



Fondsprofiel

Zwitserleven Europees Aandelenfonds belegt in ondernemingen uit lidstaten van de Europese Unie, Verenigd Koninkrijk, Zwitserland en Noorwegen. Het beleggingsdoel is om binnen een vastgesteld risicokader, een rendement te behalen dat ten minste gelijk is aan dat van de benchmark. Er wordt uitsluitend belegd in aandelen die voldoen aan ESG-criteria zoals die door ACTIAM zijn geformuleerd. Aan alle ondernemingen in het beleggingsuniversum wordt een ESG-score toegekend. De ESG-score van de portefeuille is altijd hoger dan de ESG-score van de benchmark.

Kerngegevens per 30 september 2020

Beleggingsinstelling	Zwitserleven Beleggingsfondsen
Valuta van notering	Euro
Oprichtingsdatum	01-04-2005
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Benchmark	MSCI Europe Index Net EUR
Lopende kostenfactor	0,040% (2019)
Beschikbaar via	Verzekeringsproduct Zwitserleven (of Reaal)

Rendement en risico karakteristieken

	Fonds	Benchmark
Standaard deviatie 36m	14,10%	14,38%
Sharpe ratio 36m	0,15	-0,02
Tracking error	2,36%	
Active share	60,14	
Percentage ESG uitsluitingen	4,27%	

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	18,83
Hoogste koers 12 maanden	22,67
Laagste koers 12 maanden	14,71
Fondsomvang	1.177.220.055
Uitstaande participaties	62.515.775
Dividend over boekjaar 2019	0,65

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds	Benchmark			
1 maand	-0,54%	-1,41%			
3 maanden	2,07%	0,10%			
12 maanden	-4,35%	-7,76%			
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	2,06%	-0,34%			
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	4,68%	3,21%			
2020	-9,62%	-12,75%			
	2015	2016	2017	2018	2019
Fonds	13,81%	2,33%	9,10%	-8,87%	29,06%
Benchmark	8,22%	2,58%	10,24%	-10,57%	26,05%

Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)*

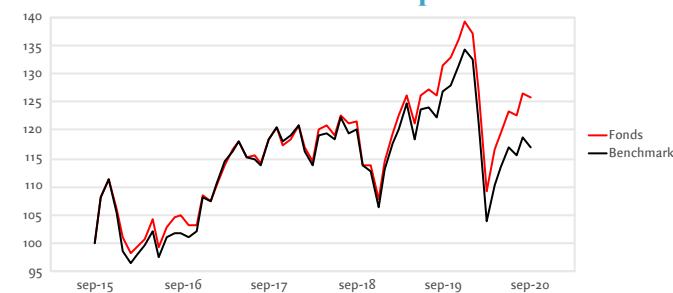


* Klik op de symbolen voor meer informatie

Duurzaamheid en Impact

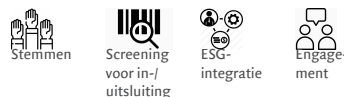
ESG	CO ₂	Waterverbruik
ESG-score ^①	CO ₂ -uitstoot ^①	Waterverbruik ^①
+20,3%	+32,1%	+84,1%
71 Fonds	93.000 Fonds	17.000 Fonds
59 Benchmark	137.000 Benchmark	107.000 Benchmark

Geïndexeerd rendementsverloop



Instrumenten ESG-beleid

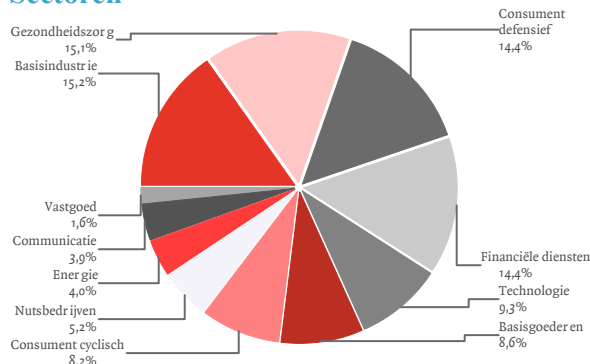
(*Klik op de symbolen voor meer informatie)



Grootste belangen

Nestle -Reg	4,8%
Roche Holding -Genuss	4,7%
Astrazeneca	3,4%
Schneider Electric Se	3,1%
Asm Lithography Holding	3,1%

Sectoren



Landenverdeling

