
Duurzaamheidsrapport

Global Sustainability Core Equity Fund

UITSLUITEND VOOR PROFESSIONEEL GEBRUIK. NIET BEDOELD VOOR GEBRUIK DOOR HET PUBLIEK. INDIEN UITGEGEVEN DOOR DIMENSIONAL IRELAND LIMITED

Deze informatie is uitgegeven door Dimensional Ireland Limited (Dimensional Ireland), statutair gevestigd te 3 Dublin Landings, North Wall Quay, Dublin 1, Ierland. Dimensional Ireland staat onder toezicht van de Centrale Bank van Ierland (onder registratienummer C185067). Deze informatie is uitsluitend bestemd voor professionele cliënten in de zin van Richtlijn betreffende markten voor financiële instrumenten (MiFID) (2014/65/EU).

INDIEN UITGEGEVEN DOOR DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD.

Deze informatie is uitgegeven door Dimensional Fund Advisors Ltd. (Dimensional UK), 20 Triton Street, Regent's Place, London, NW1 3BF, geregistreerd onder nummer 02569601. Dimensional UK staat onder de toezicht van de Financial Conduct Authority (FCA) onder nummer 150100. Deze informatie is uitsluitend bestemd voor professionele cliënten zoals nader gedefinieerd door de door FCA uitgegeven regelgeving.

Dit is een reclame. Raadpleeg het prospectus van de icbe, Eid en de EBI voordat u een beleggingsbeslissing neemt.

Dimensional Fund Advisors Ltd. is bevoegd om icbe's in de zin van artikel 1:1 van de Wet op het financieel toezicht (Wft), te beheren. Daarnaast is Dimensional UK bevoegd om grensoverschrijdend diensten te verlenen in Nederland op basis van het Europese paspoortregime. Dimensional UK heeft een bijkantoor in Nederland dat onder toezicht staat van de Stichting Autoriteit Financiële Markten (AFM) en onderworpen is aan Nederlandse toezichtwetgeving. Het Nederlandse bijkantoor van Dimensional UK is geregistreerd in het handelsregister van de Nederlandse Kamer van Koophandel onder nummer 56245629.

De informatie in dit document is uitsluitend bedoeld voor eigen gebruik door en dient als achtergrondinformatie voor de ontvanger. De informatie is in goed vertrouwen verstrekt, zonder enige garanties te doen omtrent de nauwkeurigheid en volledigheid daarvan. Informatie of opinies gepresenteerd in dit materiaal zijn verkregen of afgeleid uit bronnen die door Dimensional Ireland en Dimensional UK relevant en betrouwbaar worden geacht (waar de context het vereist zullen DIF en Dimensional UK in het hiernavolgende afzonderlijk worden aangeduid als de "Uitgevende Entiteit") en de Uitgevende Entiteit goede redenen heeft om aan te nemen dat alle feitelijke informatie uit dit document juist is op de datum van dit document. Er is geen sprake van een beleggingsadvies, aanbeveling of een aanbod van diensten of producten en het verstrekken van de informatie wordt niet beoogd een voldoende basis te bieden voor het nemen van een beleggingsbeslissing. Het is de verantwoordelijkheid van de personen die besluiten tot het doen van aankoop om zich daarover voldoende te informeren en de van toepassing zijnde wet- en regelgeving na te leven. Het is niet toegestaan om dit document te kopiëren, te dupliceren of te verzenden naar derden zonder de voorafgaande toestemming van de Uitgevende Entiteit. De Uitgevende Entiteit aanvaardt geen aansprakelijkheid voor schade die voortvloeit uit het gebruik van de hierin opgenomen informatie.

Gerichte aanpak op basis van wetenschap

Datagedreven

We gebruiken milieugegevens om problemen te identificeren waarvan wij denken dat deze aanzienlijke externe kosten voor toekomstige generaties met zich mee kunnen brengen.

Focus op klimaat

Onze focus op duurzaamheid richt zich met name op de uitstoot die leidt tot klimaatverandering.

Transparante rapportage

Onze strategieën zijn ontworpen om de CO₂-voetafdruk aanzienlijk te verkleinen.

De duurzaamheidsstrategieën van Dimensional zijn gericht op een kleinere blootstelling aan de CO₂-voetafdruk.

Uitstootgegevens

De focus op broeikasgasemissies maakt een klimaatgerichte beleggingsaanpak mogelijk

Relevantie

Broeikasgassen zijn de belangrijkste oorzaak van klimaatverandering.

Toegankelijkheid

Bedrijven wereldwijd rapporteren jaarlijks over wat zij aan CO2 uitstoten.

Vergelijkbaarheid

Dankzij de uitstootgegevens van bedrijven kunnen beleggers de milieukeurmerken van deze bedrijven met elkaar vergelijken.

CO₂-voetafdruk gegevens begrijpen

De uitstoot van bedrijven evalueren door te kijken naar wat er in de lucht en in de grond zit

CO₂-voetafdruk onderdelen:



Uitleg over CO₂-voetafdruk in één oogopslag

Wat zijn koolstofdioxide-equivalenten (CO₂e)?

CO₂e is een eenheid die wordt gebruikt om de emissies van de zeven broeikasgassen te vergelijken, door elk gas om te rekenen naar een equivalente hoeveelheid CO₂ op basis van hun potentieel om de aarde op te warmen¹

Wat is 1 ton CO₂e?



Equivalent aan de uitstoot van **427** liter verbruikte benzine¹



Equivalent aan CO₂-opslag door **1.2** acres aan Amerikaanse bossen in één jaar¹

Wat zijn fossiele brandstofreserves?

Bedrijven kunnen fysieke activa hebben die steenkool, olie en aardgas bevatten, wat in de toekomst tot een hoge uitstoot kan leiden.²

1. Bron: EPA.gov.

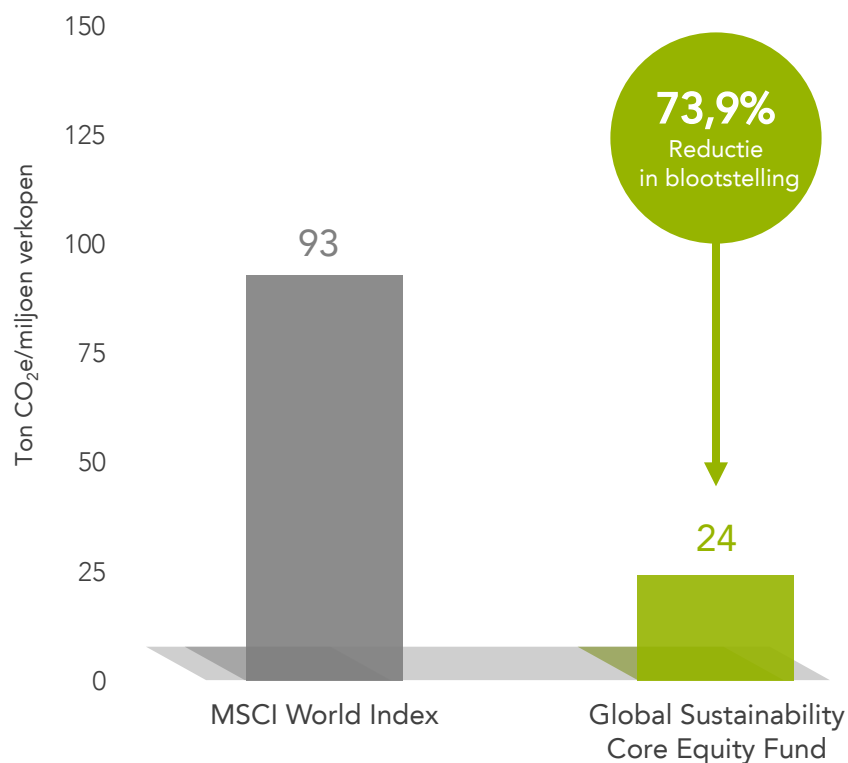
2. Bron: MSCI.

CO₂-intensiteit staat voor de recent door een bedrijf gerapporteerde of geschatte Scope 1 (direct) + Scope 2 (indirect) CO₂-emissies in koolstofdioxide-equivalenten (CO₂e), genormaliseerd naar omzet in USD (metrische ton CO₂e per miljoen USD omzet). Broeikasgassen zijn koolstofdioxide (CO₂), methaan (CH₄), distikstofoxide (N₂O), fluorkoolwaterstoffen (HFK's), perfluorkoolwaterstoffen (PFK's), zwavelhexafluoride (SF₆) en stikstoftrifluoride (NF₃). **Potentiële emissies uit reserves** is een door MSCI berekende theoretische raming van de koolstofdioxide die wordt geproduceerd als de gerapporteerde olie-, gas- en steenkoolreserves van een bedrijf worden omgezet in energie, op basis van de geraamde koolstof- en energiedichtheid van de betreffende reserves.

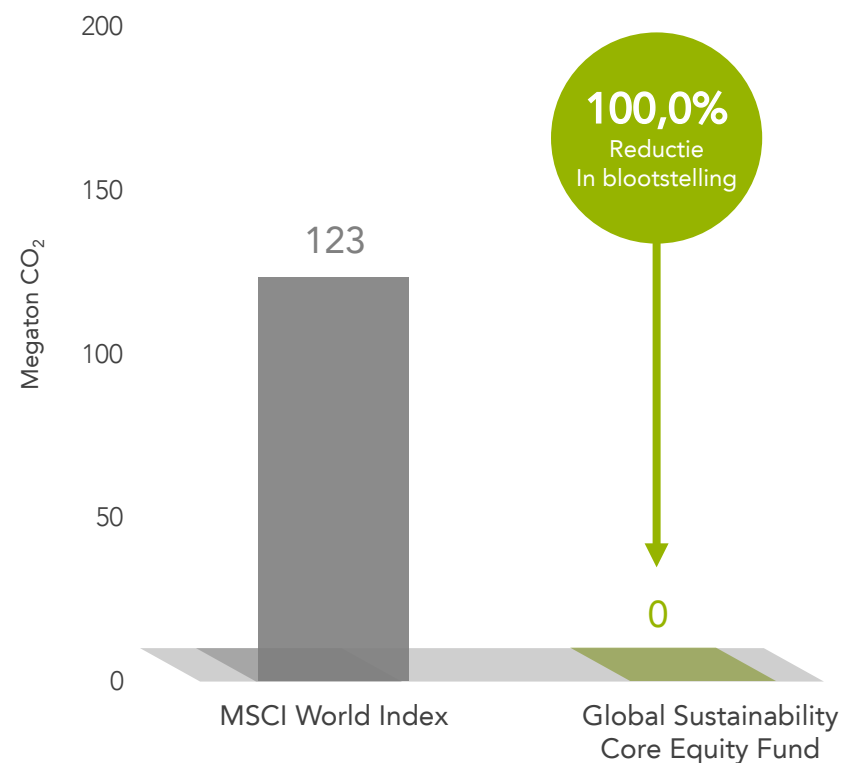
CO₂-Voetafdruk

Emissieblootstelling op 31 december 2024

Gewogen gemiddelde CO₂-intensiteit



Gewogen gemiddelde potentiële emissies van reserves



De gewogen gemiddelde CO₂-intensiteit wordt berekend door de recent gerapporteerde of geschatte Scope 1 (direct) + Scope 2 (indirect) broeikasgasemissies in koolstofdioxide-equivalenten (CO₂e), genormaliseerd naar omzet in USD (metrische ton CO₂e per miljoen USD omzet) voor elke portefeuille of elk bedrijf uit de index en het berekenen van het gewogen gemiddelde naar portefeuille- of indexgewicht. Broeigassgasen zijn koolstofdioxide (CO₂), methaan (CH₄), distikstofoxide (N₂O), fluorkoolwaterstoffen (HFK's), perfluorkoolwaterstoffen (PFK's), zwavelhexafluoride (SF₆) en stikstoftrifluoride (NF₃). Het gewogen gemiddelde van potentiële reserves wordt berekend middels een theoretische schatting van de MSCI van de koolstofdioxide die zou ontstaan als de gerapporteerde olie-, gas- en steenkoolreserves van een bedrijf zouden worden omgezet in energie, op basis van de geraamde koolstof- en energiedichtheid van de betreffende reserves, voor ieder bedrijf in de portefeuille of index en de berekening van het gewogen gemiddelde per gewicht van de portefeuille of index. Zie "Beschrijving duurzaamheidsgegevens en openbaarmakingen" voor extra informatie. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

CO₂-Voetafdruk per Sector

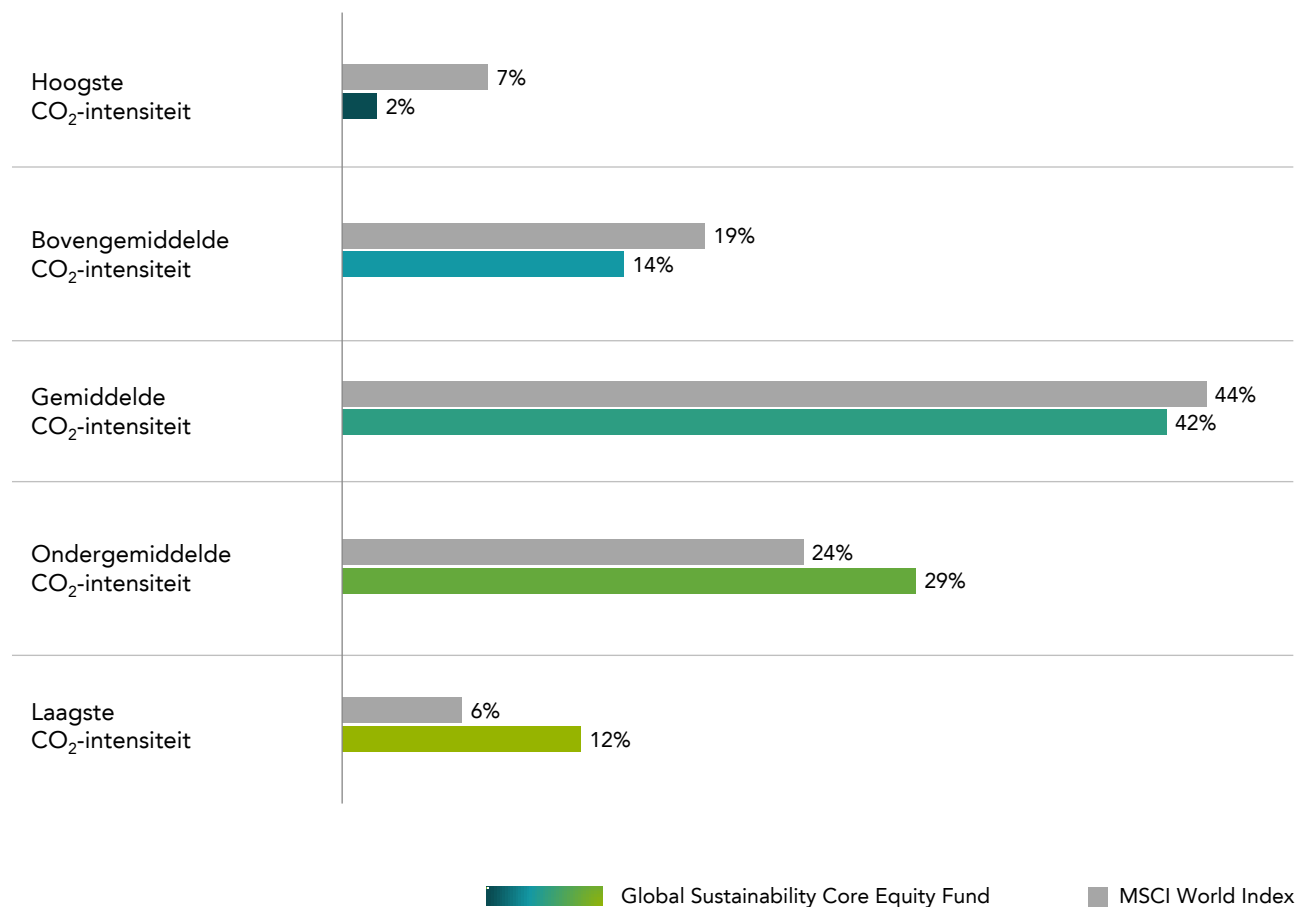
Per 31 december 2024

Sector	Sectorwieging (%)		Gemiddeld gewogen CO ₂ -intensiteit (tCO ₂ e/USD miljoenen omzet)		Gemiddeld gewogen potentiële emissie uit reserves. (MtCO ₂)	
	Global Sustainability Core Equity Fund	MSCI World Index	Global Sustainability Core Equity Fund	MSCI World Index	Global Sustainability Core Equity Fund	MSCI World Index
Communicatiediensten	7,6	8,1	8,3	11,7	—	—
Luxeproducten	11,5	11,1	17,3	45,4	—	—
Consumptiegoederen	5,4	6,0	30,5	36,5	—	—
Energie	1,9	3,7	159,4	393,8	—	2.983,5
Financieel dienstverleners	18,9	16,0	2,6	12,1	—	1,9
Gezondheidszorg	10,8	10,3	10,3	14,0	—	—
Industrie	14,1	10,6	28,1	76,6	—	33,0
IT	21,7	26,2	7,9	15,7	—	—
Materialen	3,9	3,2	159,4	569,6	—	248,4
Vastgoed	2,9	2,1	31,2	89,7	—	—
Nutsbedrijven	1,2	2,5	215,0	1.380,2	—	1,5
Totaal			24	93	0	123

Gemiddeld gewogen CO₂-intensiteit wordt bepaald door de recent gerapporteerde of geschatte Scope 1 (direct) + Scope 2 (indirect) broeikasgasemissies in kooldioxide-equivalenten (CO₂e) te berekenen, genormaliseerd door omzet in USD (metrische tonnen CO₂e per USD miljoen omzet) voor elke portefeuille of bedrijf in de index en het berekenen van het gewogen gemiddelde per portefeuille- of indexgewicht. De opgenomen broeikasgassen zijn kooldioxide (CO₂), methaan (CH₄), lachgas (N₂O), fluorkoolwaterstoffen (HFK's), perfluorkoolwaterstoffen (PFC's), zwavelhexafluoride (SF₆) en stikstoftrifluoride (NF₃). **Gewogen gemiddelde potentiële emissies uit reserves** worden gevonden met behulp van een theoretische schatting, berekend door MSCI van geproduceerde kooldioxide als de gerapporteerde reserves van olie, gas en steenkool van een bedrijf worden omgezet in energie, gegeven de geschatte koolstof- en energiedichtheden van de betreffende reserves, voor elke portefeuille of bedrijf in de index en het berekenen van het gewogen gemiddelde per portefeuille- of indexgewicht. Zie "Beschrijving en openbaarmakingen van duurzaamheidsgegevens" voor meer informatie. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Gewichtsverdeling naar CO₂-intensiteit

Op 31 december 2024

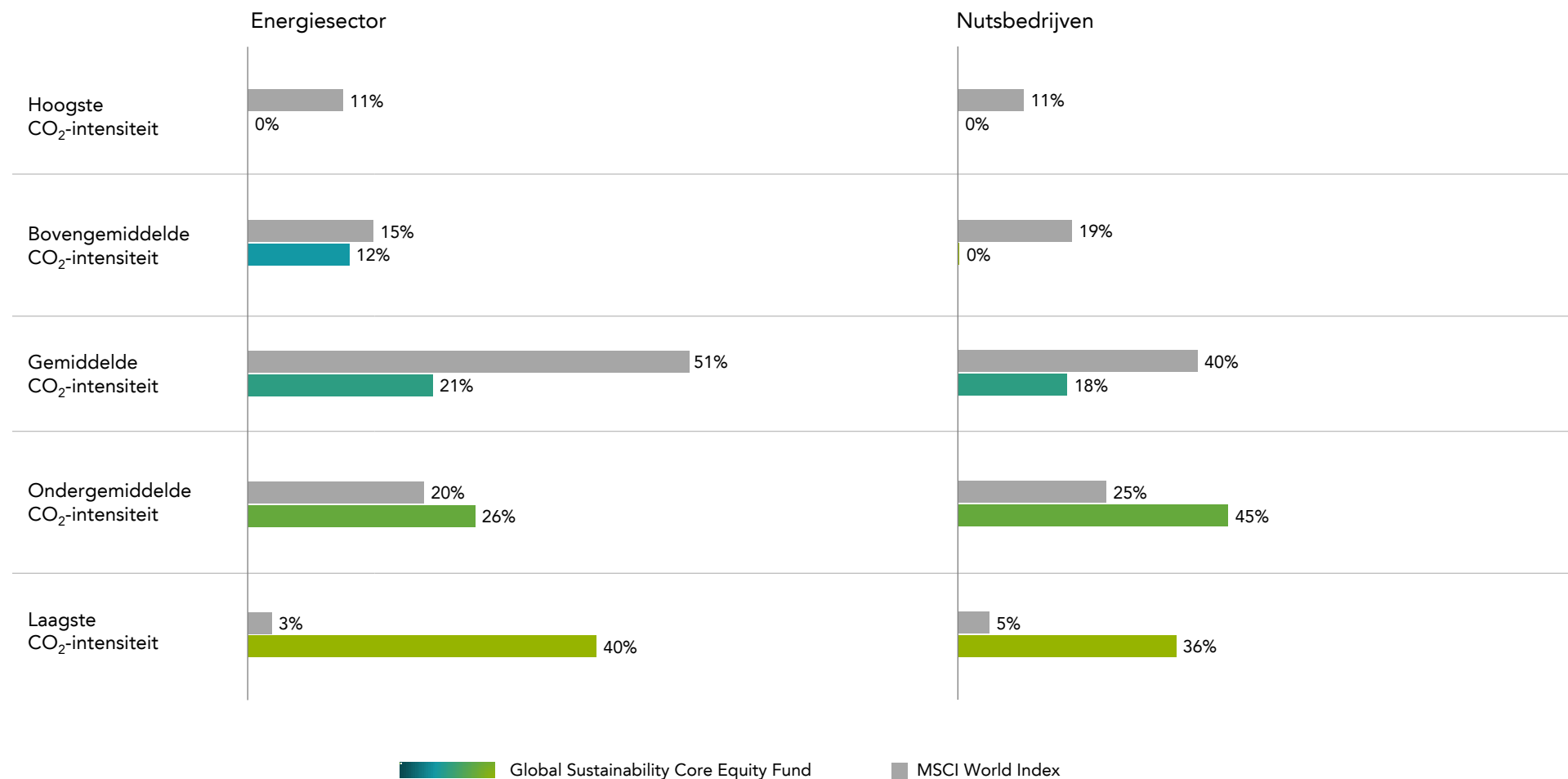


- ê De duurzaamheidsstrategieën van Dimensional zijn ontworpen om de blootstelling aan bedrijven met een hogere CO₂-intensiteit te verlagen en de blootstelling aan bedrijven met een lagere CO₂-intensiteit te verhogen.
- ê Bedrijven met een over het algemeen of in vergelijking met sectorgenoten hogere CO₂-intensiteit worden uitgesloten of onderwogen in de portefeuille, terwijl bedrijven met een over het algemeen of in vergelijking met sectorgenoten lagere CO₂-intensiteit overwogen kunnen zijn in de portefeuille.

Zie "Sustainability Data Description and Disclosures" voor meer informatie. Binnen de doelmarkt, regio en sector van de portefeuille wordt ieder bedrijf geassocieerd van hoogste CO₂-intensiteit tot laagste CO₂-intensiteit. De groep met de Laagste CO₂-intensiteit wordt gedefinieerd als de 10% van de bedrijven met de laagste CO₂-intensiteit. De groep Ondergemiddeld wordt gedefinieerd als de volgende 20%, Gemiddeld als de volgende 40%, Bovengemiddeld als de volgende 20%. De groep met de Hoogste CO₂-intensiteit wordt tot slot gedefinieerd als ongeveer 10% van de bedrijven met de hoogste CO₂-intensiteit. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Gewichtsverdeling naar CO₂-intensiteit

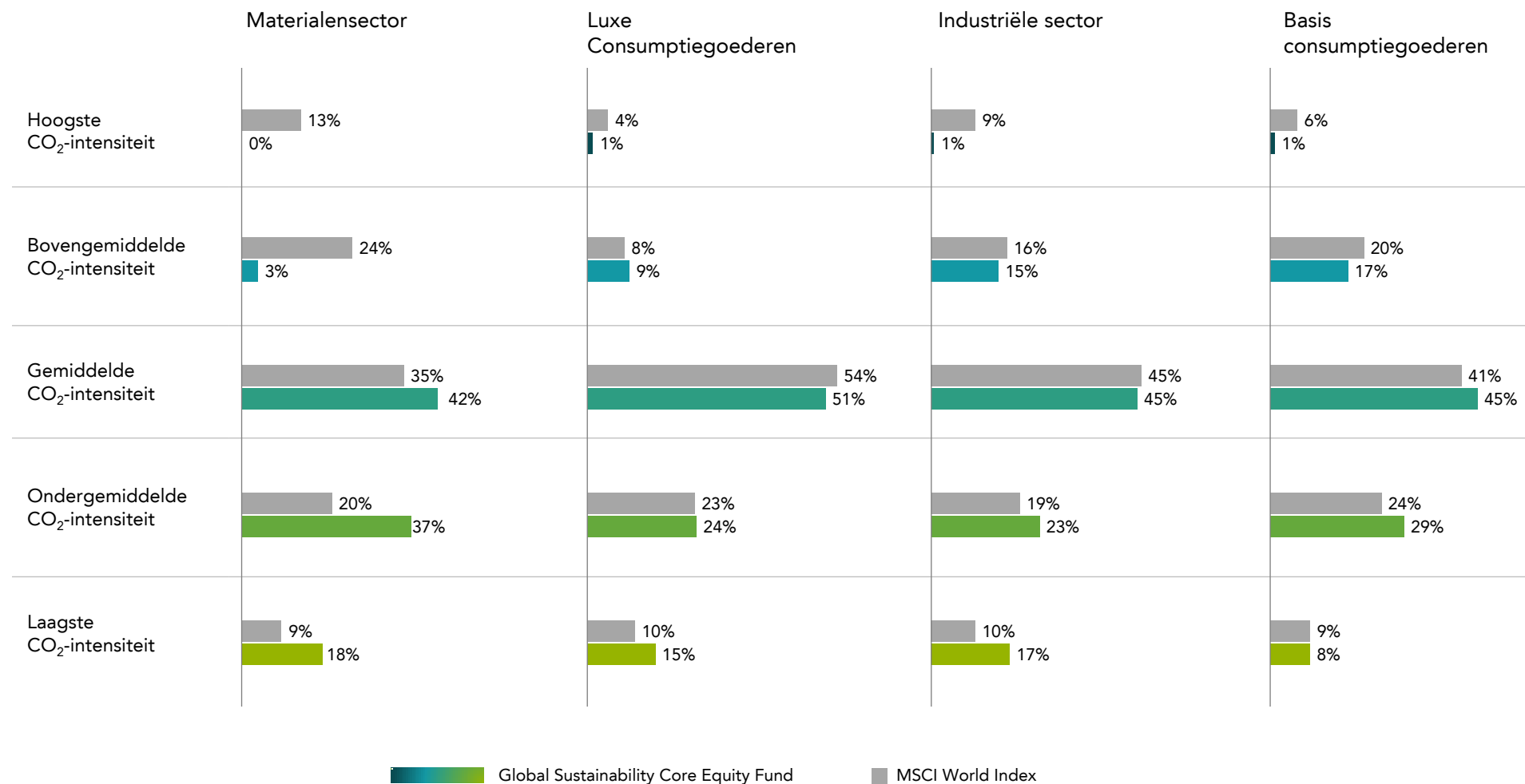
Op 31 december 2024



Zie "Sustainability Data Description and Disclosures" voor meer informatie. Binnen de doelmarkt, regio en sector van de portefeuille wordt ieder bedrijf geclassificeerd van hoogste CO₂-intensiteit tot laagste CO₂-intensiteit. De groep met de Laagste CO₂-intensiteit wordt gedefinieerd als de 10% van de bedrijven met de laagste CO₂-intensiteit. De groep Ondergemiddeld wordt gedefinieerd als de volgende 20%, Gemiddeld als de volgende 40%, Bovengemiddeld als de volgende 20%. De groep met de Hoogste CO₂-intensiteit wordt tot slot gedefinieerd als ongeveer 10% van de bedrijven met de hoogste CO₂-intensiteit binnen de doelmarkt. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Gewichtsverdeling naar CO₂-intensiteit

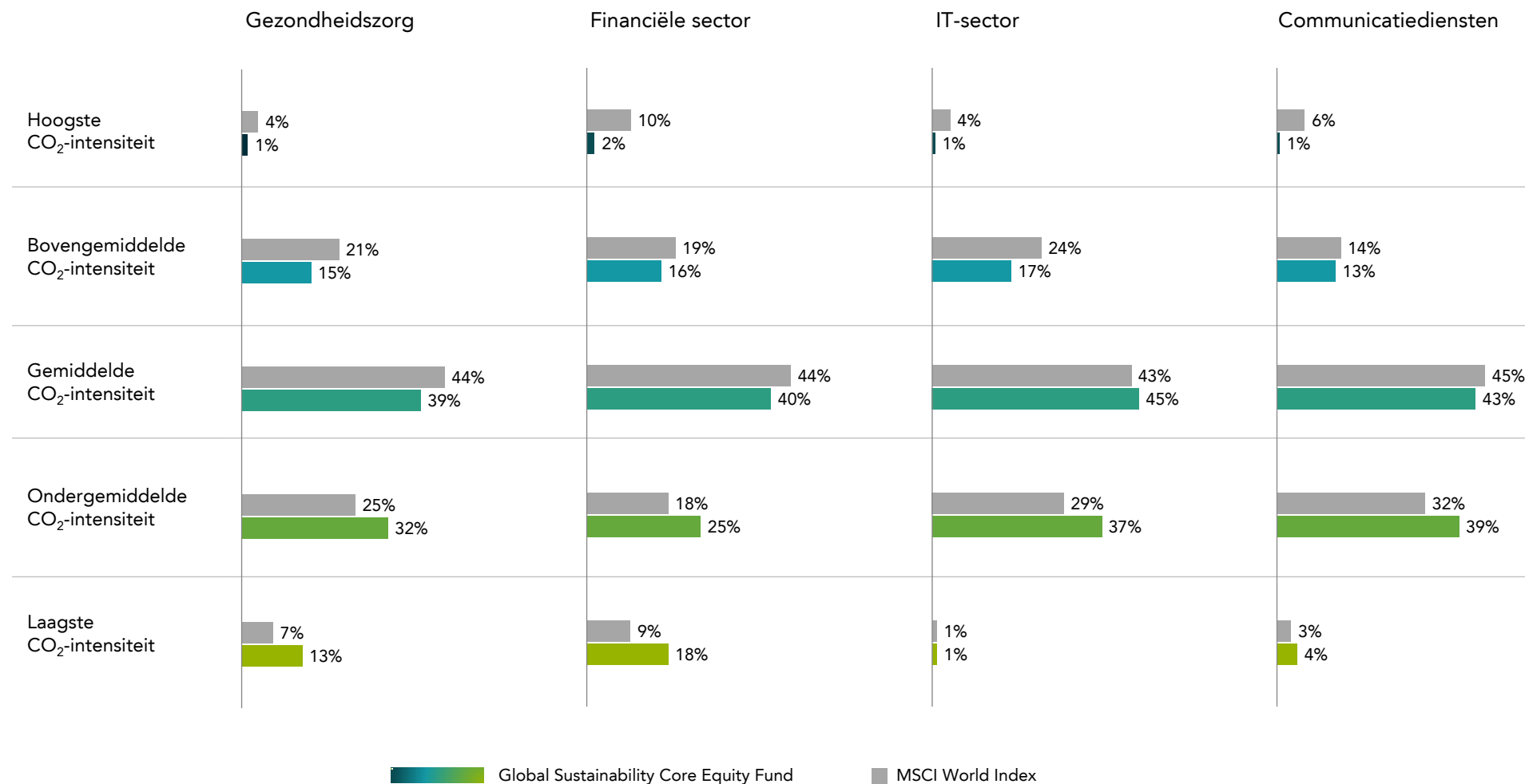
Op 31 december 2024



Zie "Sustainability Data Description and Disclosures" voor meer informatie. Binnen de doelmarkt, regio en sector van de portefeuille wordt ieder bedrijf geïdentificeerd van hoogste CO₂-intensiteit tot laagste CO₂-intensiteit. De groep met de Laagste CO₂-intensiteit wordt gedefinieerd als de 10% van de bedrijven met de laagste CO₂-intensiteit. De groep Ondergemiddeld wordt gedefinieerd als de volgende 20%, Gemiddeld als de volgende 40%, Bovengemiddeld als de volgende 20%. De groep met de Hoogste CO₂-intensiteit wordt tot slot gedefinieerd als ongeveer 10% van de bedrijven met de hoogste CO₂-intensiteit binnen de doelmarkt. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Gewichtsverdeling naar CO₂-intensiteit

Op 31 december 2024

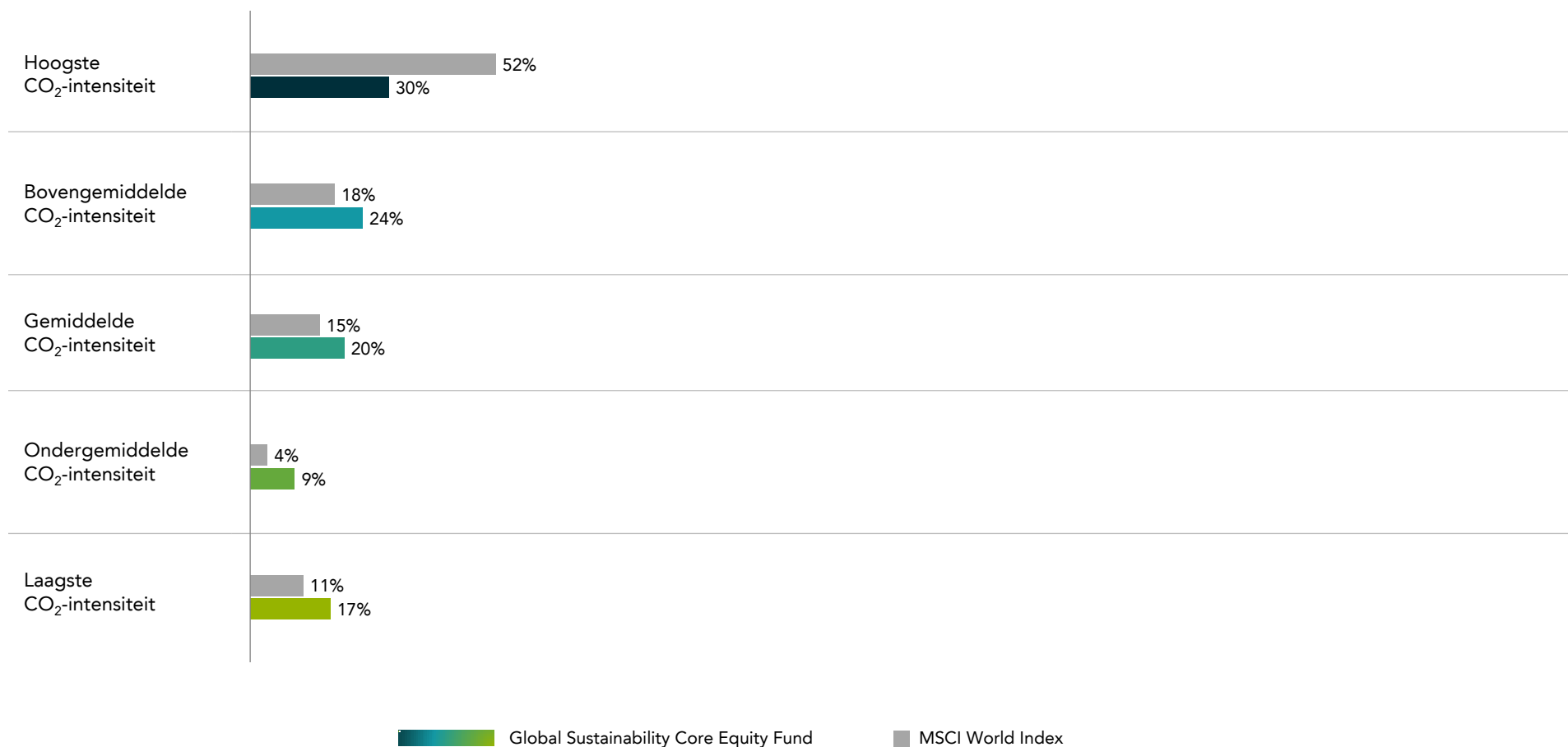


Zie "Sustainability Data Description and Disclosures" voor meer informatie. Binnen de doelmarkt, regio en sector van de portefeuille wordt ieder bedrijf geïdentificeerd van hoogste CO₂-intensiteit tot laagste CO₂-intensiteit. De groep met de Laagste CO₂-intensiteit wordt gedefinieerd als de 10% van de bedrijven met de laagste CO₂-intensiteit. De groep Ondergemiddeld wordt gedefinieerd als de volgende 20%, Gemiddeld als de volgende 40%, Bovengemiddeld als de volgende 20%. De groep met de Hoogste CO₂-intensiteit wordt tot slot gedefinieerd als ongeveer 10% van de bedrijven met de hoogste CO₂-intensiteit binnen de doelmarkt. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Gewichtsverdeling naar CO₂-intensiteit

Op 31 december 2024

Vastgoedsector



Zie "Sustainability Data Description and Disclosures" voor meer informatie. Binnen de doelmarkt, regio en sector van de portefeuille wordt ieder bedrijf geclassificeerd van hoogste CO₂-intensiteit tot laagste CO₂-intensiteit. De groep met de Laagste CO₂-intensiteit wordt gedefinieerd als de 10% van de bedrijven met de laagste CO₂-intensiteit. De groep Ondergemiddeld wordt gedefinieerd als de volgende 20%, Gemiddeld als de volgende 40%, Bovengemiddeld als de volgende 20%. De groep met de Hoogste CO₂-intensiteit wordt tot slot gedefinieerd als ongeveer 10% van de bedrijven met de hoogste CO₂-intensiteit binnen de doelmarkt. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden.

Duurzaamheidsoverwegingen

Sustainability Core Equity Fonds

OP EMISSIE GERICHTE UITSLUITINGEN			
CO ₂ -intensiteit ¹	De meest recent gerapporteerde of geschatte Scope 1 (direct) + Scope 2 (indirecte) BKG-emissies van een bedrijf in kooldioxide-equivalenten (CO ₂ e) genormaliseerd naar omzet (metrische tonnen CO ₂ e per USD miljoen omzet). De opgenomen broeikasgassen zijn kooldioxide (CO ₂), methaan (CH ₄), lachgas (N ₂ O), fluorkoolwaterstoffen (HFK's), perfluorkoolwaterstoffen (PFC's), zwavelhexafluoride (SF ₆) en stikstoftrifluoride (NF ₃).		Uitsluiting van de 5% slechtste bedrijven binnen het toegestane beleggingsuniversum van het fonds. Halvering van de weging van de volgende 5%.
Potentiële emissies uit reserves	Een schatting van de kooldioxide die wordt geproduceerd wanneer de olie-, gas- en steenkoolreserves van een bedrijf worden omgezet in energie, uitgaande van de geschatte koolstof- en energiedichtheden van de respectievelijke reserves.		Uitsluiting van de 5% slechtste bedrijven
WEGING DUURZAAMHEIDSSCORE			
CO ₂ -intensiteit ¹	Zie ook "Op emissie gerichte uitsluitingen".	85% van de score	Binnen sectoren worden bedrijven over het algemeen wel of niet benadrukt binnen het toegestane beleggingsuniversum van het fonds, op basis van de duurzaamheidsscore. Bedrijven die tot de slechtste 10% van hun sector behoren, worden over het algemeen helemaal uitgesloten.
Landgebruik en biodiversiteit	Een beoordeling van de geschiedenis van een bedrijf omtrent het verstoren van grote en/of kwetsbare ecosystemen en of ze een adequaat beleid hebben ontwikkeld om de biodiversiteit te beschermen.	15% van de score	
Giftige lozingen	Een beoordeling van de betrokkenheid van een bedrijf in niet-broeikasgasgerelateerde rechtszaken, kritiek van NGO's op niet-BKG-emissiepraktijken, weerstand tegen verbeteringspraktijken en directe impact als gevolg van niet-BKG-emissies.		
Bedrijfsafval	Een beoordeling van de betrokkenheid van een bedrijf bij niet-gevaarlijk afval gerelateerde rechtszaken, kritiek van NGO's op niet-gevaarlijke afvalpraktijken, weerstand tegen verbeteringspraktijken en directe impact als gevolg van niet-gevaarlijk afval.		
Waterbeheer	Een beoordeling van de geschiedenis van een bedrijf met betrekking tot water gerelateerde rechtszaken, kritiek van NGO's op waterbeheer, weerstand tegen verbeteringspraktijken en directe impact als gevolg van watervervuiling.		

Zie "Bijlage: Informatieverschaffing" voor informatie over het verkrijgen van het Prospectus van het Fonds, dat volledige informatie bevat over de duurzaamheidsoverwegingen van het Fonds.

1. Deze methodologie is onderhevig aan verandering met datontwikkelingen of andere bevindingen of gebeurtenissen.

Duurzaamheidsoverwegingen

Sustainability Fonds

AANVULLENDE ESG-UITSLUITINGEN ^{1,2}	
Steenkool	Bewijs van het bezit van bewezen en waarschijnlijke thermische of metallurgische steenkoolreserves of inkomsten uit de winning van thermische steenkool en de verkoop ervan aan externe partijen.
Palmolie	>20% van de omzet uit palmolieteelt en/of palmolieverwerking.
Bioindustrie	>20% van de omzet uit sectoren gerelateerd aan de bio-industrie.
18+ entertainment	>10% van de omzet uit de productie, distributie of verkoop van entertainmentproducten voor volwassenen.
Alcohol	>10% van de omzet uit de productie, distributie, detailhandel, licentieverlening of levering van alcoholische dranken, belangrijke producten en diensten.
Gokken	>10% van de omzet uit het bezit of de exploitatie van gokfaciliteiten of uit de ondersteuning of diensten aan de gokindustrie.
Tabak	>10% van de omzet uit de productie, distributie, detailhandel, licentieverlening of levering van belangrijke tabaksproducten en -diensten.
Civiele vuurwapens	Alle omzet uit de productie van pistolen, jachtgeweren, geweren, revolvers en munitie voor civiel (niet-militair) gebruik.
Controversiële wapens	Betrokkenheid bij de vervaardiging van clusterprojectielen of antipersoonsmijnen of hun belangrijkste componenten, chemische en biologische wapens of munitie en bepantsering met verarmd uranium, of kernwapens of hun belangrijkste componenten in strijd met het verdrag inzake de niet-verspreiding van kernwapens van 1968 ("NPV").
Nucleaire wapens	Elke betrokkenheid bij de vervaardiging van kernwapens of hun belangrijkste componenten, ongeacht de naleving van het NPV.
Kinderarbeid	Materiële betrokkenheid bij ernstige geschillen rondom kindarbeid.
Particuliere gevangenen	Eigendom of alle omzet van exploitatie van privégevangenen, en/of immigranten detentie faciliteiten.

Databronnen: Afhankelijk van elke ESG-overweging gebruikt Dimensional gegevens van externe leveranciers, waaronder MSCI ESG Research ("MSCI") en ISS. Er kan naar deze gegevens worden verwezen en ze kunnen worden gevalideerd om eigen datasets te creëren. Daarnaast kunnen we intern onderzoek uitvoeren door gebruik te maken van informatie van Bloomberg, gerapporteerde financiële gegevens, andere bedrijfsdocumenten, bedrijfswebsites, brancheorganisaties, branchegroepen of overheidsinstanties om interne datasets te creëren die de externe datasets kunnen aanvullen.

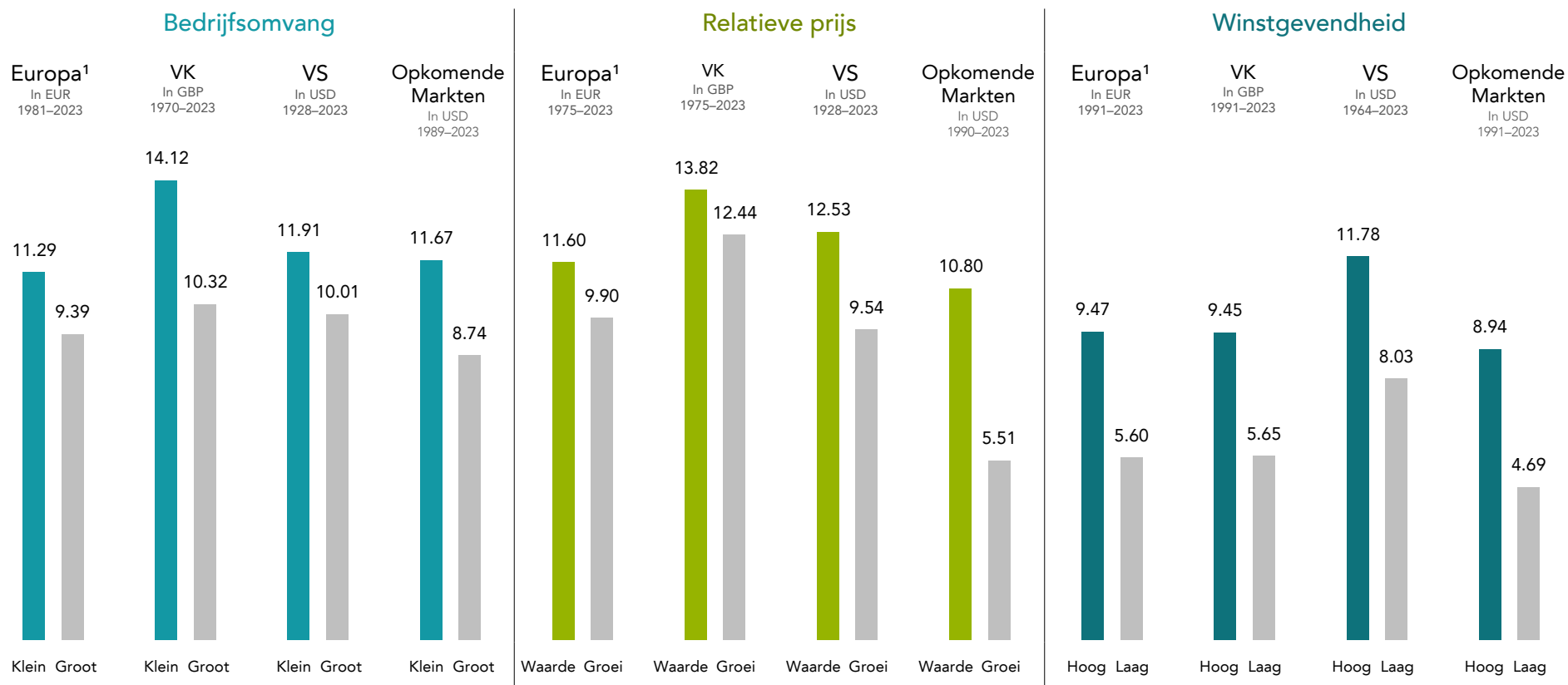
Zie "Bijlage: Informatieverschaffing" voor informatie over het verkrijgen van het Prospectus van het Fonds, dat volledige informatie bevat over de duurzaamheidsoverwegingen van het Fonds.

1. De duurzaamheidsfondsen van Dimensional (a) vermijden aankopen en (b) desinvesteringen van bedrijven die, naar onze mening, betrokken zijn bij deze activiteiten en controverses - bijvoorbeeld eigendomsstructuren, kan ook leiden tot uitsluiting. Mochten bestaande deelnemingen die op het moment van aankoop in overeenstemming waren, vervolgens niet meer in aanmerking komen, dan zullen ze binnen een redelijke termijn worden afgestoten, rekening houdend met omzet, liquiditeit en bijbehorende handelskosten. Uitsluitingen worden niet toegepast op contanten, derivaten of fondsen van derden.

2. Bedrijven kunnen worden uitgesloten vanwege andere factoren die belangrijk worden geacht voor investeerders die geïnteresseerd zijn in duurzaamheid, zoals bedrijven die te maken hebben met belangrijke milieucontroverses.

Dimensies van verwacht rendement

Afbeelding index rendementen: jaarlijks geaccumuleerd (%)



1. Munteenheid is van 1999 – heden aangegeven in euro. Tot 1999 is de munteenheid aangegeven in Duitse mark.

In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. Het werkelijke rendement kan lager zijn. Indices zijn niet beschikbaar voor directe belegging. Hun rendement is zonder aftrek van de kosten die gepaard gaan met het beheer van een werkelijke portefeuille. Prestaties kunnen toe- of afnemen door valutaschommelingen.

De staven in het diagram vertegenwoordigen de volgende indices: Dimensional Europe Small Index, MSCI Europe Index, Dimensional UK Small Cap Index, MSCI UK Index, Dimensional US Small Cap Index, S&P 500 Index, Dimensional Emerging Markets Small Index, MSCI Emerging Markets Index, Fama/French Europe and Scandinavia Value Index, Fama/French Europe and Scandinavia Growth Index, Fama/French UK Value Index, Fama/French UK Growth Index, Fama/French US Value Research Index, Fama/French US Growth Research Index, Fama/French Emerging Markets Value Index, Fama/French Emerging Markets Growth Index, Fama/French Europe High Profitability Index, Fama/French Europe Low Profitability Index, Fama/French UK High Profitability Index, Fama/French UK Low Profitability Index, Fama/French US High Profitability Index, Fama/French US Low Profitability Index, Fama/French Emerging Markets High Profitability Index, Fama/French Emerging Markets Low Profitability Index. MSCI gegevens © MSCI 2024, alle rechten voorbehouden. S&P-gegevens © 2024 S&P Dow Jones Indices LLC, een onderdeel van S&P Global. Alle rechten voorbehouden. De weergegeven Dimensional- en Fama/French-indices zijn geen 'financiële indices' in de zin van de Europese richtlijn Markten in Financiële Instrumenten (MiFID). Deze indices vertegenwoordigen academische concepten die relevant of informatief kunnen zijn in relatie tot de opbouw van de portefeuille en zijn niet beschikbaar voor directe beleggingen of voor gebruik als een benchmark. Zie de appendix voor beschrijvingen van Dimensional- en Fama/French-indices.

De waarderingformule testen

Gemiddeld maandelijks rendement

US Large: 1963–2023

		WINSTGEVENDHEID			Winstgevendheids premie
		LAAG		HOOG	
PRIJS/ BOEKWAARDE	GROEI	0,80	0,96	0,99	0,19
		0,83	0,85	0,99	0,17
	WAARDE	0,89	1,09	1,18	0,29
Waardepemie		0,09	0,13	0,19	

US Small: 1963–2023

		WINSTGEVENDHEID			Winstgevendheids premie
		LAAG		HOOG	
PRIJS/ BOEKWAARDE	GROEI	0,37	0,86	1,07	0,70
		0,94	1,12	1,34	0,40
	WAARDE	1,21	1,33	1,56	0,35
Waardepemie		0,84	0,47	0,49	

Niet-VS ontwikkeld: 1975–2023

		WINSTGEVENDHEID			Winstgevendheids premie
		LAAG		HOOG	
PRIJS/ BOEKWAARDE	GROEI	0,42	0,77	0,82	0,40
		0,78	0,89	0,99	0,21
	WAARDE	1,00	1,10	1,15	0,15
Waardepemie		0,58	0,32	0,33	

Opkomende markten: 1989–2023

		WINSTGEVENDHEID			Winstgevendheids premie
		LAAG		HOOG	
PRIJS/ BOEKWAARDE	GROEI	0,41	0,59	1,10	0,69
		0,50	0,85	0,82	0,32
	WAARDE	0,99	1,03	1,35	0,36
Waardepemie		0,58	0,44	0,25	

In het verleden behaalde resultaten, bieden geen garantie voor de toekomst. Het werkelijke beleggingsrendement kan lager zijn.

In Amerikaanse dollars (USD). US Large en US Small berekend op basis van de door Fama/French US Total Market Research Index gepubliceerde aandelen wegen. Niet-VS Ontwikkeld berekend op basis van de Fama/French International Market Index vóór 1990 en de Fama/French Ontwikkelde ex US Market Index daarna. Opkomende markten berekend op basis van de Fama/French Emerging Markets Index. Door Dimensional berekende aandelenrendementen en classificatie van aandelen op basis van parameters voor omvang, waarde en winstgevendheid. De Fama/French indices vertegenwoordigen academische concepten die kunnen worden gebruikt bij het samenstellen van portefeuilles en zijn niet beschikbaar voor directe beleggingen of voor gebruik als benchmark. Indexrendementen zijn niet representatief voor de werkelijke portefeuilles en weerspiegelen niet de kosten en vergoedingen die aan een werkelijke belegging zijn verbonden. Zie bijlage "De waarde vergelijking testen: Beschrijvingen en belangrijke informatie."

Samenstellen van een robuuste portefeuille

DOELEN

Verhoog verwachte rendementen

Beheer risico's

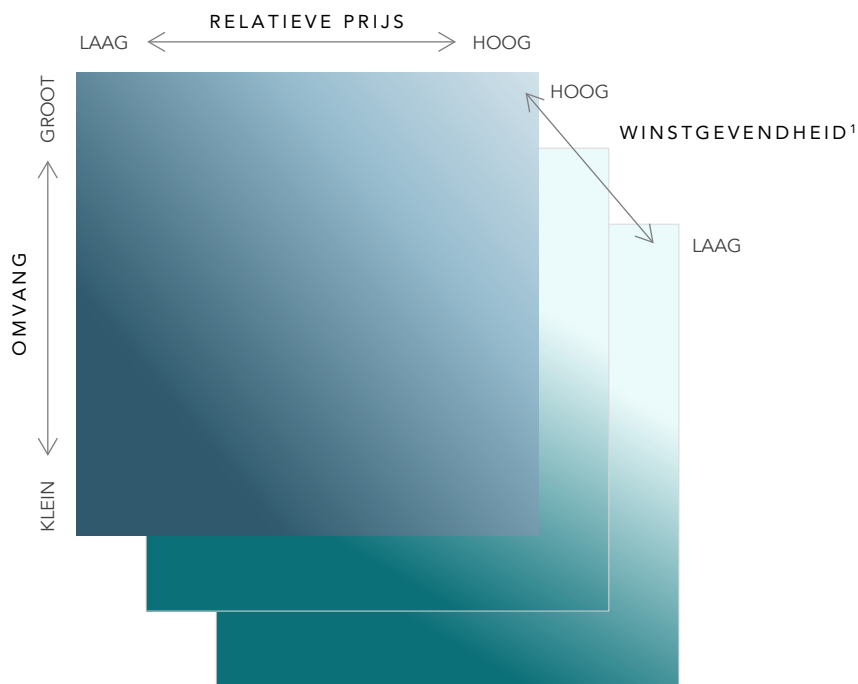
Controle op kosten

OVERWEGINGEN

- Sorteren op variabelen
- Breekpunt definities
- Integratie van dimensies
- Wegingsdistributie
- Mate van focus op dimensies
- Diversificatie op namen, sectoren en landen
- Omzetniveau
- Liquiditeit en verwachte handelskosten

Wat de portefeuille kan kopen

Global Sustainability Core Equity Fund per 31 december 2024



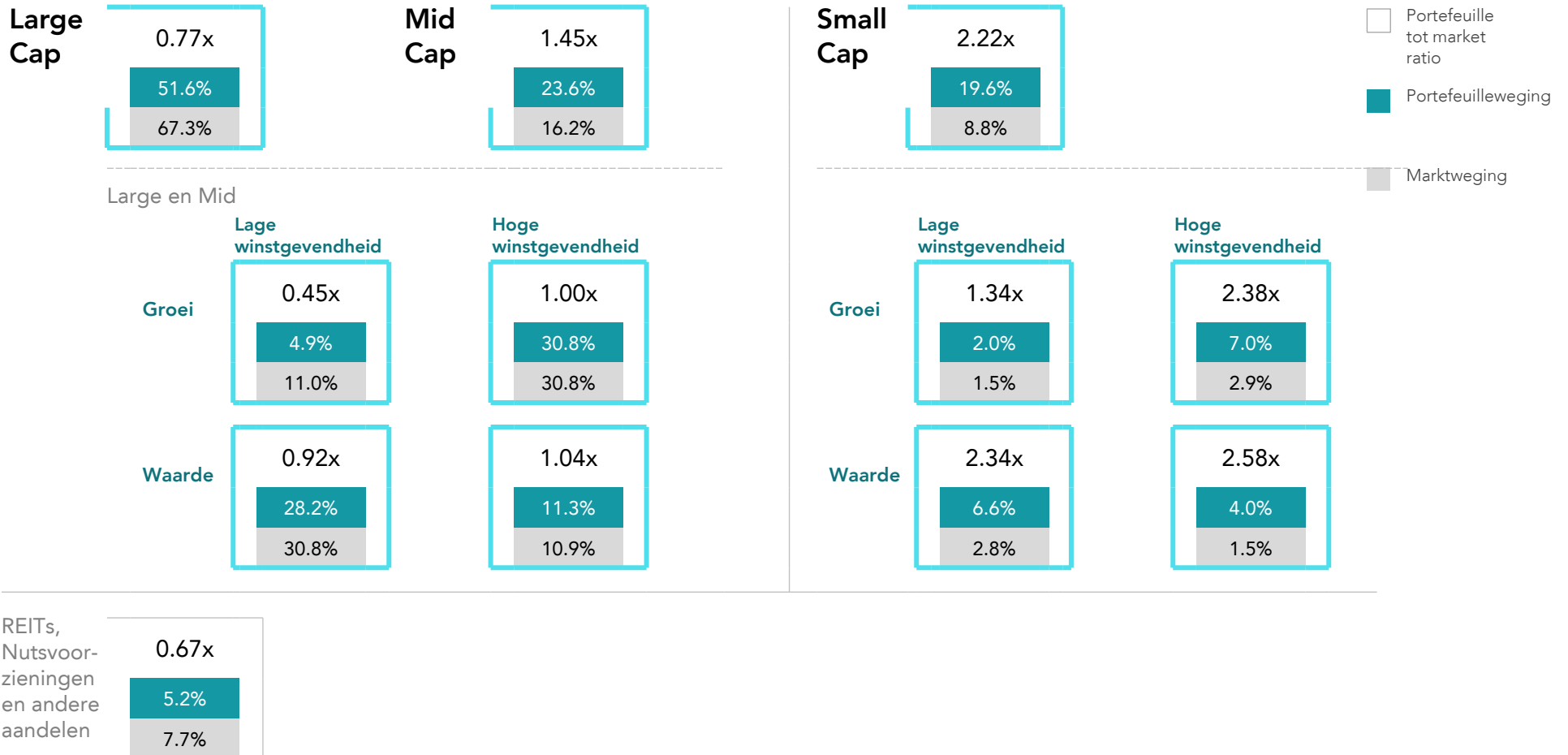
RICHTLIJNEN VOOR GESCHIKTHEID EN WEGING

In aanmerking komende markten	ontwikkelde markten
Aandelenselectie	Alle marktkapitalisaties onder \$50 miljoen
	Binnen small caps, exclusief aandelen met: <ul style="list-style-type: none"> – Lage winstgevendheid¹ en hoge relatieve prijzen – hoge vermogensgroei
	Aandelen uitsluiten op basis van duurzaamheidsoverwegingen
Aandelenweging	Aandelen hoog waarderen met: <ul style="list-style-type: none"> – kleinere marktkapitalisaties – Lagere relatieve prijzen – Hogere winstgevendheid¹
	Duurzame bedrijven hoger waarderen
Concentratiecontroles	Streef naar een brede dekking van in aanmerking komende aandelen om diversificatie over namen en sectoren te realiseren

1. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Niet allesomvattend. De portefeuille wordt beheerd door het prospectus. De criteria die de adviseur gebruikt voor het beoordelen van effecten op bedrijfsgrootte, relatieve prijs, winstgevendheid of activagroei, kunnen van tijd tot tijd worden gewijzigd.

Positionering ten opzichte van de markt

Global Sustainability Core Equity Fund versus de markt per 31 december 2024



De markt wordt vertegenwoordigd door de MSCI World IMI Index. In de VS wordt Large Cap gedefinieerd als ongeveer de grootste 70% van de marktkapitalisatie, Mid Cap de volgende 20% en Small Cap de kleinste 10%. In ontwikkelde markten, behalve de VS, wordt Large Cap gedefinieerd als ongeveer de grootste 70% van de marktkapitalisatie in elk land of elke regio, Mid Cap de volgende 17,5% en Small Cap de kleinste 12,5%. In opkomende markten wordt Large Cap gedefinieerd als ongeveer de grootste 70% van de marktkapitalisatie in elk land of elke regio, Mid Cap de volgende 15% en Small Cap de kleinste 15%. Aanduidingen tussen waarde en groei zijn gebaseerd op price-to-book-ratio. Waarde wordt gedefinieerd als de 50% van de marktkapitalisatie met de laagste price-to-book-ratio per groottecategorie en de groei is de hoogste 50%. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Hoge winstgevendheid wordt gedefinieerd als de 50% van de marktkapitalisatie met de hoogste winstgevendheid per klasse en lage winstgevendheid is de laagste 50%. REIT's, hulpprogramma's en andere aandelen omvatten REIT's en hulpprogramma's, geïdentificeerd door de GICS-code, en aandelen zonder maatstaven voor grootte, relatieve prijs of winstgevendheid. Onderliggende belangen in rechten, warrants, contanten, kasequivalenten, ETF's en obligaties zijn uitgesloten. Gewichten kunnen door afronding niet 100% optellen. MSCI-gegevens © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden. GICS is ontwikkeld door en is het exclusieve eigendom van MSCI en S&P Dow Jones Indices LLC, een divisie van S&P Global. De index wordt alleen gebruikt voor vergelijkende doeleinden. Indices zijn niet beschikbaar voor directe investeringen. Het fonds wordt actief beheerd en wordt niet beheerd op basis van een benchmark.

Belangrijke Informatie—Klasse: duurzaamheid

Aan beleggingen zijn risico's verbonden. Het beleggingsrendement en de waarde van een belegging kunnen fluctueren. De aandelen van een belegger kunnen bij verkoop meer of minder waard zijn dan de oorspronkelijke waarde. Er is geen garantie dat strategieën succesvol zullen zijn.

De rendementsgegevens geven de in het verleden behaalde resultaten weer en vormen geen garantie voor toekomstige resultaten. De huidige rendementen kunnen hoger of lager zijn dan de weergegeven rendementen. Het rendement kan stijgen of dalen als gevolg van valutaschommelingen.

De duurzaamheidsoverwegingen van het Fonds kunnen het aantal beschikbare beleggingsmogelijkheden beperken, en als gevolg daarvan kunnen zij soms een ander rendement of bescheidener winsten opleveren dan fondsen die niet aan dergelijke speciale beleggingsvoorwaarden onderworpen zijn. Overwegingen inzake duurzaamheidsimpact kunnen ertoe leiden dat de sectorallocatie van een Fonds afwijkt van die van fondsen zonder deze overwegingen en van conventionele benchmarks.

Het Fonds promoot duurzaamheid in overeenstemming met artikel 8 van Verordening (EU 2019/2088) betreffende informatieverschaffing over duurzaamheid in de financiële dienstensector (SFDR).

Het Fonds promoot duurzaamheid in overeenstemming met artikel 8 van Verordening (EU 2019/2088) betreffende informatieverschaffing over duurzaamheid in de financiële dienstensector (SFDR). Het Fonds heeft duurzaam beleggen niet als doelstelling, maar als onderdeel van het beleggingsbeleid van het Fonds houdt de Beheerder wel rekening met de duurzaamheidseffecten die samenhangen met effecten bij het nemen van beleggingsbeslissingen voor het Fonds. Hoewel het Fonds duurzaamheid promoot en de Beheerder rekening houdt met overwegingen inzake duurzaamheidseffecten, worden de beleggingen van het Fonds niet getoetst aan de EU-criteria voor ecologisch duurzame economische activiteiten en daarom is het beginsel " geen significante schade toebrengen" niet van toepassing op de beleggingen van het Fonds. Raadpleeg de beleggingsdoelstellingen van de Dimensional fondsen zorgvuldig voordat u belegt. Lees voor deze en andere informatie over de Dimensional-fondsen het prospectus, EID en het EBI document zorgvuldig door voordat u belegt. Informatie over duurzaamheids-gerelateerde publicaties in de financiële dienstensector (SFDR) op grond van Verordening (EU) 2019/2088 met betrekking tot het gepromote fonds is beschikbaar op www.dimensional.com/SFDR.

Het Fonds kan zijn activa beleggen in andere onderliggende fondsen. Het rendement, de kosten en de risico's van het Fonds zullen worden beïnvloed door de onderliggende fondsen. Er kan geen garantie worden gegeven dat een onderliggend fonds zijn of haar beleggingsdoelstelling zal behalen.

Het Fonds kan beleggen in kleinere ondernemingen. Dit houdt een hoger risico in, aangezien aandelen van kleine ondernemingen vaak lastiger te verkopen zijn dan die van grote ondernemingen, en hun aandelenkoers als hiervan sterker kan fluctueren. In het algemeen zijn kleinere ondernemingen ook kwetsbaarder voor ongunstige marktomstandigheden dan grotere ondernemingen.

Het Fonds belegt in opkomende markten, die economisch of politiek minder ontwikkeld kunnen zijn en die grotere risico's met zich mee kunnen brengen dan goed ontwikkelde economieën. Onder meer zijn verminderde liquiditeit, politieke onrust en economische neergang waarschijnlijker en kunnen de waarde van uw belegging beïnvloeden. Beleggingen in opkomende markten kunnen duurder zijn en kunnen moeilijker zijn om te kopen, te verkopen en om uit te stappen. Beleggingen in opkomende markten hebben ook een verhoogd afwikkelingsrisico (settlement risk).

Het Fonds kan streven naar het identificeren van en beleggen in waarde-aandelen. Dat zijn (naar de mening van de Beheerder) aandelen waarvan de koersen laag zijn in vergelijking met de boekhoudkundige waarde van de ondernemingen die ze uitgeven. Waarde-aandelen kunnen anders presteren dan de markt als geheel en het volgen van een waarde-georiënteerde beleggingsstrategie kan ertoe leiden dat het Fonds soms minder goed presteert dan fondsen die andere beleggingsstrategieën hanteren.

Het Fonds kan beleggen in verhandelbare schuldinstrumenten (obligaties), waarvan het rendement afhangt van het vermogen of de bereidheid van de uitgevende instelling om zijn betalingsverplichting te voldoen. Er bestaat een risico dat de uitgevende instelling dit niet doet. Hoewel het Fonds over het algemeen belegt in obligaties met een hoge rating, zijn deze ratings subjectief en biedt een hoge rating geen garantie dat een uitgevende instelling in staat of bereid is om te betalen.

Het Fonds kan derivaten gebruiken om te proberen om risico's te verminderen (hedging) of voor beleggingsdoeleinden. Derivaten kunnen risicovolle activa zijn. Ze kunnen onderhevig zijn aan risico's zoals tegenpartijrisico's, liquiditeitsrisico's, renterisico's, marktrisico's, kredietrisico's, beheerrisico's en onjuiste waardering. Het Fonds kan op zijn of haar beurt hierdoor worden beïnvloed en de koers van het aandeel kan fluctueren, wat kan resulteren in een verlies voor het Fonds.

Meer informatie over risico's in het algemeen is te vinden in het deel "Risk Factors" van het prospectus. Zie de bijlage bij de slide "Informatie" voor informatie over hoe u de meest recente versie van het EID, EBI en het Prospectus kunt verkrijgen.

Toelichtingen

UITSLUITEND VOOR PROFESSIONEEL GEBRUIK. NIET BEDOELD VOOR ALGEMEEN GEBRUIK OF PARTICULIERE BELEGERS.

INDIEN UITGEGEVEN DOOR DIMENSIONAL IRELAND LIMITED

Deze informatie is uitgegeven door Dimensional Ireland Limited (Dimensional Ireland), statutair gevestigd te 3 Dublin Landings, North Wall Quay, Dublin 1, Ierland. Dimensional Ireland staat onder toezicht van de Centrale Bank van Ierland (onder registratienummer C185067).

Deze informatie is uitsluitend bestemd voor professionele cliënten in de zin van Richtlijn betreffende markten voor financiële instrumenten (MiFID) (2014/65/EU).

INDIEN UITGEGEVEN DOOR DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD.

Deze informatie is uitgegeven door Dimensional Fund Advisors Ltd. (Dimensional UK), 20 Triton Street, Regent's Place, London, NW1 3BF, geregistreerd onder nummer 02569601. Dimensional UK staat onder de toezicht van de Financial Conduct Authority (FCA) onder nummer 150100.

Deze informatie is uitsluitend bestemd voor professionele cliënten zoals nader gedefinieerd door de door FCA uitgegeven regelgeving.

De informatie in dit document is uitsluitend bedoeld voor eigen gebruik door en dient als achtergrondinformatie voor de ontvanger. De informatie is in goed vertrouwen verstrekt, zonder enige garanties te doen omtrent de nauwkeurigheid en volledigheid daarvan. Informatie of opinies gepresenteerd in dit materiaal zijn verkregen of afgeleid uit bronnen die door Dimensional Ireland en Dimensional UK relevant en betrouwbaar worden geacht (waar de context het vereist zullen DIF en Dimensional UK in het hiernavolgende afzonderlijk worden aangeduid als de "Uitgevende Entiteit") en de Uitgevende Entiteit goede redenen heeft om aan te nemen dat alle feitelijke informatie uit dit document juist is op de datum van dit document. Er is geen sprake van een beleggingsadvies, aanbeveling of een aanbod van diensten of producten en het verstrekken van de informatie wordt niet beoogd een voldoende basis te bieden voor het nemen van een beleggingsbeslissing. Het is de verantwoordelijkheid van de personen die besluiten tot het doen van aankoop om zich daarover voldoende te informeren en de van toepassing zijnde wet- en regelgeving na te leven. Het is niet toegestaan om dit document te kopiëren, te dupliceren of te verzenden naar derden zonder de voorafgaande toestemming van de Uitgevende Entiteit. De Uitgevende Entiteit aanvaardt geen aansprakelijkheid voor schade die voortvloeit uit het gebruik van de hierin opgenomen informatie.

De Uitgevende Entiteit verstrekt informatie en materialen in het Engels, maar kan deze informatie en materialen tevens in andere talen verstrekken. De aanvaarding van de ontvanger van de informatie en materialen van de Uitgevende Instellingen houdt tevens in dat de ontvanger aanvaardt dat deze informatie en materialen aan hem kunnen worden verstrekt, waar relevant, in meer dan één taal.

De informatie over het rendement is aangeleverd door Dimensional UK, vanaf de datum van het materiaal tenzij anders vermeld. Bezoek de website Dimensional.com voor de meest recente resultaten op het einde van de maand. Het gemiddelde totale jaarendement omvat herbelegging van dividenden en kapitaalwinsten.

De aanduiding naar 'Dimensional' verwijst naar het geheel van de afzonderlijke en aan Dimensional verbonden entiteiten, en niet naar één specifieke entiteit. Deze entiteiten betreffen: Dimensional Fund Advisors LP, Dimensional Fund Advisors Ltd., DFA Australia Limited, Dimensional Fund Advisors Canada ULC, Dimensional Fund Advisors Pte. Ltd., Dimensional Ireland Limited, Dimensional Japan Ltd. en Dimensional Hong Kong Limited. Dimensional Hong Kong Limited staat onder toezicht van de Securities and Futures Commission en is bevoegd om gereguleerde Type 1 (effectenhandel) activiteiten te verrichten. Dimensional Hong Kong Limited biedt geen vermogensbeheerdiensten aan.

Dit is een reclame. Raadpleeg het prospectus van de icbe, Eid en de EBI voordat u een beleggingsbeslissing neemt.

DIMENSIONAL FUNDS PLC:

Het Emerging Markets Large Cap Core Equity Fund, Emerging Markets Value Fund, Euro Inflation Linked Intermediate Duration Fixed Income Fund, European Core Equity Fund, European Small Companies Fund, European Value Fund, Global Core Equity Fund, Global Core Fixed Income Fund, Global Short Fixed Income Fund, Global Short-Term Investment Grade Fixed Income Fund, Global Small Companies Fund, Emerging Markets Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Fixed Income Fund, Global Sustainability Short Fixed Income Fund, Global Sustainability High

Profitability Fund, Global Sustainability Targeted Value Fund, World Sustainability Equity Fund (de implementatie en management van het Emerging Markets Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Core Equity Fund, Global Sustainability Fixed Income Fund, Global Sustainability Short Fixed Income Fund, Global Sustainability High Profitability Fund, Global Sustainability Targeted Value Fund et World Sustainability Equity Fund is beschermd door het U.S. Patent Nos. 7,596,525 B1, 7,599,874 B1 and 8,438,092 B2), Global Targeted Value Fund, Global Ultra Short Fixed Income Fund, Global Value Fund, Japan Core Equity Fund, Pacific Basin Small Companies Fund, Sterling Inflation Linked Intermediate Duration Fixed Income Fund, U.S. Core Equity Fund, U.S. Small Companies Fund, U.S. Value Fund, World Allocation 20/80 Fund, World Allocation 40/60 Fund, World Allocation 60/40 Fund, World Allocation 80/20 Fund en World Equity Fund zijn sub-fondsen van Dimensional Funds plc, gestructureerd als een paraplufonds met gescheiden aansprakelijkheid tussen de sub-fondsen. Dit zijn open-ended beleggingsmaatschappijen met veranderlijk kapitaal en zijn opgericht met beperkte aansprakelijkheid tussen de subfondsen naar lers recht, met respectievelijk registratienummers 352043. Dimensional Funds plc is in Ierland geautoriseerd door de Ierse Centrale bank (Central Bank of Ireland) als een instelling voor collectieve belegging in effecten (icbe).

DIMENSIONAL FUNDS II PLC:

Emerging Markets Targeted Value Fund is een subfonds van Dimensional Funds II plc en is gestructureerd als een paraplufonds met gescheiden aansprakelijkheid tussen de sub-fondsen, zijn open-ended beleggingsmaatschappijen met veranderlijk kapitaal en zijn opgericht met beperkte aansprakelijkheid tussen de subfondsen naar lers recht, met respectievelijk registratienummers 431052. Dimensional Funds II plc kwalificeren en zijn ieder in Ierland geautoriseerd door de Ierse Centrale bank (Central Bank of Ireland) als een instelling voor collectieve belegging in effecten (icbe).

DIMENSIONAL FUNDS ICVC:

Het United Kingdom Core Equity Fund, United Kingdom Value Fund, United Kingdom Small Companies Fund, International Core Equity Fund, International Value Fund, Emerging Markets Core Equity Fund en het Global Short Dated Bond Fund zijn sub-fondsen van Dimensional Funds ICVC (de "Dimensional fondsen"). Dimensional Funds ICVC is een beleggingsmaatschappij met veranderlijk kapitaal en beperkte aansprakelijkheid en is geregistreerd in Engeland en Wales onder registratienummer IC000258 en is geautoriseerd door de Britse Financial Conduct Authority ("FCA") als een Britse icbe. Dimensional Fund Advisors Ltd. is de 'Authorised Corporate Director' (gemachtigd rechtspersoon-bestuurder) van Dimensional Funds ICVC. De subfondsen opereren afzonderlijk van elkaar en het vermogen van ieder subfonds worden beheerd in overeenstemming met de beleggingsdoelstelling en het beleggingsbeleid die van toepassing zijn op dat subfonds.

Dimensional Funds ICVC (de "UK Fondsen"), Dimensional Funds plc en Dimensional Funds II plc (de "Ierse Fondsen") (gezamenlijk de "Dimensional fondsen") worden uitsluitend aangeboden onder de voorwaarden van het huidige prospectus van het desbetreffende fonds en de van toepassing zijnde ICBE Essentiële beleggingsinformatie ('EBI') en het toepasselijke verpakte retailbeleggingsproducten en verzekeringsgebaseerde beleggingsproducten (PRIIP's) - Essentiële-informatiedocument (Eid). Weeg de beleggingsdoelstellingen, risico's, en de kosten en uitgaven van de Dimensional fondsen af alvorens te beleggen. Voor deze en andere informatie over de Dimensional fondsen verzoeken wij u om het prospectus, het Eid en de EBI zorgvuldig te lezen alvorens te investeren. De recente versie van het prospectus, toepasselijke ICBE EBI (beschikbaar in het Engels) en toepasselijke PRIIP's Eid (beschikbaar in het Engels en de van toepassing zijnde lokale taal) voor de UK Fondsen kunnen worden verkregen via www.dimensional.com of door contact op te nemen met de administrateur van het betreffende fonds of diens vermogensbeheerder via: +44 (0)20 3033 3300. De recente versie van het prospectus, toepasselijke ICBE EBI (beschikbaar in het Engels) en toepasselijke PRIIP's Eid (beschikbaar in het Engels en de van toepassing zijnde lokale taal) voor de Ierse Fondsen kunnen worden verkregen via www.dimensional.com of door contact op te nemen met de administrateur van het betreffende fonds via +353 1 242 5536, de distributeur Dimensional Ireland Limited via +353 1 669 8500, of in het Verenigd Koninkrijk via de sub-distributeur Dimensional Fund Advisors Ltd. via +44 (0)20 3033 3300.

In aanvulling, een samenvatting van de rechten van investeerders is beschikbaar via www.dimensional.com/ssr. Deze samenvatting is in de Engelse taal.

Dimensional Funds plc en Dimensional Funds II plc zijn op dit moment geregistreerd voor aanbidding in een aantal EU lidstaten onder de ICBE-richtlijn. Dimensional Funds plc en Dimensional Funds II plc kunnen deze registraties op elk moment beëindigen voor Dimensional fondsen in overeenstemming met de procedure zoals opgenomen in artikel 93a van de ICBE richtlijn.

Toelichtingen

RISICO'S

Beleggen brengt risico's met zich mee. Het beleggingsrendement en de hoofdsom van de beleggingen kunnen fluctueren zodat de waarde van de beleggingen van de investeerder, bij verkoop ervan, mogelijk meer of minder waard kunnen zijn dan hun oorspronkelijke waarde. In het verleden behaalde resultaten, bieden geen garantie voor de toekomst. Daarnaast kan niet worden gegarandeerd dat strategieën succesvol zullen zijn.

Opgenomen prestatiegegevens zien op prestaties uit het verleden en zijn geen garantie voor toekomstige resultaten. Huidige prestaties kunnen hoger zijn, maar ook lager dan de opgenomen gegevens. Prestaties kunnen toe- of afnemen door valutaschommelingen. De waarde van het beleggingsrendement en het ingelegde kapitaal kunnen zowel dalen als stijgen. Bij verkoop van uw beleggingen kan de waarde meer of minder zijn dan de oorspronkelijke prijs. Zie "Bijlage: Informatieverschaffing" over hoe u volledige informatie kunt krijgen over prestaties, beleggingsdoelstellingen, risico's, advieskosten en de uitgaven van de Dimensional-fondsen.

De belangrijkste risico's van het beleggen in de Dimensional-fondsen bestaan uit een of meer van de volgende risico's: marktrisico, kleinkapitaalrisico, concentratierisico in de vastgoedsector, risico's van buitenlandse effecten en vreemde valuta's, risico van opkomende markten, risico van concentratie van banken, renterisico, inflatierisico, risico van obligaties en/of het fund-of-fundrisico. Om de risico's van een belegging in de fondsen beter te begrijpen, moeten beleggers het prospectus van elk fonds en de toepasselijke EID en EBI zorgvuldig lezen.

Beschrijving duurzaamheidsgegevens en openbaarmakingen

Openbaarmaking van dataverstrekker

Bepaalde informatie die hierin is opgenomen, is verstrekt door Institutional Shareholder Services Inc. ("ISS") en door MSCI ESG Research Inc. ("ESG"). Hoewel de informatieleveranciers van Dimensional Fund Advisors, met inbegrip van maar niet beperkt tot ESG en zijn filialen (de "ESG-partijen"), informatie verkrijgen van bronnen die zij betrouwbaar achten, garandeert of waarborgt geen van de ESG-partijen de originaliteit, nauwkeurigheid en/of volledigheid van de hierin opgenomen gegevens. Geen van de ESG-partijen geeft uitdrukkelijke of impliciete garanties van welke aard dan ook, en de ESG-partijen wijzen hierbij uitdrukkelijk alle garanties van verhandelbaarheid en geschiktheid voor een bepaald doel af, met betrekking tot de hierin opgenomen gegevens. Geen van de ESG-partijen is aansprakelijk voor eventuele fouten of ontbrekende gegevens. Zonder het voorgaande te beperken, zijn de ESG-partijen in geen geval aansprakelijk voor directe, indirecte, speciale, straf-, gevolg- of andere schade (met inbegrip van winstderving), zelfs indien zij op de hoogte zijn gebracht van de mogelijkheid van dergelijke schade.

Aanvullende informatie

Gegevens over CO₂-intensiteit en potentiële emissies uit reserves worden verstrekt door externe dataleveranciers en de methodologie kan worden gewijzigd naar aanleiding van ontwikkelingen in de gegevens of andere bevindingen of gebeurtenissen. Emissiegegevens van derden zijn voor meer dan 99% van de openbare bedrijven beschikbaar. Voor bedrijven waarvoor geen gegevens beschikbaar zijn, past Dimensional een gemiddelde waarde voor de sector toe.

De waarderingsformule testen: Beschrijving en belangrijke informatie

US Large en US Small: 1963–2023

Bron: CRSP en Compustat data. Van 1963 tot 2023 worden de aandelen telkens eind juni op prijs-boekwaarde gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de markt vertegenwoordigt. Daarnaast worden aandelen op winstgevendheid gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de markt vertegenwoordigt. Nutsvoorzieningen zijn uitgesloten. De hierboven gerapporteerde maandelijkse rendementen gelden voor de punten waar de drie portefeuilles samenkomen, welke zijn samengesteld op basis van prijs-boekwaarde en de drie portefeuilles die zijn samengesteld op basis van winstgevendheid.

Niet-VS ontwikkelde markten: 1975–2023

Bron: Bloomberg. In aanmerking komende aandelen in elke niet-VS ontwikkelde markt, worden op prijs-boekwaarde gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de totale marktkapitalisatie van dat land vertegenwoordigt. Daarnaast worden aandelen op winstgevendheid gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de totale marktkapitalisatie van dat land vertegenwoordigt. Aandelen met een negatieve of ontbrekende prijs-boekwaarde of ontbrekende winstgevendheid zijn uitgesloten. Uit de punten waarop de drie portefeuilles, samengesteld op prijs-boekwaarde en de drie portefeuilles gevormd op winstgevendheid samenkomen, stellen we negen winstgevendheid/prijs-boekwaarde portefeuilles samen. Portefeuilles worden jaarlijks in december geherbalanceerd.

Niet-VS ontwikkelde markten (per 31 december 2023) zijn onder andere: Australië, Oostenrijk, België, Canada, Denemarken, Finland, Frankrijk, Duitsland, Hongkong, Ierland, Israël, Italië, Japan, Nederland, Nieuw-Zeeland, Noorwegen, Portugal, Singapore, Spanje, Zweden, Zwitserland en het Verenigd Koninkrijk.

Opkomende markten: 1989–2023

Bron: Bloomberg. In aanmerking komende aandelen in elk opkomend land worden op prijs-boekwaarde gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de totale marktkapitalisatie van dat land vertegenwoordigt. Daarnaast worden aandelen op winstgevendheid gesorteerd in drie portefeuilles, die elk een derde van de totale

marktkapitalisatie van dat land vertegenwoordigt. Aandelen met een negatieve of ontbrekende prijs-boekwaarde of ontbrekende winstgevendheid zijn uitgesloten. Uit de punten waarop de drie portefeuilles, samengesteld op prijs-boekwaarde en de drie portefeuilles gevormd op winstgevendheid samenkomen, stellen we negen winstgevendheid/prijs-boekwaarde portefeuilles samen. Portefeuilles worden jaarlijks in december geherbalanceerd.

Opkomende markten (per 31 december 2023) zijn onder andere: Argentinië, Brazilië, Chili, China, Colombia, Tsjechië, Egypte, Griekenland, Hongarije, India, Indonesië, Maleisië, Mexico, Pakistan, Peru, Filipijnen, Polen, Qatar, Saoedi-Arabië, Zuid-Afrika, Zuid-Korea, Taiwan, Thailand, Turkije en de Verenigde Arabische Emiraten.

Indexbeschrijvingen:

Fama/French Total US Market Research Index: Juli 1926 – heden: Fama/French Total US Market Research Factor + Amerikaanse staatsobligaties met een looptijd van één maand. Bron: Ken French website. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French International Market Index: Januari 1975 – heden: Fama/French International Market Index. Bron: Ken French website. Nagebootst op basis van MSCI-en Bloomberg-data. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French Developed ex US Market Index: Juli 1990 – heden: Fama/French Developed ex US Market Index. Jaarlijks geherbalanceerd in juni. Bevat alle aandelen met aandelenmarktdata vanaf de herbalanceringsdatum. Bron: Ken French website.

Fama/French Emerging Markets Index: Juli 1989 – heden: Fama/French Emerging Markets Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg- en IFC-aandelendata. Bedrijven gewogen op basis van float-gecorrigeerde marktkapitalisatie; jaarlijks in juni geherbalanceerd. Fama/French en multifactor data geleverd door Fama/French.

Resultaten die worden getoond tijdens perioden voorafgaand aan de startdatum van de index van elke index, vertegenwoordigen niet het werkelijke rendement van de betreffende index. Andere geselecteerde periodes kunnen verschillende resultaten opleveren, inclusief verliezen. Backtested indexprestaties zijn hypothetisch en worden alleen ter informatie verstrekt om historische prestaties aan te geven, als de index over de relevante tijdsperiodes was berekend. Backtested prestatieresultaten veronderstellen de herbelegging van dividenden en winsten. De indices die hierboven worden weergegeven zijn geen "financiële indices" in de zin van de EU-richtlijn betreffende markten voor financiële instrumenten (MiFID). In plaats daarvan vertegenwoordigen ze academische concepten die relevant of informatief kunnen zijn voor het portefeuilleontwerp en die niet beschikbaar zijn voor directe beleggingen of voor gebruik als benchmark. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Eugene Fama en Ken French zijn lid van de raad van bestuur van beherend venoot van, en verstrekken adviesdiensten aan, Dimensional Fund Advisors LP.

Indexbeschrijvingen

Dimensional US Small Cap Index: Juni 1927–december 1974: Dimensional US Small Cap Index Samenstelling: Marktkapitalisatie-gewogen index bestaande uit aandelen van de kleinste Amerikaanse bedrijven waarvan de marktkapitalisatie in de laagste 8% van de totale marktkapitalisatie van de in aanmerking komende markt valt. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen. Bron: CRSP en Compustat. Januari 1975–heden: Dimensional Amerikaanse Small Cap Index Samenstelling: Marktkapitalisatie-gewogen index van aandelen, bestaande uit de kleinste Amerikaanse bedrijven waarvan de marktkapitalisatie in de laagste 8% van de totale marktkapitalisatie van de in aanmerking komende markt valt. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen en bedrijven met de laagste winstgevendheid en hoogste relatieve prijs binnen het smallcap-universum. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: CRSP en Compustat. De Dimensional US Small Cap Index is retrospectief berekend door Dimensional Fund Advisors en bestond niet vóór 1 maart 2007. De maandelijkse indexrendementen worden berekend als het eenvoudige gemiddelde van de maandelijkse rendementen van 12 sub-indices, waarvan ieder jaarlijks wordt geherbalanceerd. De index wordt niet beheerd en is niet onderworpen aan vergoedingen en onkosten die doorgaans worden geassocieerd met beheerde rekeningen of beleggingsfondsen. De berekeningsmethode voor de Dimensional US Small Cap Index is op 1 januari 2014 gewijzigd om winstgevendheid op te nemen als een factor bij het selecteren van aandelen voor opname in de index.

Dimensional US High Profitability Index: Juli 1963–heden: Dimensional US High Profitability Index werd in januari 2014 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit Amerikaanse bedrijven. De index is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen in op basis van drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie. Evenzo worden aandelen verdeeld binnen drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een hoge winstgevendheid. Deze wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: CRSP en Compustat.

Dimensional US Low Profitability Index: Juli 1963–heden: Dimensional US Low Profitability Index werd in januari 2014 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit Amerikaanse bedrijven. Het is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen in op basis van drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie. Evenzo worden aandelen verdeeld binnen drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. Index Composition: A subset of the US Large Cap Index. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een lage winstgevendheid. Deze wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: CRSP en Compustat.

Dimensional US Large Cap Value Index: Juni 1927–december 1974: Dimensional Amerikaanse Large Cap Value Index

De Dimensional Indices zijn met terugwerkende kracht berekend door Dimensional Fund Advisors LP, een dochteronderneming van Dimensional Fund Advisors Ltd. en bestonden niet vóór de introductiedatum van de index. De resultaten die worden getoond tijdens de perioden voorafgaand aan de startdatum van de index, vertegenwoordigen niet het werkelijke rendement van de Index. Andere geselecteerde perioden kunnen andere resultaten vertonen, inclusief verliezen. Backtested indexprestaties zijn hypothetisch en worden alleen ter informatie verstrekt om historische prestaties aan te geven als de index over de relevante tijdsperioden was berekend. Backtested prestatieresultaten veronderstellen de herinvestering van dividenden en rendement.

De subgroep wordt gedefinieerd als bedrijven waarvan de relatieve prijs tot de onderste 25% van de Amerikaanse Large Cap Index behoort, na uitsluiting van nutsbedrijven, bedrijven zonder financiële gegevens en bedrijven met een negatieve relatieve prijs. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen. Bron: CRSP en Compustat. Januari 1975–heden: Dimensionale US Large Cap Value Index Samenstelling: Bestaat uit bedrijven met marktkapitalisaties boven de 1000 grootste ondernemingen van de in aanmerking komende markt waarvan de relatieve prijs in de onderste 30% van grote bedrijven ligt na uitsluiting van nutsbedrijven, bedrijven zonder financiële gegevens en bedrijven met een negatieve relatieve prijs. De Index legt de nadruk op aandelen met een hogere winstgevendheid, een lagere relatieve prijs en een lagere marktkapitalisatie. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen. Bron: CRSP en Compustat. De Dimensional US Large Cap Value Index is retrospectief berekend door Dimensional Fund Advisors en bestond niet vóór 1 maart 2007. De maandelijkse indexrendementen worden berekend als het eenvoudige gemiddelde van de maandelijkse rendementen van 12 sub-indices, waarvan ieder jaarlijks wordt geherbalanceerd. De index wordt niet beheerd en is niet onderworpen aan vergoedingen en onkosten die doorgaans worden geassocieerd met beheerde rekeningen of beleggingsfondsen. De berekeningsmethode voor de Dimensional US Large Cap Value Index is op 1 januari 2014 gewijzigd om winstgevendheid op te nemen als een factor bij het selecteren van aandelen voor opname in de index.

Dimensional US Small Cap Value Index: Juni 1927–december 1974: Dimensionale US Small Cap Value Index Samenstelling: Een subset van de US Small Cap Index. De subgroep wordt gedefinieerd als bedrijven waarvan de relatieve prijs tot de onderste 25% van de Amerikaanse Small Cap Index behoort, na uitsluiting van nutsbedrijven, bedrijven zonder financiële gegevens en bedrijven met een negatieve relatieve prijs. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen. Bron: CRSP en Compustat. Januari 1975–heden: Dimensionale US Small Cap Value Index Samenstelling: Een subset van de US Small Cap Index. De subgroep wordt gedefinieerd als bedrijven waarvan de relatieve prijs tot de onderste 35% van de Amerikaanse Small Cap Index behoort, na uitsluiting van nutsbedrijven, bedrijven zonder financiële gegevens en bedrijven met een negatieve relatieve prijs. De in aanmerking komende markt bestaat uit aandelen van Amerikaanse bedrijven die worden verhandeld op de NYSE, NYSE MKT (voorheen AMEX) en Nasdaq Global Market. Uitsluitingen: niet-Amerikaanse bedrijven, REIT's, UIT's en investeringsmaatschappijen en bedrijven met de laagste winstgevendheid binnen het universum van small Caps. De winstgevendheid wordt gemeten als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen en afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: CRSP en Compustat. De Dimensional US Small Cap Value Index is retrospectief berekend door Dimensional Fund Advisors en bestond niet vóór 1 maart 2007. De maandelijkse indexrendementen worden berekend als het eenvoudige gemiddelde van de maandelijkse rendementen van 12 sub-indices, waarvan ieder jaarlijks wordt geherbalanceerd. De Index wordt niet beheerd en is niet onderworpen aan vergoedingen en onkosten die doorgaans worden geassocieerd met beheerde rekeningen of beleggingsfondsen. De berekeningsmethode voor de Dimensional US Small Cap Value Index is op 1 januari 2014 gewijzigd om winstgevendheid op te nemen als een factor bij het selecteren van aandelen voor opname in de index.

Indexbeschrijvingen

Dimensional International Small Cap Index: Januari 1970–juni 1981: 50% Hoare Govett Small Companies Index (hgsmall.ind), 50% Nomura Small Companies Index (nomura.ind). Juli 1981–december 1989: Samengesteld door Dimensional. Omvat aandelen van MSCI EAFE-landen in de onderste 10% van de marktkapitalisatie, exclusief de onderste 1%. Alle aandelen zijn gewogen naar marktkapitalisatie. Elk land is geplafonneerd op 50%. Halfjaarlijks opnieuw gebalanceerd. Januari 1990–heden: Dimensional International Small Cap Index: naar marktkapitalisatie gewogen index van aandelen bestaande uit kleine bedrijven op de in aanmerking komende markten met uitzondering van die met de laagste winstgevendheid en de hoogste relatieve prijs binnen het small cap universum. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. De maandelijkse indexrendementen worden berekend als het eenvoudige gemiddelde van de maandelijkse rendementen van vier subindices, die elk eenmaal per jaar aan het einde van elk kwartaal van het jaar worden geherbalanceerd. Het maximale indexgewicht van een bedrijf is beperkt tot 5%. Momenteel opgenomen landen zijn Australië, Oostenrijk, België, Canada, Denemarken, Finland, Frankrijk, Duitsland, Hong Kong, Ierland, Israël, Italië, Japan, Nederland, Nieuw-Zeeland, Noorwegen, Portugal, Singapore, Spanje, Zweden, Zwitserland en Verenigde Koninkrijk. Uitsluitingen: REIT's en investeringsmaatschappijen Bron: Bloomberg. De Dimensional International Small Cap Index is met terugwerkende kracht berekend door Dimensional Fund Advisors en bestond niet vóór april 2008. De Index wordt niet beheerd en is niet onderhevig aan vergoedingen en onkosten die typisch zijn voor beheerde rekeningen of beleggingsfondsen. De berekeningsmethode voor de Dimensional International Small Cap Index is in januari 2014 gewijzigd om winstgevendheid op te nemen als een factor bij het selecteren van aandelen voor opname in de index.

Dimensional International Low Profitability Index: Januari 1990–heden: Dimensional International Low Profitability Index werd in januari 2013 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit niet in de VS ontwikkelde bedrijven. Het is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen in middels drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie van elk in aanmerking komend land. Evenzo worden aandelen opgedeeld in drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een lage winstgevendheid. De index wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: Bloomberg.

Dimensional International High Profitability Index: Januari 1990–heden: Dimensional International High Profitability Index werd in januari 2013 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit niet in de VS ontwikkelde bedrijven. Het is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen in over drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie van elk in aanmerking komend land. Evenzo worden aandelen verdeeld over drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een hoge winstgevendheid. De index wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: Bloomberg.

De Dimensional Indices zijn met terugwerkende kracht berekend door Dimensional Fund Advisors LP, een dochteronderneming van Dimensional Fund Advisors Ltd. en bestonden niet vóór de introductiedatum van de index. De resultaten die worden getoond tijdens de perioden voorafgaand aan de startdatum van de index, vertegenwoordigen niet het werkelijke rendement van de Index. Andere geselecteerde perioden kunnen andere resultaten vertonen, inclusief verliezen. Backtested indexprestaties zijn hypothetisch en worden alleen ter informatie verstrekt om historische prestaties aan te geven als de index over de relevante tijdsperioden was berekend. Backtested prestatieresultaten veronderstellen de herinvestering van dividenden en rendement.

Dimensional Emerging Markets Low Profitability Index: Juli 1995–heden: Dimensional Emerging Markets Low Profitability Index werd in april 2013 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit bedrijven uit opkomende markten en is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen in over drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie van elk in aanmerking komend land. Evenzo worden aandelen verdeeld over drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een lage winstgevendheid. De index wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: Bloomberg.

Dimensional Emerging Markets High Profitability Index: Juli 1995–heden: Dimensional Emerging Markets High Profitability Index werd in april 2013 gecreëerd door Dimensional en vertegenwoordigt een index die bestaat uit bedrijven uit opkomende markten en is samengesteld door Dimensional. Dimensional deelt aandelen over drie winstgevendheidsgroepen van hoog naar laag. Elke groep vertegenwoordigt een derde van de marktkapitalisatie van elk in aanmerking komend land. Evenzo worden aandelen gesorteerd in drie relatieve prijsgroepen. De kruisingen van de drie winstgevendheidsgroepen en de drie relatieve prijsgroepen leveren negen subgroepen op, gevormd op winstgevendheid en relatieve prijs. De index vertegenwoordigt het gemiddelde rendement van de drie subgroepen met een hoge winstgevendheid. De index wordt twee keer per jaar geherbalanceerd. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. Bron: Bloomberg.

Dimensional Emerging Markets Small Index: Januari 1989–december 1993: Fama/Franse Small Cap-index voor opkomende markten. Januari 1994–heden: Dimensional Emerging Markets Small Index: naar marktkapitalisatie gewogen index van aandelen van kleine bedrijven binnen de in aanmerking komende markten met uitzondering van die met de laagste winstgevendheid en hoogste relatieve prijs binnen het small cap universum. De winstgevendheid wordt gewaardeerd als bedrijfsresultaat vóór afschrijvingen minus rentelasten, geschaald per boek. De maandelijkse indexrendementen worden berekend als het eenvoudige gemiddelde van de maandelijkse rendementen van vier subindices, die elk eenmaal per jaar aan het einde van elk kwartaal van het jaar opnieuw worden samengesteld. Het maximale indexgewicht van een bedrijf is beperkt tot 5%. Momenteel opgenomen landen zijn Brazilië, Chili, China, Colombia, Tsjechië, Hongarije, India, Indonesië, Maleisië, Mexico, Peru, Filippijnen, Polen, Rusland, Zuid-Afrika, Zuid-Korea, Taiwan, Thailand en Turkije. Uitsluitingen: REIT's en investeringsmaatschappijen Bron: Bloomberg. De Dimensional Emerging Markets Small Index is retrospectief berekend door Dimensional Fund Advisors en bestond niet vóór april 2008. De Index wordt niet beheerd en is niet onderworpen aan vergoedingen en kosten die doorgaans worden geassocieerd met beheerde rekeningen of beleggingsfondsen. De berekeningsmethode voor de Dimensional Emerging Markets Small Index is in januari 2014 gewijzigd om winstgevendheid op te nemen als een factor bij het selecteren van aandelen voor opname in de index.

Indexbeschrijvingen

Fama/French US Value Research Index: Geleverd door Fama/Frans uit CRSP-aandelendata. Omvat de lagere 30% in price-to-book ratio van NYSE-aandelen (plus NYSE Amex-equivalenten sinds juli 1962 en Nasdaq-equivalenten sinds 1973).

Fama/French US Growth Research Index: Geleverd door Fama/Frans uit CRSP-aandelendata. Omvat de hogere 30% in price-to-book ratio van NYSE-aandelen (plus NYSE Amex-equivalenten sinds juli 1962 en Nasdaq-equivalenten sinds 1973).

Fama/French Total US Market Research Index: Juli 1926–heden: Fama/Franse totale Amerikaanse marktonderzoeksfactor + US Treasury Bills van één maand. Bron: Ken French-website.

Fama/French International Market Index: Januari 1975–heden: Fama/Franse International Market Index. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French International Value Index: Januari 1975–heden: Fama/Franse internationale waarde-index. Gesimuleerde strategie van internationale ontwikkelde landen met aandelen binnen het lagere price-to-book range van 30%. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French International Growth Index: : januari 1975–heden: Fama/Franse internationale groei-index. Gesimuleerde strategie van internationale ontwikkelde landen met aandelen binnen het hogere price-to-book range van 30%. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French Emerging Markets Index: Juli 1989–heden: Fama/Franse index voor opkomende markten. Met dank aan Fama/French van Bloomberg en IFC-aandelendata. Bedrijven gewogen op basis van float-gecorrigeerde marktkapitalisatie; jaarlijks geherbalanceerd in juni. Fama/Frans en multifactordata geleverd door Fama/Frans.

Fama/French Emerging Markets Value Index: Juli 1989–heden: Fama/Franse Emerging Markets Value Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg en IFC-aandelendata. Omvat aandelen in de bovenste 30% book-to-market-range in elk land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. Fama/Frans en multifactorgegevens geleverd door Fama/Frans.

Fama/French Emerging Markets Growth Index: Juli 1989–heden: Fama/Franse groei-index voor opkomende markten. Met dank aan Fama/French van Bloomberg en IFC-aandelendata. Omvat aandelen in de onderste 30% book-to-market range in elk land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. Fama/Frans en multifactordata geleverd door Fama/Frans.

Fama/French Europe and Scandinavia Market Index: Januari 1975–heden: Fama/Frans Europa en Scandinavië Marktindex gecombineerd op regionale marktweigingen. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French Europe and Scandinavia Growth Index: Januari 1975–heden: Fama/French Europe Growth Index en Fama/French Scandinavia Growth Index gecombineerd op regionale marktweigingen. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French Europe and Scandinavia Value Index: Januari 1975–heden: Fama/French Europe Value Index en Fama/French Scandinavia Value Index gecombineerd op regionale marktweigingen. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French Japan Value Index: Januari 1975–heden: Fama/Frans Japan Value Index. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data

Fama/French Japan Growth Index: Januari 1975–heden: Fama/Frans Japan Growth Index. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French UK Market Index: Januari 1975–heden: Fama/French UK Market Index. Bron: Ken Franse website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French UK Value Index: Januari 1975–heden: Fama/Franse UK Value Index. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

Fama/French UK Growth Index: Januari 1975–heden: Fama/Franse UK Growth Index. Bron: Ken French-website. Gesimuleerd op basis van MSCI- en Bloomberg-data.

De Dimensional Indices zijn met terugwerkende kracht berekend door Dimensional Fund Advisors LP, een dochteronderneming van Dimensional Fund Advisors Ltd. en bestonden niet vóór de introductiedatum van de index. De resultaten die worden getoond tijdens de perioden voorafgaand aan de startdatum van de index, vertegenwoordigen niet het werkelijke rendement van de Index. Andere geselecteerde perioden kunnen andere resultaten vertonen, inclusief verliezen. Backtested indexprestaties zijn hypothetisch en worden alleen ter informatie verstrekt om historische prestaties aan te geven als de index over de relevante tijdsperioden was berekend. Backtested prestatieresultaten veronderstellen de herinvestering van dividenden en rendement.

Eugene Fama en Ken French zijn lid van de Raad van Bestuur van de algemene partner en verlenen adviesdiensten aan een dochteronderneming van Dimensional UK en Dimensional Ireland.

Indexbeschrijvingen

Fama/French US High Profitability Index: Juli 1963–heden: Fama/French US High Profitability Index. Met dank aan Fama/French van CRSP- en Compustat-aandelendata. Omvat alle aandelen in de bovenste 30% operationele winstgevendheid van bedrijven die in aanmerking komen voor de NYSE; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/Frans.

Fama/French US Low Profitability Index: Juli 1963–heden: Fama/French US Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van CRSP- en Compustat-aandelendata. Omvat alle aandelen in de lagere operationele winstgevendheid range van 30% van bedrijven die in aanmerking komen voor NYSE; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French International High Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French International High Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen in de bovenste 30% operationele winstgevendheid range in elke regio; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French International Low Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French International Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen binnen de lagere 30% operationele winstgevendheid range in elke regio; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French UK High Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French UK Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen in de lagere operationele winstgevendheid range van 30% in het land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French UK Low Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French UK Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen in de lagere operationele winstgevendheid range van 30% in het land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/Frans.

Fama/French Europe High Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French Europe High Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen in de bovenste 30% operationele winstgevendheid range in elke regio; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French Europe Low Profitability Index: Juli 1990–heden: Fama/French Europe Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg-aandelendata. Omvat aandelen in het lagere bedrijfsrendement-range van 30% in elke regio; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French Emerging Markets High Profitability Index: Juli 1991–heden: Fama/French Emerging Markets High Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg en IFC-aandelendata. Omvat aandelen in de bovenste 30% operationele winstgevendheid range in elk land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

Fama/French Emerging Markets Low Profitability Index: Juli 1991–heden: Fama/French Emerging Markets Low Profitability Index. Met dank aan Fama/French van Bloomberg en IFC-aandelendata. Omvat aandelen in de lagere operationele winstgevendheid range van 30% in elk land; bedrijven gewogen op basis van float-adjusted market cap; jaarlijks geherbalanceerd in juni. OP voor juni van jaar t is de jaarlijkse omzet minus de kosten van verkochte goederen, rentekosten en verkoop-, algemene en administratieve kosten gedeeld door het eigen vermogen voor het laatste fiscale jaar in t-1. Fama/French en multifactordata geleverd door Fama/French.

De Dimensional Indices zijn met terugwerkende kracht berekend door Dimensional Fund Advisors LP, een dochteronderneming van Dimensional Fund Advisors Ltd. en bestonden niet vóór de introductiedatum van de index. De resultaten die worden getoond tijdens de perioden voorafgaand aan de startdatum van de index, vertegenwoordigen niet het werkelijke rendement van de Index. Andere geselecteerde perioden kunnen andere resultaten vertonen, inclusief verliezen. Backtested indexprestaties zijn hypothetisch en worden alleen ter informatie verstrekt om historische prestaties aan te geven als de index over de relevante tijdsperioden was berekend. Backtested prestatieresultaten veronderstellen de herinvestering van dividenden en rendement.

Eugene Fama en Ken French zijn lid van de Raad van Bestuur van de algemene partner en verlenen adviesdiensten aan een dochteronderneming van Dimensional UK en Dimensional Ireland.

Vijf-jaars prestaties van financiële indices

Per 31 december, 2024

	Valuta	JAARLIJKSE RENDEMENTEN (%)				
		1 Jaar	2 Jaar	3 Jaar	4 Jaar	5 Jaar
Bloomberg France Government EMU HICP Linked Bond Index	EUR	-3,27	0,94	-3,46	-1,29	-0,45
Bloomberg Global Aggregate Bond Index (hedged to USD)	USD	3,40	5,25	-0,55	-0,76	0,48
Bloomberg Sterling Aggregate Bond Index (hedged to GBP)	GBP	-2,46	1,18	-7,68	-6,94	-4,07
Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	1,25	3,37	-2,41	-2,19	-0,33
Bloomberg U.S. Aggregate Intermediate Bond Index	USD	2,47	3,82	-0,83	-0,95	0,33
Bloomberg U.S. Credit Bond Index	USD	2,03	5,06	-2,20	-1,92	0,23
Bloomberg U.S. Government Bond Index	USD	0,62	2,34	-2,80	-2,67	-0,63
Bloomberg U.S. Government Bond Index 1-3 Years	USD	4,04	4,18	1,44	0,93	1,37
Bloomberg U.S. Government Bond Index Intermediate	USD	2,44	3,37	-0,47	-0,78	0,49
Bloomberg U.S. Government/Credit Bond Index 1-5 Years	USD	3,76	4,32	0,94	0,46	1,29
Bloomberg U.S. Government/Credit Bond Index Intermediate	USD	3,00	4,12	-0,18	-0,49	0,86
Bloomberg UK Government Inflation Linked Bond Index	GBP	-8,59	-4,10	-15,53	-11,02	-6,95
Euro Short Term Rate (EUR)	EUR	3,76	3,46	2,26	1,55	1,13
FTSE Non-USD World Government Bond Index (hedged to USD)	USD	3,61	5,79	-0,92	-1,28	-0,12
FTSE World Government Bond Index	USD	-2,87	1,08	-5,83	-6,12	-3,08
FTSE World Government Bond Index (hedged to USD)	USD	2,38	4,38	-1,72	-1,86	-0,32
FTSE World Government Bond Index 1-3 Years	USD	0,61	2,50	-0,73	-1,53	-0,18
FTSE World Government Bond Index 1-3 Years (hedged to USD)	USD	4,69	4,78	2,19	1,54	1,70
FTSE World Government Bond Index 1-3 Years (hedged to GBP)	GBP	4,44	4,36	1,70	1,13	1,28
FTSE World Government Bond Index 1-5 Years (hedged to GBP)	GBP	4,03	4,32	1,06	0,55	0,98
MSCI All Country World IMI Index (net div.)	USD	16,37	18,95	4,90	8,09	9,67
MSCI All Country World Index (gross div.)	USD	18,02	20,39	5,94	9,07	10,58
MSCI All Country World Index (net div.)	USD	17,49	19,82	5,44	8,57	10,06
MSCI Emerging Markets IMI Index (net div.)	GBP	9,01	7,17	1,21	1,07	3,67
MSCI Emerging Markets Index (gross div.)	USD	8,05	9,15	-1,48	-1,67	2,10
MSCI Europe Index (gross div., EUR)	EUR	9,27	12,86	5,08	9,92	7,25
MSCI Japan Index (gross div.)	USD	8,68	14,57	3,18	2,89	5,19
MSCI United Kingdom Index (gross div.)	USD	7,55	10,78	5,31	8,47	4,40
MSCI World ex UK Index IMI (net div.)	GBP	20,05	18,17	8,58	11,86	12,24
MSCI World ex USA Index (gross div.)	USD	5,26	11,73	2,46	5,04	5,64
MSCI World IMI Index (net div.)	USD	17,52	20,17	5,70	9,34	10,62
MSCI World Index (gross div.)	USD	19,19	21,78	6,85	10,53	11,70
One-Month US Treasury Bills	USD	5,37	5,16	3,90	2,92	2,42
S&P 500 Index	USD	25,02	25,65	8,94	13,58	14,53
UK One-Month Treasury Bills	GBP	5,16	4,92	3,69	2,76	2,24

In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. De waarde van het beleggingsrendement en het ingelegde kapitaal kunnen zowel dalen als stijgen.

Indices zijn niet beschikbaar voor een directe beleggingen. Hun resultaat geeft niet de kosten weer die zijn verbonden aan het beheer van de daadwerkelijke portefeuille. Bloomberg gegevens verstrekt door Bloomberg. FTSE fixed income indices © 2025 FTSE Fixed Income LLC. Alle rechten voorbehouden. Euro Short Term Rate: ICE BofA index data © 2025 ICE Data Indices, LLC. MSCI data © MSCI 2025, alle rechten voorbehouden. S&P-gegevens © 2025 S&P Dow Jones Indices LLC, een onderdeel van S&P Global. Alle rechten voorbehouden. UK One-Month Treasury Bills verstrekt door Financial Times. US One-Month T-Bills © 2025 en eerder, Morningstar. Alle rechten voorbehouden.