NORTHERN TRUST ASSET MANAGEMENT

Marketingcommunicatie

PASSIVE AANDELEN

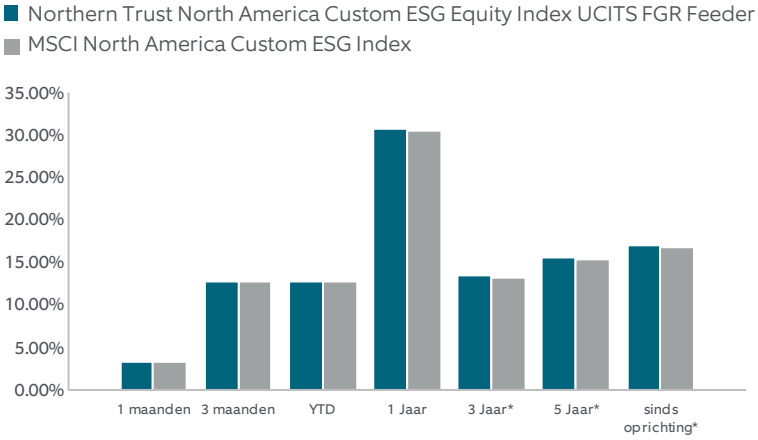
NORTHERN TRUST NORTH AMERICA CUSTOM ESG EQUITY INDEX UCITS FGR FEEDER FUND

AANDELENKLASSE D EUR per Maart 2024

BELEGGINGSDOELSTELLING

Het fonds is een UCITS feeder fonds. De beleggingsdoelstelling van het fonds is om ten minste 85% van de activa te beleggen in het NAAM (het Master Fund), een subfonds van het Northern Trust UCITS Common Contractual Fund, waarvan de beleggingsdoelstelling is om nauw aan te sluiten bij de risico- en rendementskenmerken van de INDEXNAAM (de 'Index') met herbelegde nettodividenden. Het Master Fund belegt in aandelen (dat wil zeggen aandelen en andere soortgelijke activa), die zijn uitgegeven door of gerelateerd zijn aan bedrijven die zijn opgenomen in de index.
De index is een aangepaste index die overeenkomt met de MSCI Europe Index, maar bedrijven uitsluit die niet voldoen aan de maatschappelijk verantwoorde principes, die zijn geïdentificeerd door criteria toe te passen op basis van de tien principes van de UN Global Compact en andere ESG-criteria die door de vermogensbeheerder zijn geselecteerd.
Doelmarkt: Dit fonds is geschikt voor beleggers die van plan zijn om op de middellange tot lange termijn te beleggen; en op zoek zijn naar een passief beheerde belegging in de relevante markt(en) met ESG-principes (milieu, maatschappij en ondernemingsbestuur), die worden toegepast volgens een gedefinieerde reeks uitsluitingen. Dit fonds kan geschikt zijn voor beleggers die kunnen profiteren van de fiscale status van het FGR-fondsaanbod.

RESULTATEN AANDELENKLASSE % — IN EUR PER 31/03/24



Alle prestaties in EUR vanaf 31/03/24

In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor geen toekomstige rendementen

	1 maanden	3 maanden	YTD	1 jaar	3 jaar*	5 jaar*	sinds oprichting*
Aandelenklasse	3.30	12.76	12.76	30.68	13.53	15.66	17.03
Index	3.31	12.71	12.71	30.57	13.37	15.52	16.89

Resultaten worden berekend vanaf de introductie van de aandelenklasse. Alle getoonde cijfers zijn na aftrek van kosten. Raadpleeg het prospectus van het fonds voor koersinformatie.

*** De getoonde performance zijn op jaarbasis weergegeven voor periodes langer dan 1 jaar.**

Wanneer uw eigen valuta verschilt van de valuta van de beleggingen van het fonds, kan het rendement van het fonds ook onderhevig zijn aan schommelingen in wisselkoersen.

De introductiekoers zonder swingfactor is gebruikt als startpunt voor het bepalen van de resultaten.

Daarna worden IW's met swingfactor gebruikt. Hierboven worden de resultaten weergegeven die konden worden behaald door in aanmerking komende Nederlandse beleggers, inclusief uitkeringen van opbrengsten. Deze opbrengsten zijn vóór aftrek van 15% ingehouden Nederlandse dividendbelasting, omdat deze beleggers recht hebben op teruggave hiervan. Andere typen beleggers en beleggers uit andere rechtsgebieden zijn mogelijk niet in staat dezelfde resultaten te behalen vanwege hun fiscale status en lokale belastingregels.

PRESTATIEPERIODEN VAN 12 MAANDEN — TOT EIND LAATSTE MAAND

	31/03/23-31/03/24	31/03/22-31/03/23	31/03/21-31/03/22	31/03/20-31/03/21	31/03/19-31/03/20	31/03/18-31/03/19	31/03/17-31/03/18	31/03/16-31/03/17	31/03/15-31/03/16	31/03/14-31/03/15	Calendar Year 2023
Aandelenklasse	30.68	-7.16	20.62	49.21	-5.22	—	—	—	—	—	22.75
Index	30.57	-7.33	20.42	49.18	-5.36	—	—	—	—	—	22.61

Prestatierendementen van de index zijn exclusief advieskosten, transactiekosten of uitgaven. Het is niet mogelijk om direct in een index te beleggen.

BELANGRIJKE RISICO'S

Beleggingsrisico - het fonds kan zijn beleggingsdoel mogelijk niet bereiken. Beleggen in het fonds brengt altijd beleggingsrisico's met zich mee, waaronder het risico op verlies van het ingelegde bedrag.
Tegenpartijrisico - in geval van wanbetaling of faillissement van de broker is er geen garantie dat het fonds het door de broker aangehouden onderpand terugkrijgt. In geval van een faillissement van de tegenpartij kunnen de premie en eventuele niet-gerealiseerde winsten verloren gaan.
Derivatenrisico - derivaten kunnen resulteren in winsten of verliezen, die groter zijn dan het oorspronkelijke geïnvesteerde bedrag.
Waarderingsrisico - een fondspositie kan onjuist zijn gewaardeerd, omdat sommige koersen op bepaalde momenten onzeker kunnen zijn.
Valutarisico - wanneer een beleggingscategorie in een andere valuta luidt dan de basisvaluta van het fonds, kunnen de niet-basis beleggingscategorieën van het fonds ongunstig worden beïnvloed door schommelingen in de wisselkoersen.
Risico's verbonden aan beleggen in het Master Fund - de waarde van dit fonds en de inkomsten daaruit zijn nauw verbonden met de prestaties van het Master Fund. Er is geen garantie dat de beleggingsdoelstelling van het Masterfonds zal worden bereikt. Als participant van het Master Fund draagt dit fonds, samen met andere participanten, een pro rata deel van de kosten van het Master Fund. Deze vergoedingen komen bovenop de andere vergoedingen en kosten die dit fonds rechtstreeks draagt in verband met de eigen activiteiten.

NORTHERN TRUST NORTH AMERICA CUSTOM ESG EQUITY INDEX UCITS FGR FEEDER FUND

TIEN HOLDINGS %	Fonds
Microsoft Corporation	6.4
Apple Inc.	5.5
NVIDIA Corporation	4.8
Amazon.com, Inc.	3.6
Meta Platforms Inc Class A	2.3
Alphabet Inc. Class A	1.9
Alphabet Inc. Class C	1.7
Eli Lilly and Company	1.4
Broadcom Inc.	1.3
JPMorgan Chase & Co.	1.3

UITSPLITSING NAAR SUBSECTOR %	Fonds	Benchmark
Informatie Technologie	29.8	29.8
Financiele Instellingen	14.4	14.4
Gezondheidszorg	12.2	12.2
Luxe Consumentengoederen	10.5	10.5
Communicatiediensten	9.0	9.0
Industrie	7.6	7.6
Consumentengoederen	5.5	5.5
Energie	4.3	4.3
Grondstoffen	2.7	2.7
vastgoed	2.3	2.3
Nutsbedrijven	1.7	1.7

GROOTSTE REGIO- OF LANDENWEGINGEN	Fonds	Benchmark
Verenigde Staten van Amerika	96.1	96.0
Canada	3.9	4.0

FONDS OVERZICHT	
Domicilie	Nederland
Juridische structuur	Fonds voor gemene rekening (FGR)
Regulerende structuur	UCITS
Proxy Voting	ja
Belastingsstructuur	Fiscale beleggingsinstelling (FBI)
Uitkeringen	Februari
Omvang fonds	€1,4 miljard
Benchmark	MSCI North America Custom ESG Index
Fonds Oprichting	21/12/15
Aandelenklasse Oprichting	24/01/19
Fonds Valuta	EUR
Aandelenklasse Valuta	EUR
Bloomberg Ticker	NTNAFDE
ISIN	NL0013217722
Minimum eerste belegging	Geen Minimum
Minimum vervolgbelegging	Geen Minimum
Handelsfrequentie	Dagelijks
Handelstijdstip	11:00 uur Nederlandse tijd op T
Afrekening	T+2
Portefeuillemanager	Team beheerd
OCF SHARE CLASS D EUR**	0.10%
Effectenuitleen	nee
Swingpricing	ja
Gebruik opbrengsten	Verspreiden van

**De getoonde lopende kosten / Ongoing Charges Figures betreft een schatting welke van tijd tot tijd kan variëren.

FONDS KENMERKEN	Fonds	Benchmark
Prognose EPS-groei (%)	13,8	13,8
Voortschrijdende koers-instv erhouding over 12 maanden	24,8	24,8
Gewogen gemiddelde marktkapitalisatie (€Mln)	64754,8	70062,4
Koers-boek erhouding	4,5	4,5
Dividendrendement*** (%)	1,4	1,4
Rendement op eigen vermogen (%)	25,7	25,7
Aantal aandelen	655	653

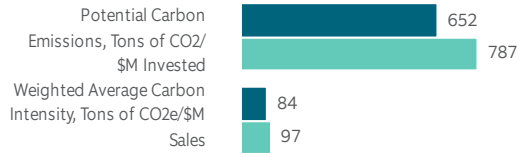
*** Het dividendrendement wordt door het fonds berekend op het fondsniveau als een gewogen gemiddelde van het bruto dividendrendement van de aandelen binnen de portefeuille en index.

NORTHERN TRUST NORTH AMERICA CUSTOM ESG EQUITY INDEX UCITS FGR FEEDER FUND

CO2-gegevens

Koolstofvoetafdruk indexonderdelen versus

NT Index Fund Standard Benchmark



Potentiële CO2-uitstoot omvat de totale mogelijke uitstoot van fossiele brandstofbedrijven, die kan ontstaan als alle fossiele brandstofreserves die zij bezitten, worden gewonnen. Dit veld vertegenwoordigt de potentiële CO2-uitstoot van de fossiele brandstofreserves die in eigendom zijn van een bedrijf en wordt berekend met behulp van een formule uit het Potsdam Institute for Climate Impact-onderzoek. De CO2-intensiteit vertegenwoordigt de meest recent gerapporteerde of geschatte directe (brandstofverbranding, bedrijfsvoertuigen) en indirecte (gekochte elektriciteitswarmte en stoom) CO2-uitstoot van het bedrijf.

GEGEVENS OVER BEWUSTMAKING

Lees voor meer informatie ons driemaandelijks betrokkenheidsrapport. U vindt het rapport op northerntrust.com/engagement. Betrokkenheidsactiviteiten uitgevoerd door Hermes EOS namens Northern Trust.

ESG-UITSLUITINGEN ONS BASIS INDEX

Aantal effecten van de fondsindex uitgesloten ten opzichte van de standaardbenchmark.

ESG-Screening	Aantal effecten	% van marktkapitalisatie
Bedrijfsgerelateerde uitsluitingen*	6	0.7
Combined Governance	0	0.0
Gecombineerde Wapens	15	2.1
Fossil Fuels**	18	0.9
High Carbon Intensity	0	0.0
Not Rated	1	0.1
Nuclear Power	0	0.0
UNGC en andere controverses	2	0.1
Gecombineerde mandje***	42	3.9

* Bedrijfsgerelateerde uitsluitingen omvatten tabak en gevangenissen zonder winstoogmerk.
** Fossiele brandstoffen omvatten thermische steenkool, schalie, teerzanden en Arctische olie en gas.
*** Aandelen kunnen in meerdere ESG-schermen voorkomen, maar worden slechts één keer in het gecombineerde mandje beschouwd

NORTHERN TRUST
ASSET MANAGEMENT

Woordenlijst

Bedrijfsgerelateerde uitsluitingen : bedrijfsgerelateerde uitsluitingen hebben betrekking op tabaksproductie, retail en handel en gevangenissen met winstoogmerk.
Duur: is de mate van gevoeligheid van de prijs van een obligatie of een ander schuldinstrument voor veranderingen in de rentevoeten.
Toekomstige groei van de winst per aandeel: een geschatte groei van de inkomsten van een bedrijf in de volgende periode, meestal tot aan het einde van het huidige boekjaar en soms tot het volgend boekjaar.
ISIN: international securities identification number. Het is een 12-cijferige, alfanumerieke code die een specifieke beveiliging op unieke wijze identificeert.
LT / ST: lange termijn/korte termijn.
Gewijzigde duur: meet de verandering in de waarde van een obligatie, als reactie op een verandering in de rente van 100 basispunten (1%).
Lopende kosten: is een cijfer dat alle jaarlijkse kosten en andere betalingen uit het fonds vertegenwoordigt.
Koers/boekwaardeverhouding: wordt gebruikt om de marktkapitalisatie van een bedrijf te vergelijken met de boekwaarde. Dit wordt berekend door de aandelenkoers van het bedrijf per aandeel te delen door de boekwaarde per aandeel. De boekwaarde wordt als volgt berekend: (totale activa - totale schulden)/het aantal uitstaande aandelen.
Quant Active: effecten worden gekozen op basis van numerieke gegevens, die zijn samengesteld door middel van een kwantitatieve analyse. Er wordt gestreefd naar een hoge alfa door blootstelling aan meerdere factoren: een bewezen model voor het rangschikken van aandelen, voor het selecteren van aandelen met een goede waarde, kwaliteit, momentum en analistenherzieningen, enz.
Duur van de spread: is een schatting van hoeveel de prijs van een specifieke obligatie zal veranderen wanneer de spread van die specifieke obligatie verandert.
SRRI: is een waarde gebaseerd op de volatiliteit van het fonds, die een indicatie geeft van het algehele risico- en rendementsprofiel van het fonds.
Swingprijzen: beschermt bestaande aandeelhouders tegen fondsverwatering door transactiekosten door te berekenen aan kopende of aflossende aandeelhouders. Hiermee kunnen fondsen de intrinsieke waarde naar boven of naar beneden bijstellen zodra de aankoop- of aflossingslimieten worden overschreden.
Voortschrijdende 12-maandelijkse koers/winstverhouding: is een relatieve waarderingsfactor op basis van de laatste 12 maanden van de werkelijke winst, die wordt berekend door de huidige aandelenkoers te delen door de overblijvende winst per aandeel van het voorgaande jaar.
WAL (nominaal gewogen gemiddelde levensduur): de looptijd van een obligatie is de tijdsduur waarin de hoofdsom van de obligatie moet worden terugbetaald. De WAL van het fonds wordt berekend als het gemiddelde van de looptijden van de onderliggende obligaties, aangepast op basis van hun relatieve gewicht (omvang) binnen het fonds.
WAM (gewogen gemiddelde looptijd): de looptijd van een obligatie is de tijdsduur waarin de hoofdsom van de obligatie moet worden terugbetaald. De WAM van de ETF wordt berekend als het gemiddelde van de looptijden van de onderliggende obligaties, aangepast op basis van hun relatieve gewicht (omvang) binnen het fonds.
Gewogen gemiddelde marktkapitalisatie: verwijst naar een constructietype voor beursindexen, die is gebaseerd op de marktkapitalisatie van de samenstellende aandelen van de index.
Rendement tot maturiteit (%): het verwachte totale rendement van een obligatie als deze wordt aangehouden totdat deze vervalt.

Meer informatie

Meer informatie www.northerntrust.com/fgrfunds of neem contact op met uw beleggingsadviseur.

UK	NTAM_UK_Sales@ntrs.com +44 207 982 2445	EUROPE	NTAM_AMS_Sales@ntrs.com +31 20 794 1049
APAC	NTAM_APAC_Sales@ntrs.com + 852 2918 2948	NORDICS	NTAM_Nordic_Sales@ntrs.com + 46 10 555 5160
MIDDLE EAST	NTAM_ME_Sales@ntrs.com + 971 2509 8260	DACH	NTAM_DACH_Sales@ntrs.com + 31 20 794 1027

VERKLARING

© 2024 Northern Trust Corporation. Northern Trust Asset Management (NTAM) bestaat uit Northern Trust Investments, Inc. (NTI), Northern Trust Global Investments Limited (NTGIL), Northern Trust Fund Managers (Ireland) Limited (NTFMIL), Northern Trust Global Investments Japan, K.K. (NTKK), NT Global Advisors, Inc., 50 South Capital Advisors, LLC, Northern Trust Asset Management Australia Pty Ltd en beleggingspersoneel van The Northern Trust Company of Hong Kong Limited (TNTCHK) en The Northern Trust Company (TNTC).

Dit is marketingcommunicatie. Raadpleeg het prospectus en de essentiële beleggersinformatie (EBI) voordat u definitieve beleggingsbeslissingen neemt. Het prospectus is beschikbaar in het Engels en de essentiële beleggersinformatie is beschikbaar in [Engels, Deens, Nederlands, Italiaans, Duits, Spaans en Zweeds] op www.northerntrust.com/pooledfunds.

Voor de markten in Azië en de Stille Oceaan is deze informatie alleen bedoeld door deskundigen en zakelijke en institutionele beleggers en mag niet worden gebruikt door detailhandelklanten of beleggers. Ga voor juridische en regelgevingsinformatie over onze kantoren en juridische entiteiten naar northerntrust.com/disclosures.
Het Fonds wordt beheerd door Northern Trust Fund Managers (Ireland) Limited. Dit fonds, een subfonds van Northern Trust UCITSFGR Fund (NTFGR), is een gereglementeerde beleggingsinstelling in Nederland onder de AFM UCITS (ICBE) regelgeving. Het Fonds maakt gebruik van de Temporary Permissions Regime in het Verenigd Koninkrijk, waardoor in de EER gevestigde fondsen gedurende een beperkte periode in het VK kunnen worden uitgekeerd totdat volledige toestemming is verkregen.
In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. De hierin opgenomen informatie is ontleend aan bronnen die betrouwbaar worden geacht, maar voor de juistheid en volledigheid ervan kan niet worden ingestaan. De informatie is slechts actueel op de vermelde datum en kan zonder voorafgaande kennisgeving worden gewijzigd. Verstrekte gegevens over resultaten van fondsen mogen niet worden gebruikt als basis voor beleggingsbeslissingen; de prestatiegegevens kunnen worden herzien. Deze informatie vormt geen aanbeveling voor een beleggingsstrategie of product zoals hierin beschreven. Deze informatie is niet bedoeld als beleggingsadvies en houdt geen rekening met individuele omstandigheden van een belegger. De informatie in dit document is geen aanbod tot verkoop, noch een uitnodiging tot het doen van een aanbod voor de aankoop van effecten of gerelateerde financiële instrumenten.
Onze ICBE-fondsen zijn gecategoriseerd, in overeenstemming met de SFDR-categorisatie. Ga voor meer informatie naar:northerntrust.com/europe/what-we-do/investment-management/sustainable-finance-regulation.
Uitgegeven in het Verenigd Koninkrijk door Northern Trust Global Investments Limited. Uitgegeven in de Europese Economische Ruimte door Northern Trust Fund Managers (Ireland) Limited.

NORTHERN TRUST
ASSET MANAGEMENT