Standaard deviatie 36m	16,27%	16,56%
Sharpe ratio 36m	0,63	0,57
Tracking error	1,02%	
Percentage ESG uitsluitingen	12,27%	

Kerngegevens per 31 augustus 2021

Beleggingsinstelling	Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen
Valuta van notering	Euro
Oprichtingsdatum	25-11-2020
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Vermogensbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Benchmark	MSCI Europe Index Net EUR
Lopende kostenfactor	0,020% (Verwacht)
Beschikbaar via	Verzekeringproduct Zwitserleven

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	30,34
Hoogste koers 12 maanden	30,59
Laagste koers 12 maanden	24,63
Fondsomvang	1.343.723.107
Uitstaande participaties	44.282.057

Rendement op basis van intrinsieke waarde²

	Fonds	Benchmark			
1 maand	2,47%	1,97%			
3 maanden	5,81%	5,63%			
12 maanden	30,40%	30,88%			
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	10,05%	9,19%			
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	9,61%	8,84%			
2021	19,58%	19,81%			
	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds	3,20%	11,04%	-9,59%	26,76%	-1,72%
Benchmark	2,58%	10,24%	-10,57%	26,05%	-3,32%

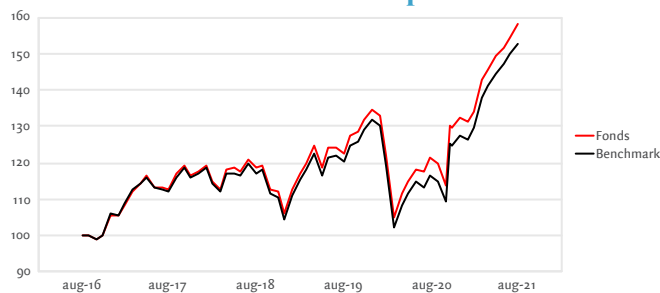
Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)*



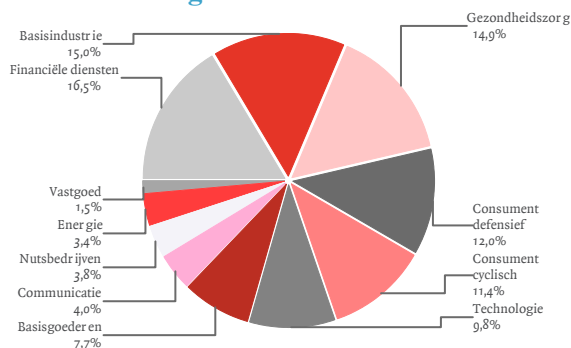
Duurzaamheid en Impact³

ESG	CO2-uitstoot	Waterverbruik
ESG-score	CO2-uitstoot in tonnen	Waterverbruik in liter (x1000)
+10,2%	+28,7%	+74,1%
65 Fonds	92.000 Fonds	14.000 Fonds
59 Benchmark	129.000 Benchmark	54.000 Benchmark

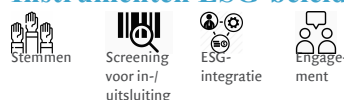
Geïndexeerd rendementsverloop²



Sectorverdeling



Instrumenten ESG-beleid



(*Klik op de symbolen voor meer informatie)

Grootste belangen

Nestle -Reg	3,21%	Novo-Nordisk -B	1,50%
Asm Lithography Holding	3,12%	Sap	1,41%
Roche Holding -Genuss	2,47%	Unilever	1,38%
Novartis -Reg	1,84%	L'Oreal	1,27%
Astrazeneca	1,69%	Siemens	1,23%

Valuta- en landenverdeling

EUR	51,84%	Verenigd Koninkrijk	21,19%
GBP	21,98%	Frankrijk	17,11%
CHF	15,16%	Zwitserland	15,64%
SEK	5,72%	Duitsland	14,12%
DKK	4,16%	Nederland	8,26%
Overig	1,15%	Overig	23,68%