

Fondsprofiel

ACTIAM Duurzaam 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 kredietwaardigheid 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. Het fonds heeft duurzame karakteristieken en beoogt bij te dragen aan lange termijn duurzaamheidsdoelstellingen op het gebied van milieu en sociale ontwikkeling en goed ondernemerschap.

Rendement en Risico karakteristieken

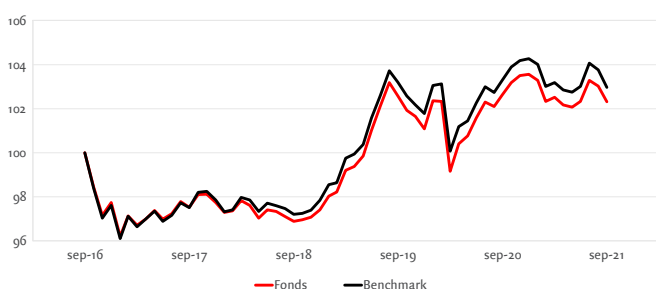
Standaard deviatie 36 maanden	2,77%
Sharpe ratio 36 maanden	0,76
Effectief rendement	0,27%
Gemiddelde rating	A-
Modified duration	4,84

Rendement op basis van intrinsieke waarde

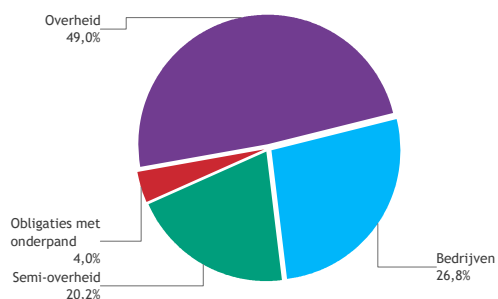
	fonds ¹	benchmark
1 maand	-0,68%	-0,77%
2021	-1,20%	-1,24%
12 maanden	-0,31%	-0,32%
Gem 3 jaar ²	1,83%	1,94%

	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds ¹	3,02%	0,00%	-0,34%	3,77%	2,45%
Benchmark	3,32%	0,24%	-0,01%	4,03%	2,44%

Geïndexeerd rendementsverloop¹



Sectorverdeling



Kerngegevens

Morningstar rating ³	★★★★★
Beleggingsinstelling	ACTIAM Duurzaam Euro Obligatiefonds
ISIN-code	NL0010579090
Valuta	Euro
Beursnotering	Euronext Amsterdam
Oprichtingsdatum	22-02-2018
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	0,35% (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.



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

Koersen in euro en fondsfeiten

Koers ultimo maand	19,46
Hoogste koers 12 maanden	19,98
Laagste koers 12 maanden	19,28
Dividend over boekjaar 2020	0,20
Intrinsieke waarde ultimo maand	19,43
Fondsomvang	67.847.900
Uitstaande participaties	3.492.665

Debiteuren / ratings

Debiteuren (vijf grootste)

Duitsland	13,21%
Frankrijk	10,93%
Italië	9,06%
Spanje	6,61%
Nederland	2,80%
Ratings	
AAA	28,68%
AA	23,15%
A	7,84%
BBB	38,66%
Overig	1,67%

Looptijdspread

