

# Beleggingsstrategie: Duurzaam, profiel Neutraal

Publicatiedatum: 7 april 2022

Gegevens bijgewerkt tot en met: 1 April 2022

## Rendementsontwikkeling (cumulatief, %) sinds inceptie



De grafiek links van de zwarte lijn toont het historische rendement van de beleggingsstrategie, met verrekening van de kosten van de gebruikte beleggingsfondsen. De grafiek rechts van de zwarte lijn toont het rendement van de beleggingsstrategie na opname van het ING Select Fund (per 28 juni 2020) eveneens inclusief verrekening van de daarbij behorende kosten. We hebben de servicefee van ING buiten beschouwing gelaten.

## Rendement en risico strategie en de Fondsbenchmark

	Strategie		Fondsbenchmark	
	Total Return (%)	Standaarddeviatie (%)	Total Return (%)	Standaarddeviatie (%)
Afgelopen week	0,09	5,05	0,02	4,92
Afgelopen maand	1,02	9,84	0,65	9,39
YTD	-5,59	8,67	-5,70	8,60
1 jaar	2,26	6,32	4,11	6,55
3 jaar	22,25	8,97	22,79	9,28
5 jaar	30,83	7,77	31,82	7,94
Sind inceptie	114,20	7,38	109,72	7,37

### Best presterend

#### Rendement (afgelopen 30 dagen, %)

Deere & Company	16,79
NVIDIA Corporation	12,98
Prologis, Inc.	12,33
Waste Management, Inc.	11,27
Novo Nordisk A/S Class B	10,85

### Slechtst presterend

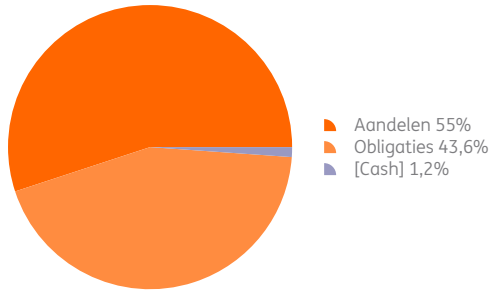
#### Rendement (afgelopen 30 dagen, %)

Danone SA	-7,88
Unilever PLC	-8,40
Koninklijke Philips N.V.	-9,97
Vonovia SE	-10,93
Industria de Diseno Textil, S.A.	-16,19

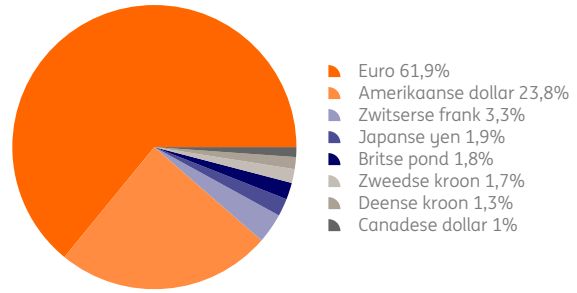
## Performance attributie (YTD)

Assetcategorieën	Beleggingsstrategie			Fondsbenchmark			Attributieanalyse		
	Gewicht (%)	Total return (%)	Bijdrage (%)	Gewicht (%)	Total return (%)	Bijdrage (%)	Allocatie-effect (%)	Selectie-effect (%)	Totaaleffect (%)
Aandelen	55,62	-5,86	-3,22	49,82	-5,93	-2,81	-0,05	0,04	-0,01
Obligaties	43,47	-4,81	-2,17	50,18	-5,60	-2,89	-0,04	0,34	0,29
[Cash]	0,91	-0,14	0,00	--	--	--	0,03	--	0,03
<b>Totaal</b>	<b>100,00</b>	<b>-5,39</b>		<b>100,00</b>	<b>-5,70</b>		<b>-0,06</b>	<b>0,37</b>	<b>0,32</b>

## Assetallocatie



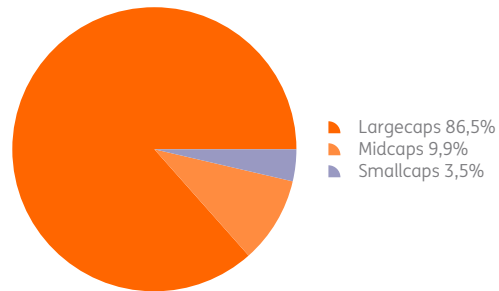
## Valutaverdeling



## Performanceratio's

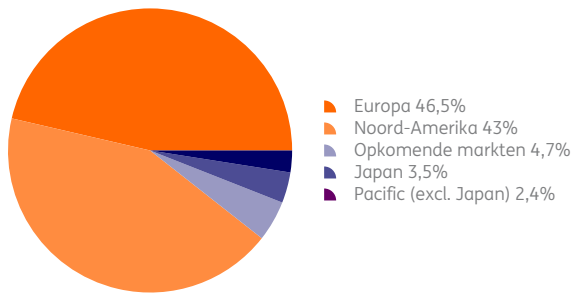
	Strategie	Fondsbenchmark
Alpha	0,44	--
Beta	1,01	1,00
Standaarddeviatie	1,20	1,18
Trackingerror	1,51	--
Sharperatio	5,04	4,46
Informationratio	0,29	--
VaR 1 jaar 95%	-30,90	-29,07
VaR 1 jaar 99%	-52,23	-50,29
Max drawdown	-17,90	-18,05

## Small-, mid- en largecaps



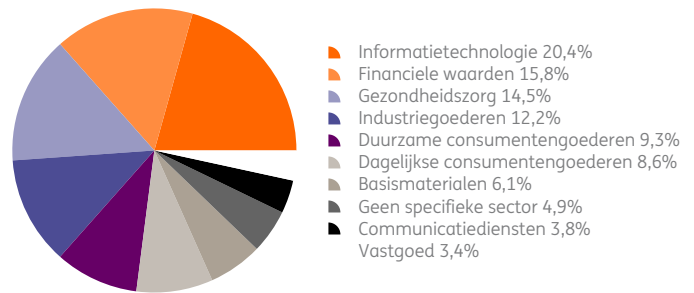
\* Niet te specificeren betekent dat deze gegevens ontbreken

## Regioverdeling aandelen



\* Niet te specificeren betekent dat we geen regio'specificatie kunnen aanbrengen

## Sectorverdeling aandelen



\* Niet te specificeren betekent dat we geen sectorspecificatie kunnen aanbrengen

## Top 10 aandelenposities

	Gewicht (%)
Microsoft Corporation	6,03
Roche Holding Ltd Dividend Right Cert.	2,66
UnitedHealth Group Incorporated	2,64
Amundi index MSCI Emerging Markets SRI PAB -UCITS ETF DR C	2,63
ASML Holding NV	2,60
Schneider Electric SE	2,42
Deere & Company	2,32
iShares MSCI World SRI UCITS ETF	2,24
AstraZeneca PLC	2,05
Nordea Bank Abp	2,00
<b>Totaal</b>	<b>27,59</b>

## Kengetallen aandelen

	Portefeuille
Dividendrendement (% op jaarbasis)	2,01
Koers-winstverhouding	21,90
koers-kasstroomverhouding	24,80
koers-boekwaardeverhouding	9,00
Rendement op eigen vermogen (%)	24,10
Langetermijnschuld/totaal vermogen	35,50

## Verdeling naar creditratings (S&P, %)

AA	23,89
Niet te specificeren	21,41
A	14,12
BAA	13,31
NR	10,06
AAA	7,96
BA	5,21
B	3,62

## Obligatiekarakteristieken

Gemiddelde creditrating (gewogen gemiddelde)	--
Gewogen gemiddelde couponrente	1,67
Gewogen gemiddelde resterende looptijd	4,33
Yield to worst	4,3
Modified duration	7,12

# Strategiesamenstelling per 1 April 2022

ISIN		Valuta	Gewicht (%)	Rendement sinds begin dit jaar (%)
<b>Aandelen</b>			<b>56,34</b>	
<b>Basismaterialen</b>				
FR0000120073-PAR	Air Liquide SA	EUR	1,08	3,97
CH0012214059-SWX	Holcim Ltd	CHF	0,78	-1,33
US2788651006-NYS	Ecolab Inc.	USD	0,69	-20,53
<b>Communicatiediensten</b>				
DE0005557508-ETR	Deutsche Telekom AG	EUR	0,92	5,79
US2546871060-NYS	Walt Disney Company	USD	0,58	-8,86
<b>Dagelijkse consumentengoederen</b>				
NL0011794037-AMS	Koninklijke Ahold Delhaize N.V.	EUR	1,00	-3,90
US7134481081-NAS	PepsiCo, Inc.	USD	0,69	1,36
FR0000120321-PAR	L'Oreal S.A.	EUR	0,67	-11,81
US7427181091-NYS	Procter & Gamble Company	USD	0,63	-1,78
FR0000120644-PAR	Danone SA	EUR	0,44	-7,91
GB00B10RZP78-AMS	Unilever PLC	EUR	0,41	-10,69
<b>Duurzame consumentengoederen</b>				
US88160R1014-NAS	Tesla Inc	USD	1,00	8,21
ES0148396007-MCE	Industria de Diseno Textil, S.A.	EUR	0,77	-29,51
US6541061031-NYS	NIKE, Inc. Class B	USD	0,73	-17,26
US4370761029-NYS	Home Depot, Inc.	USD	0,62	-24,60
DE000A1EWWW0-ETR	adidas AG	EUR	0,58	-17,02
FR0000121261-PAR	Compagnie Generale des Etablissements Michelin SCA	EUR	0,49	-14,39
<b>Financiële waarden</b>				
FI4000297767-OME	Nordea Bank Abp	SEK	1,13	-3,94
US12572Q1058-NAS	CME Group Inc. Class A	USD	1,01	8,63
US59156R1086-NYS	MetLife, Inc.	USD	0,97	17,06
CA0636711016-TSE	Bank of Montreal	CAD	0,94	12,93
DE0008404005-ETR	Allianz SE	EUR	0,84	4,98
CH0126881561-SWX	Swiss Re AG	CHF	0,83	-1,28
FR0000045072-PAR	Credit Agricole SA	EUR	0,77	-12,99
US78409V1044-NYS	S&P Global, Inc.	USD	0,63	-10,78
<b>Geen specifieke sector</b>				
NL0014332579-AMS	ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Pacific Units	EUR	2,84	-2,67
LU1554262680	BMO Investments (Lux) I Fund SICAV - BMO Responsible Globa...	EUR	2,03	-7,42
NL0014270233-AMS	ASN Beleggingsfondsen UCITS N.V. - ASN Milieu & Waterfondsen	EUR	1,80	-10,73
LU1861136247-PAR	Amundi Index MSCI USA SRI PAB -UCITS ETF DR C- Capitalisat...	EUR	1,75	-3,57
LU1861138961-PAR	Amundi Index MSCI Emerging Markets SRI PAB -UCITS ETF DR C...	EUR	1,49	-0,85
LU2354782349	Pictet Global Envir Opp Equity Fund	EUR	1,29	-11,63
NL0014332553-AMS	ACTIAM Duurzaam Index Aandelenfonds Europa Units	EUR	1,28	-6,74
IE00BYX2JD69-LON	iShares MSCI World SRI UCITS ETF	EUR	1,24	-4,40
LU1687287604	NN (L) SICAV - NN (L) Global Equity Impact Opportunities O...	EUR	1,18	-8,12
<b>Gezondheidszorg</b>				
CH0012032048-SWX	Roche Holding Ltd Dividend Right Cert.	CHF	1,46	1,81
US91324P1021-NYS	UnitedHealth Group Incorporated	USD	1,40	5,50
GB0009895292-LON	AstraZeneca PLC	GBP	1,10	17,74
DK0060534915-CSE	Novo Nordisk A/S Class B	DKK	1,07	4,32
US8835561023-NYS	Thermo Fisher Scientific Inc.	USD	0,88	-8,48
US1101221083-NYS	Bristol-Myers Squibb Company	USD	0,83	23,98

ISIN		Valuta	Gewicht (%)	Rendement sinds begin dit jaar (%)
<b>Industriegoederen</b>				
FR0000121972-PAR	Schneider Electric SE	EUR	1,30	-10,48
US2441991054-NYS	Deere & Company	USD	1,27	25,57
GB00B2B0DG97-AMS	RELX PLC	EUR	0,93	-1,37
US94106L1098-NYS	Waste Management, Inc.	USD	0,84	-0,92
SE0000695876-OME	Alfa Laval AB	SEK	0,49	3,64
<b>Informatietechnologie</b>				
US5949181045-NAS	Microsoft Corporation	USD	3,24	-5,01
NL0010273215-AMS	ASML Holding NV	EUR	1,37	-14,15
FR0000125338-PAR	Capgemini SE	EUR	0,94	-7,26
US8740391003-NYS	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Sponsored ADR	USD	0,82	-11,64
US00724F1012-NAS	Adobe Incorporated	USD	0,67	-16,74
US67066G1040-NAS	NVIDIA Corporation	USD	0,61	-6,40
US70450Y1038-NAS	PayPal Holdings, Inc.	USD	0,50	-36,25
NL0009538784-NAS	NXP Semiconductors NV	USD	0,42	-17,26
NL0012969182-AMS	Adyen NV	EUR	0,41	-22,39
<b>Vastgoed</b>				
US74340W1036-NYS	Prologis, Inc.	USD	0,96	1,98
DE000A1ML7J1-ETR	Vonovia SE	EUR	0,72	-10,93
<b>Obligaties</b>			<b>42,55</b>	
<b>Bedrijfsobligaties</b>				
LU2153616086	Amundi Index Solutions SICAV - Amundi Index Barclays Euro...	EUR	3,43	-4,82
LU1365052890	NN (L) SICAV - NN (L) Euro Green Bond N Capitalisation	EUR	2,90	-7,54
LU1484799843-ETR	UBS (Lux) Fund Solutions SICAV - Bloomberg MSCI Euro Area...	EUR	2,87	-5,96
LU1133293354	NN Euro Sustainable Credit Fund	EUR	2,82	-5,13
LU0265308063	BNP Paribas Funds SICAV - Sustainable Euro Corporate Bond...	EUR	1,58	-5,40
LU1185962187	Mirova Funds SICAV - Mirova Euro Green and Sustainable Cor...	EUR	1,57	-5,93
<b>EMD</b>				
LU0966596875	DPAM L SICAV - DPAM L Bonds Emerging Markets Sustainable W...	EUR	3,96	1,64
IE00BDSTPS26	PIMCO Funds: Global Investors Series PLC - Socially Respon...	EUR	2,24	-9,15
<b>High Yield</b>				
LU1644441807	CANDRIAM SUSTAINABLE SICAV - Bond Global High Yield V Capi...	EUR	2,83	-4,41
<b>Staatsobligaties</b>				
LU1645687762	Amundi Index Solutions SICAV - Amundi Index JP Morgan EMU...	EUR	6,87	-5,54
IE00BMYHQM42-AMS	SPDR Bloomberg Euro Government Bond UCITS ETF EUR	EUR	3,08	-5,78
AT0000A1FAP5	Government Of Austria 1.2% 20-oct-2025	EUR	1,98	-2,99
IE00BV8C9418	Government Of Ireland 1.0% 15-may-2026	EUR	1,82	-3,43
BE0000347568	Government Of Belgium 0.9% 22-jun-2029	EUR	1,61	-5,83
FR0013250560	Government Of France 1.0% 25-may-2027	EUR	1,55	-4,41
ES0000012B88	Government Of Spain 1.4% 30-jul-2028	EUR	1,43	-5,27
<b>[Cash]</b>			<b>1,11</b>	
CASH_EUR_23723	CASH_EUR	EUR	1,11	-0,15
<b>Total</b>			<b>100,00</b>	

## Disclaimer

Deze beleggingsaanbeveling is opgesteld en uitgebracht op 7 april 2022 11:01 door het ING Investment Office, onderdeel van ING Bank N.V. Voor het opstellen van deze beleggingsaanbeveling is gebruik gemaakt van de volgende wezenlijke informatiebronnen: BofA Securities, Goldman Sachs, Bloomberg, CreditSights, UBS, Standard & Poor's, Moody's, Fitch, ING FM, Citi, J.P.Morgan, Thomson Reuters Datastream, Sustainalytics of Reuters Metastock. Deze beleggingsaanbeveling is gebaseerd op de volgende waarderingsgrondslagen, methoden en aannames: koerswinstverhouding, koersboekwaardeverhouding of net asset value (NAV). Voor deze beleggingsaanbeveling zijn geen beschermde modellen gebruikt. Een beschrijving van het ING-beleid ten aanzien van informatiebarrières en belangenverstremming kunt u vinden op <https://www.ing.com/About-us/Compliance/Information-Barriers-Conflicts-of-Interest.htm>. Tenzij anders vermeld, zal ING Bank N.V. de beleggingsaanbeveling niet actualiseren. Ontwikkelingen die zich na het opstellen van deze beleggingsaanbeveling hebben voorgedaan, kunnen van invloed zijn op de juistheid van de aannames waarop deze beleggingsaanbeveling is gebaseerd. Beleggingsaanbevelingen worden over het algemeen 2 tot 4 keer per jaar herzien. Deze beleggingsaanbeveling behelst geen individueel beleggingsadvies maar slechts een algemene aanbeveling waarop beleggers hun beleggingsbeslissingen mede kunnen baseren en vormt geen uitnodiging tot het aangaan van welke overeenkomst of verbintenis dan ook. Deze beleggingsaanbeveling is gebaseerd op aannames en vormt geen garantie voor een bepaalde ontwikkeling of resultaat. Aan deze beleggingsaanbeveling kunnen geen rechten worden ontleend. Beslissingen op basis van deze beleggingsaanbeveling zijn voor uw eigen rekening en risico. Noch ING Bank N.V. noch ING Groep N.V. noch enige andere rechtspersoon die tot de ING Groep behoort, aanvaardt aansprakelijkheid voor enige schade in welke mate dan ook die voortvloeit uit het gebruik van bovenstaande beleggingsaanbeveling of de daarin opgenomen informatie. Beleggen brengt risico's en kosten met zich mee. U kunt uw inleg of een deel ervan verliezen. De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. ING Bank N.V. is niet geregistreerd als broker-dealer en investment adviser zoals bedoeld in de Amerikaanse Securities Exchange Act van 1934, respectievelijk de Amerikaanse Investment Advisers Act van 1940, zoals van tijd tot tijd gewijzigd, en evenmin in de zin van andere toepasselijke wet- en regelgeving van de afzonderlijke staten van de Verenigde Staten van Amerika (hierna tezamen: 'Amerikaanse beleggingswetgeving'). Deze beleggingsaanbeveling is niet gericht tot en niet bestemd voor 'U.S. Persons' in de zin van de Amerikaanse beleggingswetgeving. Kopieën hiervan mogen niet worden verzonden of worden meegebracht naar de Verenigde Staten van Amerika of worden verstrekt aan U.S. Persons. ING Bank N.V. is statutair gevestigd te Amsterdam, handelsregister nr. 33031431 Amsterdam en staat onder toezicht van Autoriteit Financiële Markten AFM. ING Bank N.V. is onderdeel van ING Groep N.V. Alle rechten voorbehouden. Deze beleggingsaanbeveling mag niet worden verveelvoudigd, gekopieerd, gepubliceerd, opgeslagen, aangepast of gebruikt in welke vorm dan ook, online of offline, zonder voorafgaande schriftelijke toestemming van ING Bank N.V. ©2020 ING Bank N.V., Amsterdam.

Bron: FactSet, 7 april 2022