



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.

Kerngegevens

Morningstar rating ²	★★★★★
Beleggingsinstelling	ACTIAM Beleggingsfondsen I 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% (2021)

Rendement en Risico karakteristieken

	fonds	benchmark
Standaard deviatie 36 maanden	17,77 %	17,85 %
Sharpe ratio 36 maanden	0,18	0,20
Tracking error (ex-ante)	1,18%	

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)

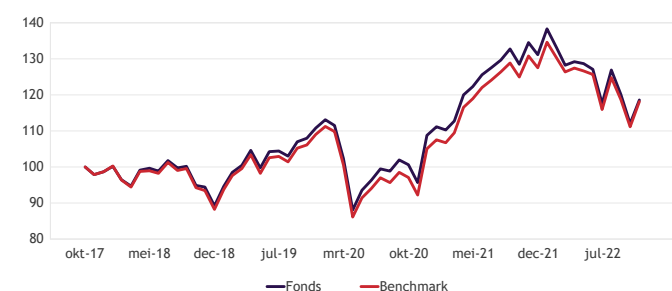
Rendement op basis van intrinsieke waarde

	fonds		benchmark		
1 maand	5,85%		6,22%		
2022	-14,26%		-12,24%		
12 maanden	-11,78%		-9,71%		
3 jaars, geannualiseerd ¹	3,18%		3,63%		
10 jaars, geannualiseerd ¹	7,18%		6,87%		
Sinds start, geannualiseerd ¹	5,12%		4,76%		
	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds ¹	11,02%	-9,57%	26,78%	-1,73%	24,45%
Benchmark	10,24%	-10,57%	26,05%	-3,32%	25,13%

Koersen in euro en fondsfeiten

Koers ultimo maand	22,44
Hoogste koers 12 maanden	27,56
Laagste koers 12 maanden	20,95
Dividenduitkerend	Ja
Intrinsieke waarde ultimo maand	22,44
Fondsomvang	842.056.273
Uitstaande participaties	37.531.297
Aantal holdings	384
Aantal ESG uitsluitingen	47
SFDR classificatie	9

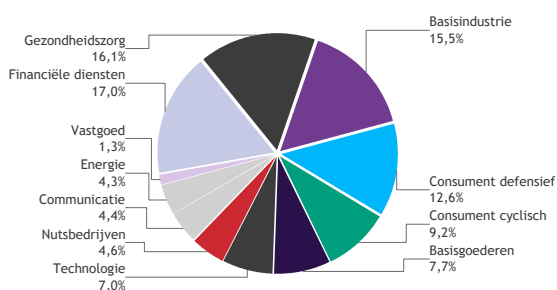
Geïndexeerd rendementsverloop



Top 10 Holdings

Nestle -Reg	3,79%
Roche Holding -Genuss	2,77%
Astrazeneca	2,42%
Lvmh Moet Hennessy Louis V.	2,34%
Asml Holding Nv	2,27%
Novartis -Reg	2,26%
Novo Nordisk A/S-B	2,18%
Unilever	1,45%
Hsbc Holdings	1,43%
Sanofi	1,31%

Sectorverdeling



Valutaverdeling

EUR	49,71%
GBP	22,88%
CHF	16,16%
SEK	5,16%
DKK	4,12%
NOK	1,63%
USD	0,34%

Landenverdeling

Verenigd Koninkrijk	22,45%
Frankrijk	17,48%
Zwitserland	16,51%
Duitsland	12,01%
Nederland	6,77%
Zweden	4,82%
Spanje	4,15%
Denemarken	4,16%
Italië	2,84%
Overig	8,81%