

FACTSHEET Per 31 oktober 2022

ACTIAM Sustainable Index Fund Equity Europe

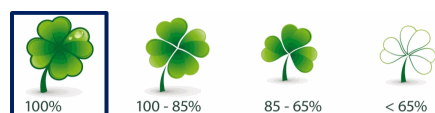
Fondsprofiel

ACTIAM Sustainable Index Fund Equity Europe belegt op een systematische wijze in aandelen van beursgenoteerde Europese ondernemingen. Het doel is om het rendement van de index, de MSCI Europe Index Net EUR, zoveel als mogelijk te benaderen. Er wordt uitsluitend belegd in aandelen die voldoen aan 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.

ESG-criteria

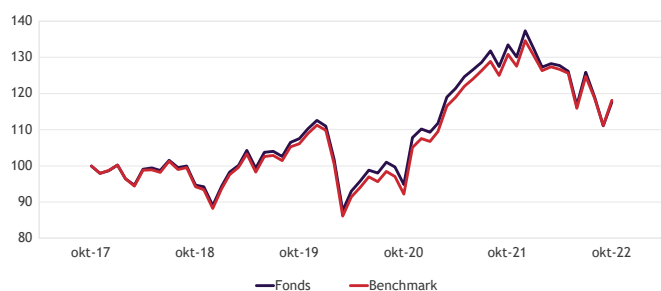
Alle ondernemingen worden beoordeeld op naleving van minimum eisen die gesteld worden aan milieu, sociaal en bestuurlijk beleid en gedrag met gebruikmaking van uitsluitingscriteria. De Algemene Uitsluitingscriteria zijn door ACTIAM geformuleerde beleidsuitgangspunten voor een respectvolle omgang met milieu, mensen en maatschappij. Daarnaast zijn strengere Aanvullende Uitsluitingscriteria van toepassing. Bij beoordeling op deze ESG-criteria wordt, naast de huidige stand van zaken, getoetst in hoeverre ondernemingen in staat en bereid zijn aanpassing te laten zien. Indien dit onvoldoende is naar de beoordeling van ACTIAM worden ondernemingen van belegging uitgesloten.

Legenda uitsluitingscriteria

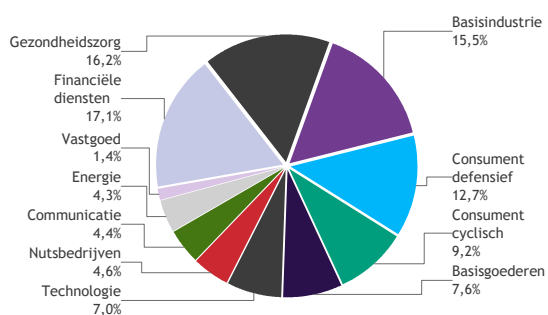


De legenda geeft aan voor hoeveel % het fonds voldoet aan de Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)

Geïndexeerd rendementsverloop



Sectorverdeling



Kerngegevens

Morningstar rating ²	★★★★★
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
ISIN	NL0015000PL4
Oprichtingsdatum	21-06-2013
NAV op startdatum	25,00
Valuta	euro
Ticker	SNSREUA NA
Benchmark	MSCI Europe Index Net EUR
Lopende kostenfactor	nihil
Aantal ESG uitsluitingen	47
Aantal holdings	384

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	fonds	benchmark
1 maand	5,87%	6,22%
2022	-14,42%	-12,24%
12 maanden	-11,95%	-9,71%
3 jaars, geannualiseerd ¹	3,03%	3,63%
5 jaars, geannualiseerd ¹	3,29%	3,39%
10 jaars, geannualiseerd ¹	7,00%	6,87%
Sinds start, geannualiseerd ¹	5,00%	4,76%
Tracking error (ex-ante)	1,18%	

Koersen in euro en fondsfeiten

Koers ultimo maand	46,56
Hoogste koers 12 maanden	55,15
Laagste koers 12 maanden	43,39
Fondsomvang	282.514.042
Uitstaande participaties	6.067.604
SFDR classificatie	9

Grootste belangen

Nestle -Reg	3,78%
Roche Holding -Genuss	2,76%
Astrazeneca	2,40%
Lvmh Moet Hennessy Louis V.	2,31%
Novartis -Reg	2,26%
Asml Holding Nv	2,25%
Novo Nordisk A/S-B	2,22%
Unilever	1,47%
Hsbc Holdings	1,47%
Sanofi	1,31%

Valutaverdeling

EUR	49,69%
GBP	22,61%
CHF	16,41%
SEK	5,17%
DKK	4,18%
NOK	1,61%
USD	0,33%

Landenverdeling

Verenigd Koninkrijk	22,24%
Frankrijk	17,18%
Zwitserland	16,75%
Duitsland	12,09%
Nederland	6,82%
Zweden	4,79%
Denemarken	4,18%
Spanje	4,14%
Italië	2,96%
Overig	8,86%