

31 december 2024

Fondsomschrijving

Het fonds belegt in Asset Backed Securities (ABS), genoteerd in euro en Britse pond met minimaal een credit rating van BBB-/Baa3. De ABS hebben onder andere consumentenhypotheke (RMBS), autoleningen, creditcardleningen, consumentleningen, studentenleningen, leningen voor commercieel vastgoed (CMBS), en bedrijfsleningen (CLO's) als onderpand.

Benchmark

Bloomberg Euro Floating ABS Bond Index

ISIN

NL0015000BY7

Unitwaarde

€ 110,93

Net Asset Value

€ 69.733.439

Oprichtingsdatum

5 juli 2021

Bruto leverage Commitment

121,00% 100,11%

SFDR classificatie

Artikel 8

Verantwoord beleggen

Het fonds heeft een maatschappelijk verantwoord beleggingsbeleid. Voor meer informatie ga naar de website.

Beschrijving

Rendement

	Laatste mnd	Laatste 3 mnd	Dit jaar	Laatste 12 mnd	Laatste 36 mnd	Sinds oprichting
Fondsrendement	0,37%	1,20%	6,39%	6,39%	3,48%	3,01%
Benchmark rendement	0,32%	0,94%	4,46%	4,46%	2,71%	2,31%
Relatief rendement	0,05%	0,26%	1,85%	1,85%	0,75%	0,68%
Tracking Error ex-post				0,49%	1,05%	0,99%
Informatie ratio				3,79	0,71	0,68

Niet alle kosten zijn ten laste van de getoonde rendementen gebracht. Welke kosten wel en niet ten laste van bovenstaande rendementen zijn gebracht staat vermeld bij het onderwerp 'Kosten'. Historische cijfers die betrekking hebben op een periode langer dan een jaar zijn geannualiseerd.

Doelstelling van dit fonds

Het behalen van een geannualiseerd relatief rendement van 0,5% boven de gekozen benchmark over een gehele marktcyclus.

Valutarisico

Het valutarisico van de beleggingen wordt volledig afgedekt naar de euro.

Dividend

Het fonds keert geen dividend uit.

Fiscale status

Er is sprake van fiscale transparantie, dat wil zeggen dat het fonds niet is onderworpen aan vennootschapsbelasting en dat de resultaten op beleggingen rechtstreeks worden toegerekend aan de participanten zelf.

Toe- en uittreding

Dagelijks kan, rekening houdend met een aankondigingsperiode, worden toe- en uitgetreden tegen de unitwaarde van dit fonds.

Kosten

	Basispunten
Kosten voor toetreding (basispunten)	20,00
Kosten voor uittreding (basispunten)	20,00
Service fee	2,50

De beheerder kan de werkelijke kosten in rekening brengen. De toe- en uittredingskosten komen ten goede aan het fonds. De beheerder past volledige swing pricing (full ADL) toe, wat impliceert dat de NAV van een fonds wordt aangepast met de swing factor bij netto instroom of uitstroom.

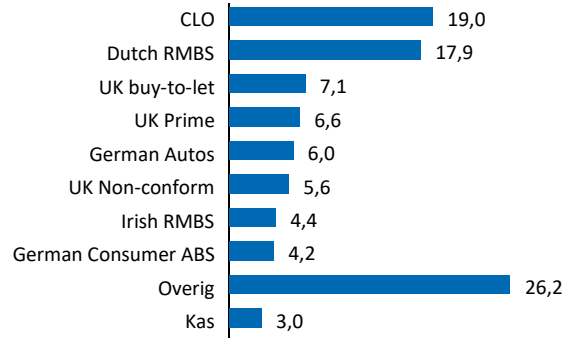
Kosten ten laste van het rendement van het fonds:

- Beheervergoeding Aegon Investment Management B.V. en geselecteerde vermogensbeheerders
- Service fee Aegon Investment Management B.V.
- Andere algemene kosten die niet in de servicevergoeding zijn inbegrepen, worden aan het fonds in rekening gebracht en omvatten, maar zijn niet beperkt tot: makelaars- en bewaarkosten, vergoedingen voor proxy voting en transactiekosten.

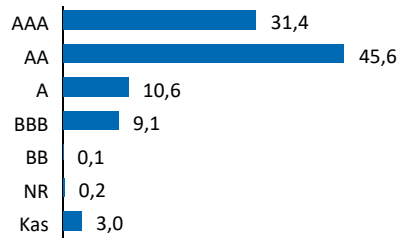
Historische kostenratio's (%)

	2023	2022
Lopende kosten factor (LKF) **	0,40	0,39
Prestatieafhankelijke vergoeding	0,00	0,00

Sectorverdeling (%)



Ratingverdeling (%)



Top 10 (%)

VERES 2023-1 A	1,2
KIMI 12 B	1,1
EDML 2024-1 B	1,1
SUNRI 2024-1 A1	1,0
LDN 2 B	1,0
DILSK 6-ST5 B	1,0
STORM 2023-GRN A	0,9
NORIA 2024-DE1 B	0,9
REVOC 2023-2 B	0,8
SUNRI 2024-2 A1	0,8

Contacts



www.aegonam.com



info@aegonam.com

** De LKF geeft de verhouding weer tussen de doorlopende kosten (die ten laste van het fonds gaan) en de op dagbasis berekende gemiddelde intrinsieke waarde van het fonds. Als een prestatieafhankelijke vergoeding van toepassing is wordt deze hierin niet meegenomen, maar wordt deze apart weergegeven.

Deze informatie is met zorg samengesteld namens Aegon Investment Management B.V. Er is naar gestreefd de informatie zo juist en volledig mogelijk weer te geven. Onvolkomenheden als gevolg van menselijke vergissingen of informatiesystemen kunnen echter voorkomen, waardoor gegevens en calculaties kunnen afwijken. Optellingen in deze rapportage kunnen (optische) afrondingsverschillen betreffen tot één positie na of voor de decimaalnotatie.

Aan de verstrekte informatie en berekende waardes kunnen geen rechten worden ontleend.

De waarde van het financiële instrument is afhankelijk van de ontwikkelingen op financiële markten of (indien van toepassing) andere markten. Alleen professionele beleggers in de zin van de Wet op het financieel toezicht kunnen participeren in het fonds. Aegon Investment Management B.V. beschikt over een vergunning als beheerder van beleggingsinstellingen als bedoeld in de Wet op het financieel toezicht en is als zodanig geregistreerd bij de Autoriteit Financiële Markten. Op basis van haar vergunning is Aegon Investment Management B.V. geautoriseerd om individueel vermogensbeheer en beleggingsadvies te verlenen in de zin van de Wet op het financieel toezicht. Meer informatie is te vinden in het prospectus, welke beschikbaar is op www.aegonam.com.