



Persbericht
8 september 2021

APG en Qontigo lanceren baanbrekende serie STOXX-indices voor verantwoord beleggen

BlackRock uitvoerder van een eerste indexmandaat voor ontwikkelde aandelenmarkten

Amsterdam/Zug – APG Asset Management heeft, in samenwerking met index- en risicomanagementsysteem provider Qontigo en vermogensbeheerder BlackRock, de lancering bekendgemaakt van de iSTOXX APG World Responsible Investment Indices (iSTOXX APG RI Index Family). Een van de indices uit de serie van vijf, de iSTOXX APG World Responsible Low-Carbon SDI Index, wordt gebruikt voor een mandaat voor Sustainable Development Investments (SDI's, beleggingen die bijdragen aan de Sustainable Development Goals, de duurzame ontwikkelingsdoelen van de Verenigde Naties). APG heeft als beheerder BlackRock geselecteerd voor de uitvoering van het mandaat met een initiële belegging van ongeveer 1 miljard euro.

De serie indices is gebouwd met behulp van datasets van APG, waaronder een dataset afkomstig van het SDI Asset Owner Platform (SDI AOP). Dit in 2019 opgerichte platform – dat institutionele beleggers van over de hele wereld vertegenwoordigt, die samen meer dan 1 biljoen euro onder beheer hebben – moet helpen bij het versnellen van beleggingen die bijdragen aan de Sustainable Development Goals (SDG's) van de VN. Het platform voorziet vermogensbeheerders van gemeenschappelijke definities, taxonomie en data van hoge kwaliteit. Het is de eerste keer dat de data van het SDI AOP worden gebruikt voor het bouwen van beleggingsindices.

De ontwikkeling van de iSTOXX APG RI Index Family sluit aan bij de ambitie van APG en zijn pensioenfondsklanten om steeds meer kapitaal te sturen richting oplossingen die bijdragen aan de SDG's. Dit is ook aantrekkelijk voor de pensioenfondsklanten van APG, die duidelijke doelen hebben gesteld voor de mate waarin hun beleggingen aan de SDG's moeten bijdragen.

APG heeft de ambitie aantoonbaar koploper te zijn op het gebied van verantwoord beleggen. De betrokkenheid van de klanten van APG, waaronder het grootste Nederlandse pensioenfonds ABP, bij het thema duurzaam en verantwoord beleggen (DVB) is een belangrijke katalysator voor de realisatie van de ESG-standaarden die de basis vormen voor de nieuwe indices. De nauwe samenwerking met zijn pensioenfondsklanten heeft geleid tot een breed en ambitieus ESG-beleid binnen de indices, dat de lat bovendien steeds hoger legt. Over tijd stijgt hierdoor bijvoorbeeld de bijdrage van de portefeuille aan het klimaatakkoord van Parijs.

Ronald van Dijk – Managing Director bij APG: *“Pensioenfondsen stellen zich de vraag of indexbeleggen ook voor hen een goede oplossing is om verantwoord te beleggen. Toonaangevende, duurzame*

vermogensbeheerders kunnen een waardevolle bijdrage leveren aan deze groeiende vraag naar duurzame indexproducten op maat. Doelstellingen op het terrein van bijdragen aan de SDG's zijn een goed voorbeeld van gewenst maatwerk. Daartoe aangemoedigd door de snelgroeiende ambities van onze pensioenfondsklanten, houdt APG de ESG standaarden actueel. Dit onder andere door het bijdragen aan een wereldwijde standaard voor het beleggen in SDG's. De resultaten zien we terug in deze nieuwe indices."

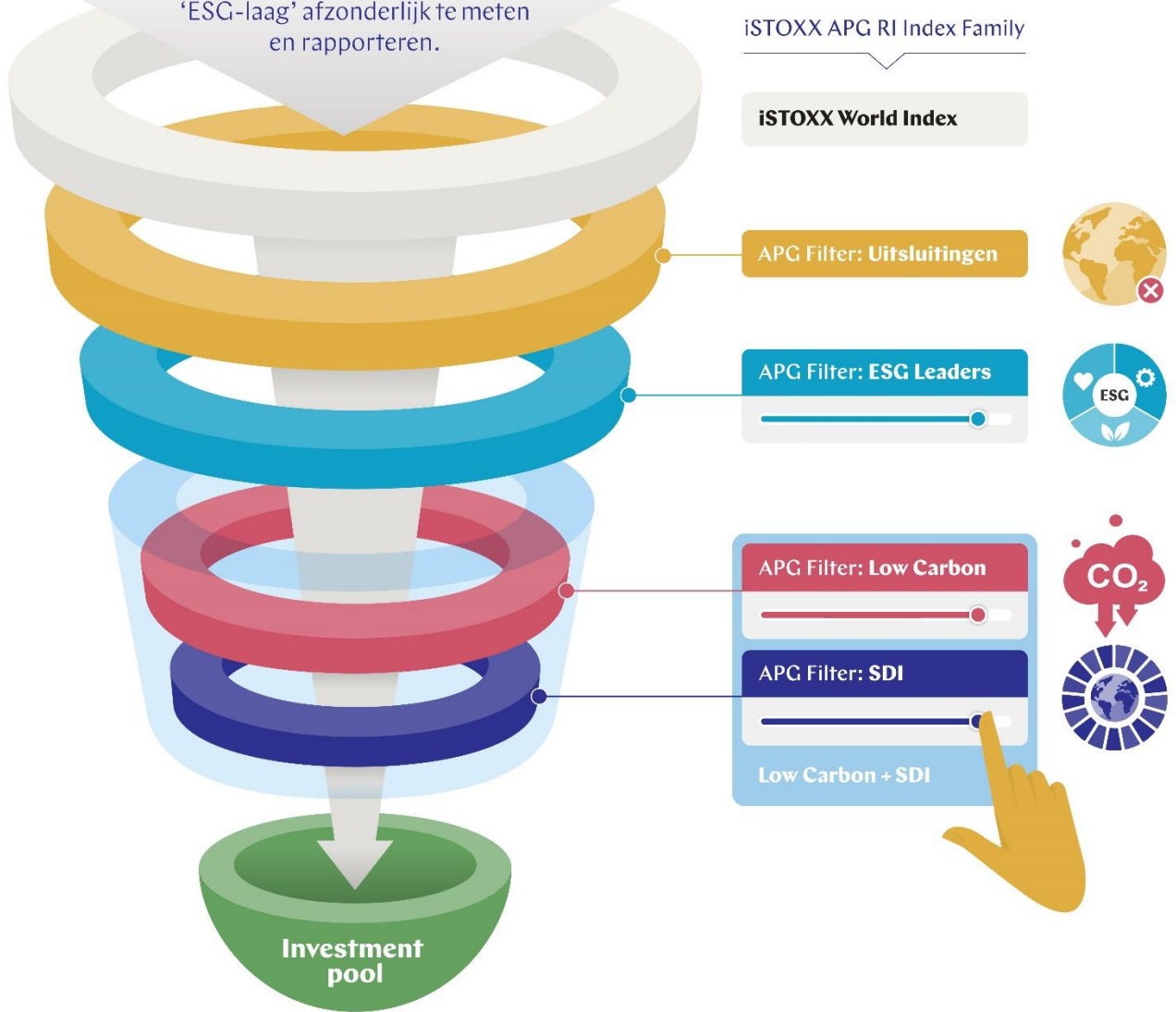
Uitgaande van de iSTOXX World-A Index – een wereldwijde index voor aandelen in ontwikkelde markten – voegen de diverse indices in de index family steeds specifieke ESG-criteria (uitsluitingen, ESG-leiders, CO₂ en SDI) toe, waardoor APG voor elk van de afzonderlijke criteria het effect op het rendement en het risicoprofiel (aan de hand van tracking error) kan meten en hierover kan rapporteren.

De vijf op maat gemaakte indices die worden gelanceerd zijn:


- iSTOXX APG World-X Index
- iSTOXX APG World Responsible Index
- iSTOXX APG World Responsible Low-Carbon Index
- iSTOXX APG World Responsible SDI Index
- iSTOXX APG World Responsible Low-Carbon SDI Index

APG Responsible Investing Index Strategy

Een innovatieve, 'gelaagde' benadering die pensioenfondsklanten in staat stelt om te investeren in aandelen voor ontwikkelde markten en het effect op risico en rendement voor van elke 'ESG-laag' afzonderlijk te meten en rapporteren.



Kostenefficiënt



Transparant



Progressive Pathway



Vooruitstrevend
Risico Management



Stem op AVA

Een samenwerking tussen APG, Qontigo en BlackRock

Qontigo gebruikt haar serie Axioma-portefeuilleoplossingen voor het bouwen van de STOXX-indices. Een belangrijk kenmerk van Index Family is de minimalisatie van de tracking error van iedere maatwerkindex versus een brede marktindex (via een optimalisatieproces). Dit om onbedoelde exposure ten gevolge van het maatwerk, zoals sector-, regionale en factor-biases, te beperken. Kern van de doelstelling van de SDI and Carbon Reduction Pathway in de index constructie, is het concept om de SDI-voetafdruk te vergroten en CO₂-voetafdruk van de beleggingen te verkleinen tussen nu en 2025.

“Wanneer je je richt op de realisatie van de verschillende, meetbare, duurzame beleggingsdoelstellingen - bijv. via pathways-, wordt indexportefeuilleconstructie steeds belangrijker,” aldus Hamish Seegopaul, Managing Director R&D ESG en Quantitative Indices bij Qontigo. “Het partnerschap met APG op het gebied van data en indexontwerp is een prachtig voorbeeld van de wijze waarop we met onze klanten samenwerken om te komen tot duurzame en schaalbare indexbeleggingsoplossingen, door te kiezen voor innovatieve benaderingen. We vinden het geweldig om samen met APG de eerste beleggingsindices te realiseren met behulp van data die aan de SDI AOP-dataset zijn ontleend.”

De indices worden in eerste instantie gebruikt voor een collectief mandaat met doelstellingen op het terrein van CO₂ en SDI beleggingen. APG beheert een fonds voor gemene rekening (FGR) dat is gebaseerd op de iSTOXX APG World Responsible Low-Carbon SDI Index, waarbij BlackRock is geselecteerd voor de uitvoering. APG verzorgt het stembeleid. In aanvulling op deze collectieve oplossing, hebben pensioenfondsklanten ook de mogelijkheid om te kiezen voor een index op maat, waarin de DVB-doelstellingen van de eigen organisatie zijn verwerkt.

Monique Donders, Country Head Netherlands bij BlackRock: *“We werken graag samen met APG en Qontigo bij het ontwikkelen en beheren van deze kostenefficiënte en transparante STOXX-indexoplossing op maat. APG is wereldwijd koploper onder vermogensbeheerders die zoeken naar mogelijkheden om hun beleggingen in te zetten voor de Sustainable Development Goals van de VN. Het beheer van een dergelijk duurzaam mandaat vraagt om goede coördinatie, gedetailleerd risicobeheer en schaalgrootte. We zijn ervan overtuigd dat deze flexibele, datagestuurde benadering een grote kans maakt om de norm te worden naarmate de beleggingssector zijn ambities op het gebied van verantwoord beleggen steeds meer omzet in concrete acties.”*

Meer informatie

Lot Folgering – woordvoerder APG
+31 6 10 82 12 78 of lot.folgering@apg.nl

Andreas von Brevern – woordvoerder Qontigo
+49 69 2 11 14284 of andreas.von.brevern@deutsche-boerse.com

Julian van de Wetering – woordvoerder BlackRock
+ 31 6 15 37 76 90 of julian.vandewetering@blackrock.com

Noot voor de redactie: foto's van de geciteerde bedrijfswoordvoerders zijn op verzoek beschikbaar.

Over APG

Als grootste pensioenuitvoerder van Nederland verzorgt APG het pensioen voor 4,7 miljoen deelnemers. APG verzorgt bestuursadvies, vermogensbeheer, pensioenadministratie, pensioencommunicatie en werkgeversdiensten. We werken voor pensioenfondsen en werkgevers in de sectoren onderwijs, overheid, bouw, schoonmaak, woningcorporaties, sociale werkvoorziening, medisch specialisten en architectenbureaus. APG beheert 613 miljard euro (juli 2021) pensioenvermogen. Met ongeveer 3.000 medewerkers werken wij vanuit Heerlen, Amsterdam, Brussel, New York, Hongkong, Shanghai en Beijing.

www.apg.nl

Over Qontigo

Qontigo is een toonaangevende wereldwijde leverancier van innovatieve index-, analyse- en risicomanagementoplossingen die de impact van beleggingen optimaliseren. Terwijl de verschuiving naar duurzaam beleggen op gang komt, stelt Qontigo haar klanten - uitgevers van financiële producten, vermogensbezitters en vermogensbeheerders - in staat om geavanceerde en doelgerichte oplossingen op grote schaal te leveren om te voldoen aan de steeds veeleisender wordende duurzaamheidsdoelstellingen van beleggers en vermogensbeheerders over de hele wereld.

De oplossingen van Qontigo worden ondersteund door zowel onze collaboratieve, klantgerichte cultuur, die ons in staat stelt om op maat gemaakte oplossingen voor onze klanten te creëren, als onze open architectuur en moderne technologie die efficiënt worden geïntegreerd in de processen van onze klanten.

www.qontigo.com

Over BlackRock

BlackRock stelt zich ten doel om een groeiend aantal mensen te helpen hun financiële toekomst goed te regelen. Als belangenbehartiger van onze klanten en toonaangevend leverancier van financiële technologie helpen wij miljoenen mensen om vermogen op te bouwen voor elke fase van hun leven, door beleggen gemakkelijker en betaalbaarder te maken.

www.blackrock.nl

Over SDI AOP

APG, AustralianSuper, British Columbia Investment Management Corporation en PGGM hebben samen het Sustainable Development Investments Asset Owner Platform (SDI AOP) opgericht. Met behulp van de kunstmatige en menselijke intelligentie, hebben wij een methodologie ontwikkeld dat beleggers in staat stelt om bedrijven te beoordelen op hun bijdrage aan de Duurzame Ontwikkelingsdoelen (Sustainable Development Goals, SDG's) van de Verenigde Naties.

De methodologie en de onderliggende data worden via Qontigo gedistribueerd en kunnen in elk beleggingsproces worden geïntegreerd. Een gemeenschappelijk begrip van wat duurzame ontwikkelingsinvesteringen (SDI's) zijn, kan de samenwerking met ondernemingen, regelgevende

instanties en andere belanghebbenden aanzienlijk verbeteren. Zowel bedrijven als beleggers kunnen de standaard gebruiken om transparant en consistent aan klanten en andere stakeholders te rapporteren over de SDG's

www.sdi-aop.org

Legal disclaimer

Disclaimers

This press release does not constitute an offer or an invitation to subscribe to (i) units in a collective investment undertaking or (ii) an investment service and is not issued to test the interest in a collective investment undertaking or an investment service.

STOXX Ltd., Qontigo GmbH, Qontigo Index GmbH, Deutsche Boerse Group and their licensors, research partners or data providers do not make any warranties or representations, express or implied, with respect to the timeliness, sequence, accuracy, completeness, currentness, merchantability, quality or fitness for any particular purpose of its index data and exclude any liability in connection therewith. STOXX, Qontigo GmbH, Qontigo Index GmbH, Deutsche Boerse Group and their licensors, research partners or data providers are not providing investment advice through the publication of indices or in connection therewith. In particular, the inclusion of a company in an index, its weighting, or the exclusion of a company from an index, does not in any way reflect an opinion of STOXX, Qontigo GmbH, Qontigo Index GmbH, Deutsche Boerse Group or their licensors, research partners or data providers on the merits of that company. Financial instruments based on the STOXX® indices, DAX® indices or on any other indices supported by STOXX are in no way sponsored, endorsed, sold or promoted by STOXX, Qontigo GmbH, Qontigo Index GmbH, Deutsche Boerse Group or their licensors, research partners or data providers.

Capital at risk. The value of investments and the income from them can fall as well as rise and are not guaranteed. Investors may not get back the amount originally invested.

Past performance is not a reliable indicator of current or future results and should not be the sole factor of consideration when selecting a product or strategy.

Changes in the rates of exchange between currencies may cause the value of investments to diminish or increase. Fluctuation may be particularly marked in the case of a higher volatility fund and the value of an investment may fall suddenly and substantially. Levels and basis of taxation may change from time to time.

This material is for distribution to Professional Clients (as defined by the Financial Conduct Authority or MiFID Rules) only and should not be relied upon by any other persons.

UK and non-EEA countries

Issued by BlackRock Investment Management (UK) Limited, authorised and regulated by the Financial Conduct Authority. Registered office: 12 Throgmorton Avenue, London, EC2N 2DL. Tel: + 44 (0)20 7743 3000. Registered in England and Wales No. 02020394. For your protection telephone calls are usually recorded. Please refer to the Financial Conduct Authority website for a list of authorised activities conducted by BlackRock.

EEA

Issued by BlackRock (Netherlands) B.V. is authorised and regulated by the Netherlands Authority for the Financial Markets. Registered office Amstelplein 1, 1096 HA, Amsterdam, Tel: 31-20-549-5200. Trade Register No. 17068311 For your protection telephone calls are usually recorded.

Any research in this document has been procured and may have been acted on by BlackRock for its own purpose. The results of such research are being made available only incidentally. The views expressed do not constitute investment or any other advice and are subject to change. They do not necessarily reflect the views of any company in the BlackRock Group or any part thereof and no assurances are made as to their accuracy.

This document is for information purposes only and does not constitute an offer or invitation to anyone to invest in any BlackRock funds and has not been prepared in connection with any such offer.

© 2021 BlackRock, Inc. All Rights reserved. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS, iSHARES, BUILD ON BLACKROCK and SO WHAT DO I DO WITH MY MONEY are trademarks of BlackRock, Inc. or its subsidiaries in the United States and elsewhere. All other trademarks are those of their respective owners.