

Achmea IM ESG Global Equity Fund – I

Factsheet per 31-03-2024

FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Nederland
Oprichtingsdatum	25-2-2020
Beleggingscategorie	Aandelen
Dividend uitkerend	Nee
Basisvaluta	EUR
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNY Mellon
SFDR-classificatie	Artikel 8
Ex ante tracking error	N.v.t.
Lopende kosten factor	0,09%
Benchmark	MSCI World Net Total Return Index

KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 940.351.655
Aantal uitstaande participaties	5.717.237
Intrinsieke waarde	€ 164,48

RISICOCIJFERS

	3 JAAR	5 JAAR
Standaarddeviatie	10,40%	-
Ex post tracking error	6,79%	-
Sharpe-ratio (fonds)	0,91	-
Sharpe-ratio (benchmark)	0,69	-
Informatieratio	-0,04	-

DUURZAAMHEIDSPROFIEL

Het Achmea IM MVB beleid is van toepassing op het Fonds. Het Fonds promoot ESG-kenmerken, maar heeft duurzame beleggingen niet als doel. Meer informatie over de beleidsinvulling is te vinden op achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/mvb. De volgende instrumenten worden ingezet:

- ESG-integratie
- Engagement en stemmen
- Uitsluitingen



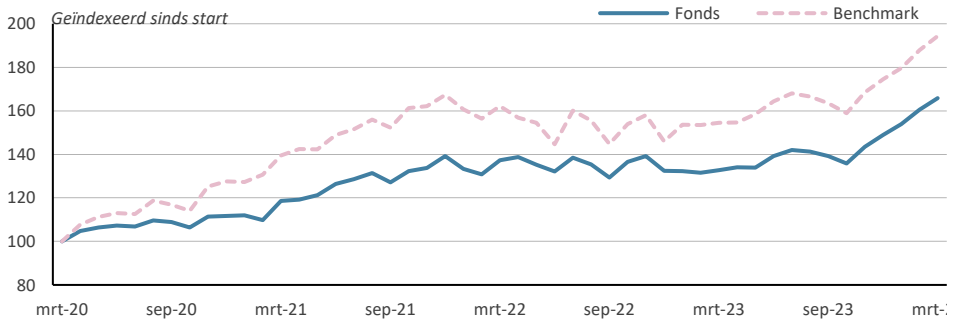
VERHANDELBARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL0015436239
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	15:00 CET

FONDSPROFIEL

Het Fonds belegt in ondernemingen genoteerd in ontwikkelde landen in hoofdzakelijk de eurozone, Noord-Amerika en het Verre Oosten (inclusief Japan). Het Fonds voert een passief beleggingsbeleid. De doelstelling van het Fonds is om de benchmark te volgen. Met enhanced indexing wordt de samenstelling van de benchmark in belangrijke mate gevolgd. Er is geen sprake van volledige replicatie (nabootsing) van de benchmark. Het Fonds heeft daarnaast als doelstelling de CO2-voetafdruk te verkleinen: in 2030 moet deze tenminste 50% lager zijn dan die van de benchmark in 2020. Om dit te realiseren worden de broeikasgasemissies in één keer met 30% verlaagd en daarna tot 2030 jaarlijkse met gemiddeld 7%. De langetermijndoelstelling is een klimaatneutrale portefeuille in 2050.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE



	1 maand	3 maanden	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	3,33%	11,40%	24,92%	11,47%	-	13,31%
Benchmark	3,42%	11,37%	25,86%	11,71%	-	18,17%
Vershil	-0,09%	0,03%	-0,94%	-0,24%	-	-4,86%

	Dit jaar	2023	2022	2021	2020	2019
Fonds	11,40%	12,36%	-4,81%	24,61%	11,68%	-
Benchmark	11,37%	19,60%	-12,78%	31,07%	27,64%	-
Vershil	0,03%	-7,24%	7,97%	-6,46%	-15,96%	-

Meerjarige gegevens zijn geannualiseerd

Fondsrendementen zijn na aftrek van de lopende kosten factor

Vanaf 1 juli 2023 is het beleggingsbeleid gewijzigd. De resultaten van het Fonds tot die datum zijn behaald in omstandigheden die niet volledig vergelijkbaar meer zijn.

VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

De aandelenmarkten beleefden de zesde achtereenvolgende positieve maand waarin verschillende hoogterecords scherper werden gesteld. Goede bedrijfsresultaten stuwden wereldwijde aandelenindices verder omhoog ondanks dat de centrale banken de verwachte renteverlagingen voor zich uitschuiven. De MSCI World Index behaalde een nettorendement van 3,42% en noteerde op maandultimo een nieuw record. Het Fonds behaalde een rendement dat 0,09% lager was dan het benchmarkrendement.

Ga voor meer informatie over onze beleggingsfondsen naar:
achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen

Achmea IM ESG Global Equity Fund – I

Factsheet per 31-03-2024

BENADERING CO₂-VOETAFDRIJK

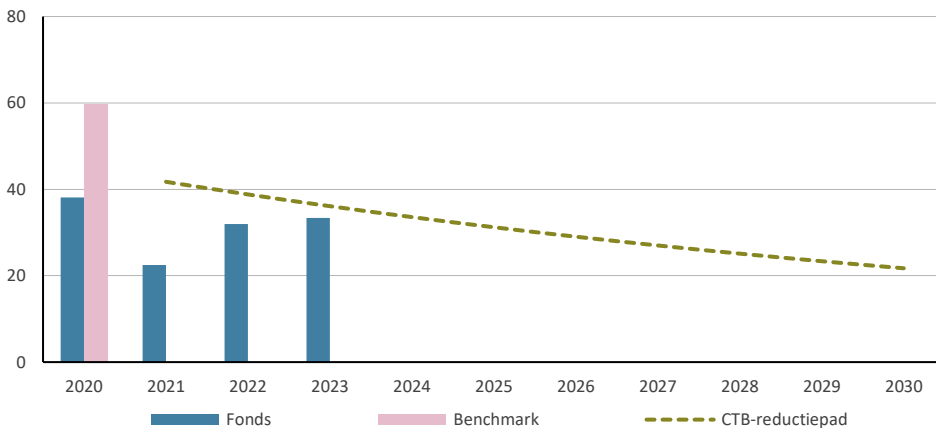
De CO₂-voetafdruk laat de door de portefeuille gefinancierde broeikasgasemissies zien. Om deze CO₂-voetafdruk te bepalen, wordt eerst van elke onderneming in de portefeuille de totale uitstoot van broeikasgassen per jaar berekend. Er wordt daarbij zowel gekeken naar de uitstoot die de onderneming zelf veroorzaakt door bedrijfsactiviteiten (scope 1 volgens het Greenhouse Gas Protocol), als naar de uitstoot die samenhangt met de productie van energie die de onderneming inkoop (scope 2 volgens het Greenhouse Gas Protocol). Dit wordt gedeeld door de ondernemingswaarde inclusief contanten (EVIC). De uitkomst hiervan geeft weer hoeveel broeikasgassen een onderneming uitstoot voor elke euro aan financiering.

Om tot de CO₂-voetafdruk van de hele portefeuille te komen, wordt het gewogen gemiddelde van de CO₂-voetafdrukken berekend van alle ondernemingen waarin wordt belegd. De ondernemingen waarin veel wordt belegd wegen dus zwaarder mee.

DUURZAAMHEID

FIGUUR 2: CO₂-reductiedoelstellingen

Gegevens per 30-06-2023*



*Data wordt per halfjaar geactualiseerd

PORTEFEUILLE ALLOCATIE

	FONDS	% BENCHMARK	%
Communication Services		6,9%	7,3%
Consumer Discretionary		11,2%	10,7%
Consumer Staples		6,4%	6,9%
Energy		4,2%	4,4%
Financials		14,5%	15,0%
Health Care		13,0%	12,5%
Industrials		11,3%	11,0%
Information Technology		23,8%	23,3%
Materials		3,4%	3,9%
Real Estate		2,9%	2,4%
Utilities		2,5%	2,6%

VERDELING NAAR SECTOR

VERDELING NAAR REGIO

	FONDS	% BENCHMARK	%
Verenigde Staten		70,0%	70,3%
Japan		6,6%	6,2%
Verenigd Koninkrijk		4,0%	3,9%
Frankrijk		3,3%	3,2%
Canada		3,0%	3,2%
Zwitserland		2,2%	2,7%
Australië		2,0%	2,0%
Duitsland		1,8%	2,3%
Spanje		1,2%	0,7%
Italië		1,2%	0,7%
Overig		5,0%	5,0%

DISCLAIMER

De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst.

Wie geld belegt neemt een financieel risico. Ook bij dit fonds loopt u een beleggingsrisico. Rendementen kunnen hoger, maar ook lager uitvallen en zullen meer schommelen naarmate de beleggingsvorm risicovoller is. De rendementen in deze factsheet zijn rendementen die in het verleden zijn behaald en garanderen dus niets voor de toekomst. Achmea Investment Management B.V. ("Achmea IM") heeft de informatie in dit document met zorg samengesteld. De informatie is alleen bestemd voor gekwalificeerde beleggers en/of professionele beleggers zoals bedoeld in de Wet op het financieel toezicht (Wft). Dit document is of bevat (i) geen aanbod of uitnodiging om financiële instrumenten te kopen, te verkopen of te verhandelen, (ii) geen beleggingsaanbeveling of beleggingsadvies, (iii) geen juridisch, fiscaal of ander advies. Achmea IM raadt u af een (beleggings)beslissing uitsluitend te baseren op de informatie in dit document. Achmea IM is niet aansprakelijk voor schade die het gevolg is van zo'n (beleggings)beslissing.

De informatie in dit document is (mede) gebaseerd op informatie die Achmea IM van betrouwbaar geachte informatiebronnen heeft verkregen. Achmea IM garandeert niet de betrouwbaarheid van die bronnen en de juistheid en volledigheid van de van die bronnen verkregen informatie. De informatie in dit document is puur informatief en u kunt daaraan geen rechten ontleen. Alle informatie is een momentopname. Achmea IM heeft het recht om deze informatie zonder aankondiging te wijzigen. Het noemen van rendementen op beleggingen in dit document dient uitsluitend als uitleg en toelichting.

Achmea IM spreekt daarmee geen verwachting uit over het rendement of koersverloop van die beleggingen. U mag de informatie in dit document alleen voor eigen persoonlijk gebruik kopiëren. U mag de informatie niet overnemen, vermenigvuldigen, distribueren of openbaren zonder schriftelijke toestemming van Achmea IM. Alle informatie (teksten, foto's, illustraties, grafisch materiaal, handelsnamen, logo's, woord- en beeldmerken) blijft eigendom van of in licentie bij Achmea IM en wordt beschermd door auteursrecht, merkenrecht en/of intellectueel eigendomsrecht. Er worden geen rechten of licenties overgedragen bij gebruik van of toegang tot deze informatie.

Voor dit fonds is een prospectus beschikbaar, waarin de relevante gegevens met betrekking tot dit fonds zijn vermeld. Lees het prospectus voordat u besluit tot belegging in dit fonds. Achmea Investment Management B.V., statutair gevestigd te Zeist (KvK 18059537), beschikt over een vergunning als beheerder van beleggingsinstellingen, zoals bedoeld in de Wet op het financieel toezicht. Achmea Investment Management B.V. is ingeschreven in het register van de Stichting Autoriteit Financiële Markten onder nummer 15001209.