Achmea IM 30 Year Overlay Fund

Factsheet per 30-09-2026

FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Netherlands
Oprichtingsdatum	20-9-2017
Beleggingscategorie	LDI Overlay
Dividend uitkerend	Nee
Basisvaluta	Euro
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNY Mellon
SFDR-classificatie	Artikel 6
Lopende kosten factor	0,205%
Benchmark	n.v.t.

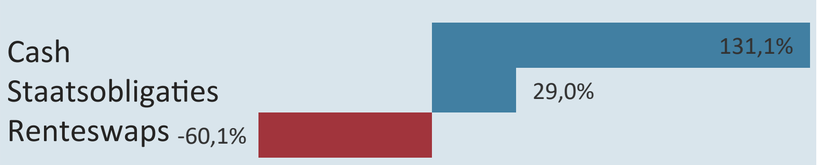
KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 528.252.897
Aantal uitstaande participaties	6.715.802
Intrinsieke waarde	€ 78,66

VERHANDELBAARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL0015436270
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	15:00 CET

ASSET ALLOCATIE*

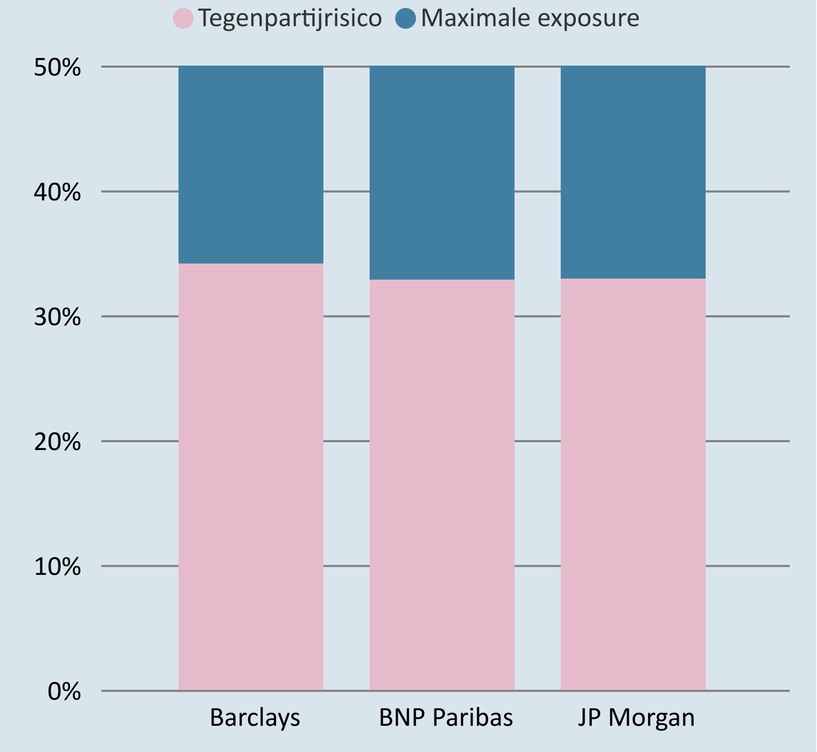


Gegevens per *30-9-2026*

**Deze data wordt per kwartaal geactualiseerd*

TEGENPARTIJRISICO

Het Fonds sluit geclearde renteswaps af via verschillende DCM's om het concentratierisico te reduceren. Bij het afsluiten van nieuwe geclearde swaps wordt er nauw gelet op de huidige verdeling van het renterisico over de verschillende tegenpartijen. De verdeling van dit tegenpartijrisico over de verschillende tegenpartijen is weergegeven in onderstaande figuur.



FONDSMANAGER

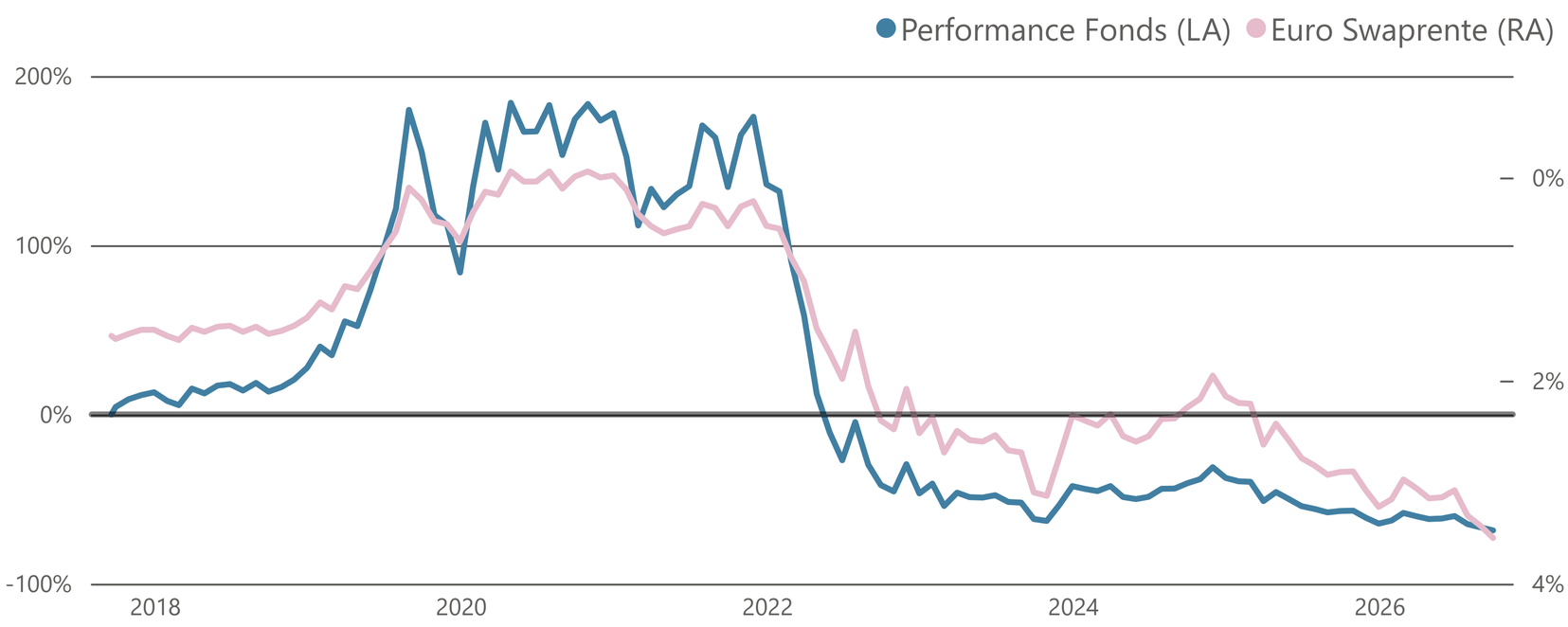
Alla van Aalst

FONDSPROFIEL

Het Fonds is opgericht om institutionele partijen te helpen met het afdekken van het renterisico. Het Fonds heeft als doel om rentegevoeligheid naar het 30-jaarspunt op de renteswapcurve te creëren. De rentegevoeligheid omvat de waardeverandering bij een renteverandering van 1bp (0,01%). Het Fonds belegt in renteswaps, staatsobligaties en liquide middelen om dit doel te verwezenlijken. Hiermee is het Fonds bij uitstek geschikt als LDI product voor pensioenfondsen (of -kringen) om het renterisico van pensioenverplichtingen af te dekken. Het Fonds voldoet aan de Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR). Dit Fonds dient een ander doel dan sturing op maatschappelijk verantwoorde beleggingsdoelstellingen. Voor dit Fonds acht de Beheerder het integreren van duurzaamheidsrisico's in het beleggingsproces dan ook niet relevant.

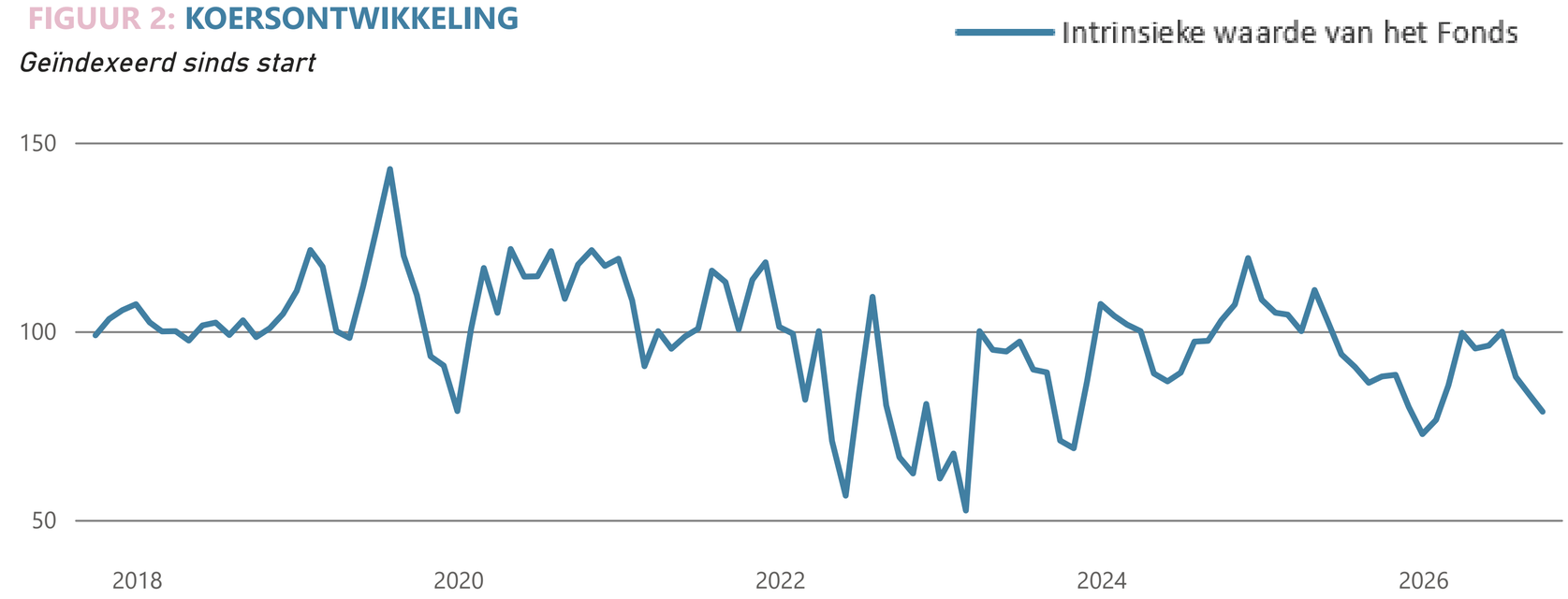
FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE VERSUS SWAPRENTE

Geïndexeerd sinds start



FIGUUR 2: KOERSONTWIKKELING

Geïndexeerd sinds start



Type	1 maand	QTD	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	-5,41%	-21,21%	-26,70%	-6,23%	-33,08%	-13,71%

Type	2021	2022	2023	2024	2025	2026
Fonds	-30,07%	-77,40%	8,09%	8,37%	-43,20%	-11,29%

Meerjarige gegevens zijn geannualiseerd
Fondsrendementen zijn na aftrek van de lopende kosten factor

VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

Renteniveaus van Europese renteswaps zijn in september opnieuw hard gestegen door zowel het aanhoudende conflict in het Midden-Oosten als de verwachting van centrale banken die een cyclus van rente verhogingen zijn gestart. Renteniveaus stegen met 30 tot 40 basispunten voor looptijden korter dan 10 jaar, en met ongeveer 10 basispunten voor looptijden van 30 jaar.

De swapcurve is daarmee sterk vervlakt. De spread tussen 10- en 30-jaar swaps daalde met meer dan 20 basispunten. Ultra lange swaps presteerden relatief beter. De vervlakking tussen 30- en 50-jaar swaps was ongeveer 8 basispunten.

Swapspreads (het verschil tussen swaprentes en Duitse staatsobligatie rentes) met kortere looptijden stegen gedurende de maand voor het eerst in een lange tijd, meer dan 5 basispunten. 30 jaar swapspreads kwamen juist iets in.

Ga voor meer informatie over onze beleggingsfondsen naar:achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen

achmea Investment Management

Achmea IM 30 Year Overlay Fund

Factsheet per 30-09-2026

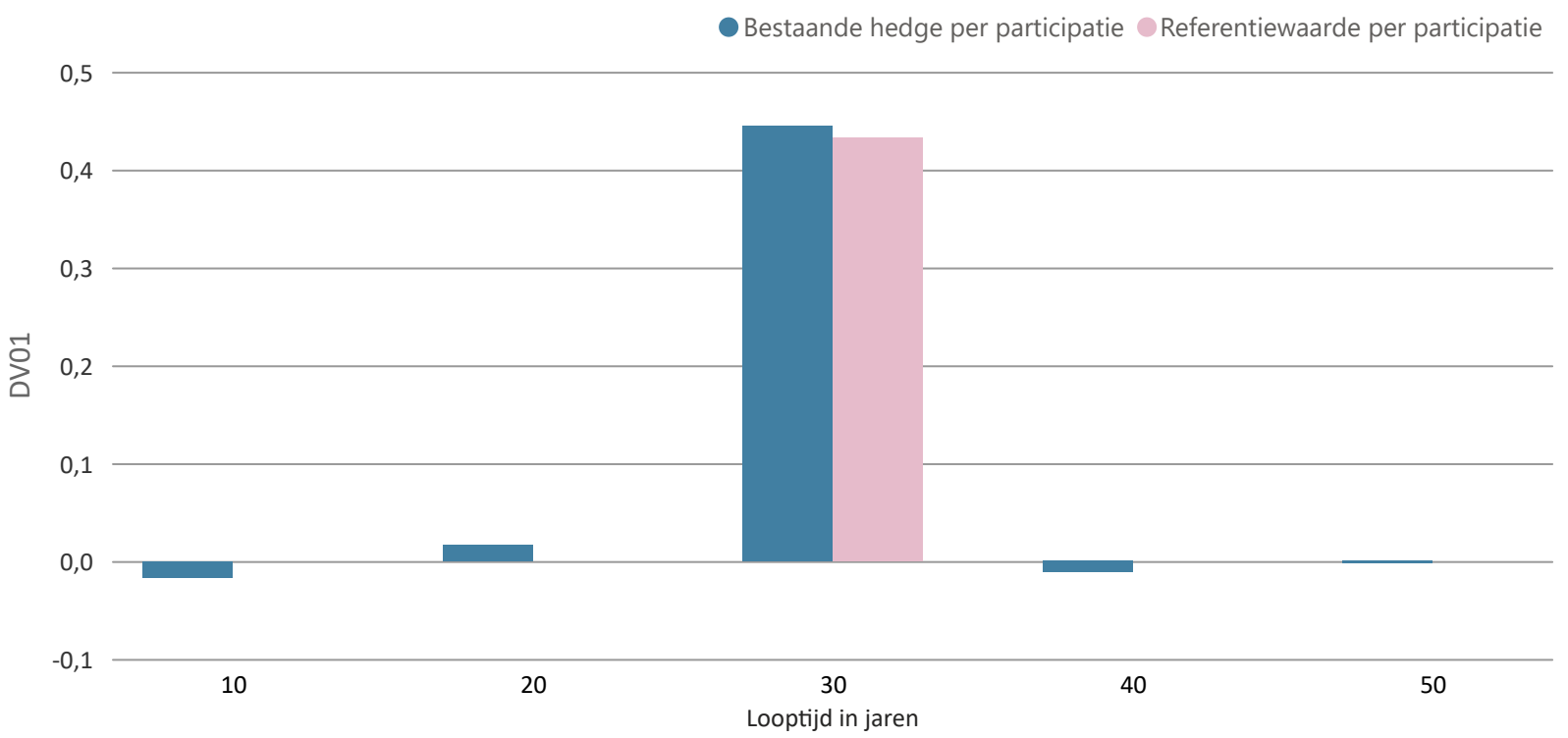
RENTEGEVOELIGHEID

De referentiewaarde van het Fonds wordt bepaald op basis van 25 par swaps die om de doelperiode van het Fonds liggen verdeeld over 6 maanden. De hoofdsommen van de swaps zijn zo gekozen dat de duratie van de referentiewaarde gelijk is aan 45 jaar op het moment van ingaan van de referentiewaarde. De doelstelling van het fonds is om de rentegevoeligheid van de referentiewaarde te benaderen. Per looptijdbucket ziet de afdekking ten opzichte van de referentiewaarde er als volgt uit:

PORTEFEUILLE ALLOCATIE

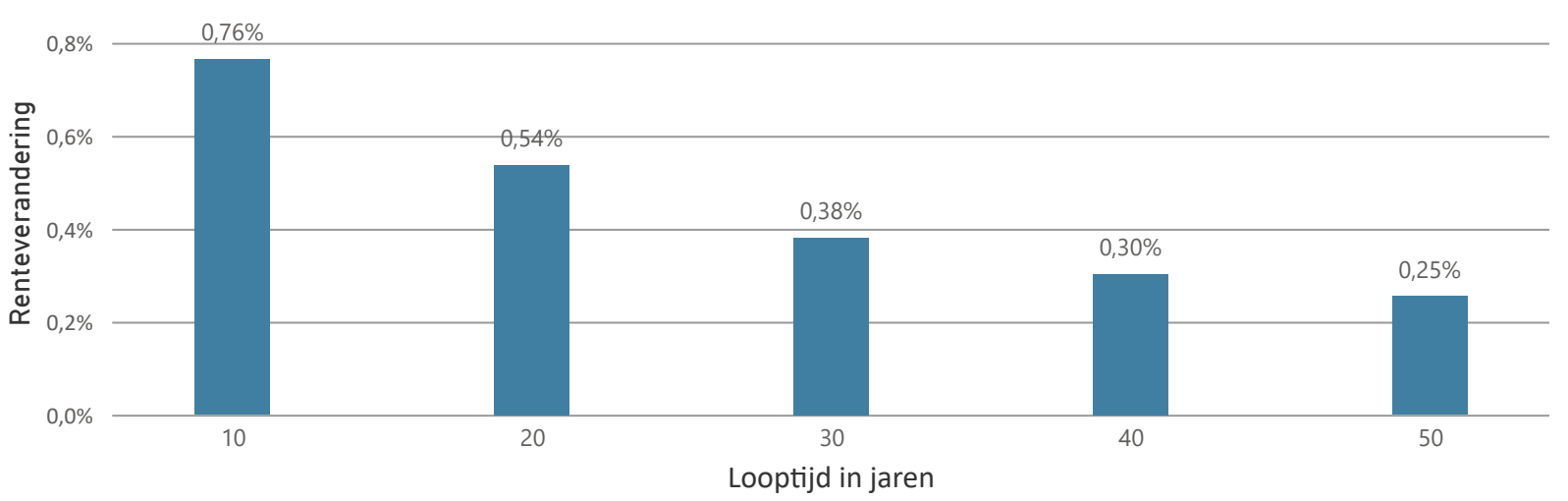
FIGUUR 3: RENTEGEVOELIGHEID (DV01) PER LOOPTIJDSEGMENT

Gegevens per 30-9-2026



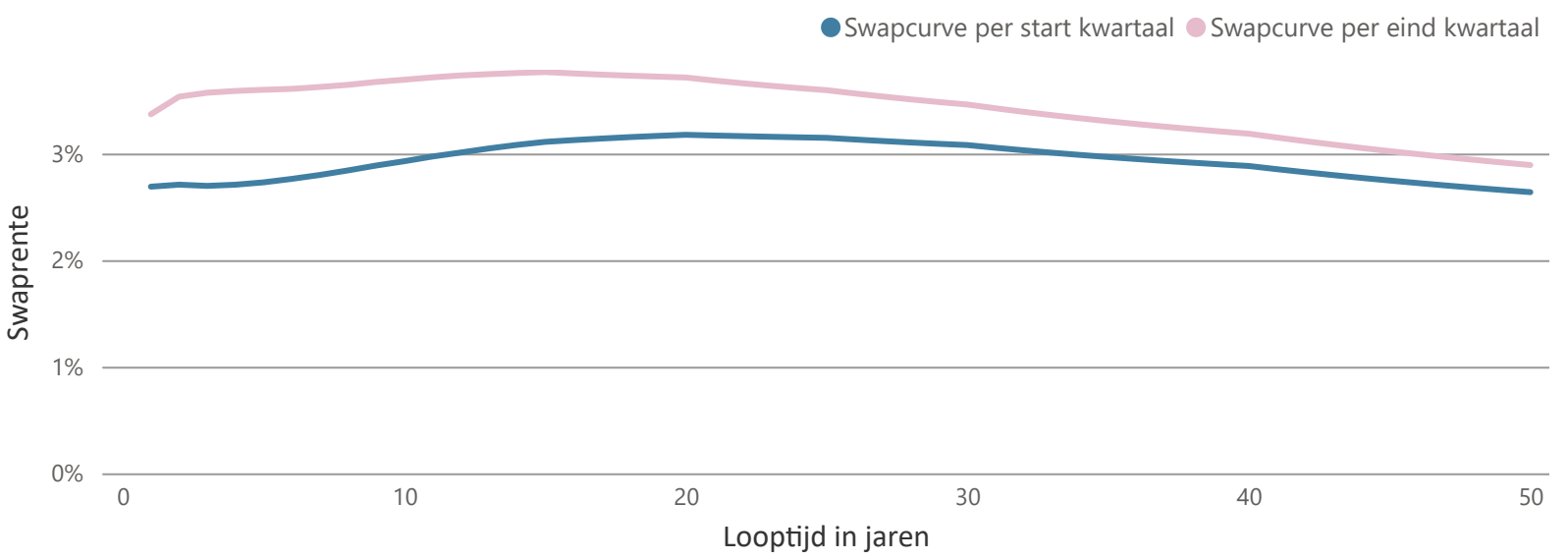
FIGUUR 4: MUTATIE SWAPCURVE PER LOOPTIJDSEGMENT

Gegevens per 30-9-2026



FIGUUR 5: MUTATIE SWAPCURVE PER LOOPTIJDSEGMENT

Gegevens per 30-9-2026



Investment Management

Disclaimer

De waarde van uw belegging kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst.
Wie geld belegt neemt een financieel risico. Ook bij dit fonds loopt u een beleggingsrisico. Rendementen kunnen hoger, maar ook lager uitvallen en zullen meer schommelen naarmate de beleggingsvorm risicovoller is. De rendementen in deze factsheet zijn rendementen die in het verleden zijn behaald en garanderen dus niets voor de toekomst. Achmea Investment Management B.V. (“Achmea IM”) heeft de informatie in dit document met zorg samengesteld. De informatie is alleen bestemd voor gekwalificeerde beleggers en/of professionele beleggers zoals bedoeld in de Wet op het financieel toezicht (Wft). Dit document is of bevat (i) geen aanbod of uitnodiging om financiële instrumenten te kopen, te verkopen of te verhandelen, (ii) geen beleggingsaanbeveling of beleggingsadvies, (iii) geen juridisch, fiscaal of ander advies. Achmea IM raadt u af een (beleggings)beslissing uitsluitend te baseren op de informatie in dit document. Achmea IM is niet aansprakelijk voor schade die het gevolg is van zo’n (beleggings)beslissing.
De informatie in dit document is (mede) gebaseerd op informatie die Achmea IM van betrouwbaar geachte informatiebronnen heeft verkregen. Achmea IM garandeert niet de betrouwbaarheid van die bronnen en de juistheid en volledigheid van de van die bronnen verkregen informatie. De informatie in dit document is puur informatief en u kunt daaraan geen rechten ontlenen. Alle informatie is een momentopname. Achmea IM heeft het recht om deze informatie zonder aankondiging te wijzigen. Het noemen van rendementen op beleggingen in dit document dient uitsluitend als uitleg en toelichting.
Achmea IM spreekt daarmee geen verwachting uit over het rendement of koersverloop van die beleggingen. U mag de informatie in dit document alleen voor eigen persoonlijk gebruik kopiëren. U mag de informatie niet overnemen, vermenigvuldigen, distribueren of openbaren zonder schriftelijke toestemming van Achmea IM. Alle informatie (teksten, foto’s, illustraties, grafisch materiaal, handelsnamen, logo’s, woord- en beeldmerken) blijft eigendom van of in licentie bij Achmea IM en wordt beschermd door auteursrecht, merkenrecht en/of intellectueel eigendomsrecht. Er worden geen rechten of licenties overgedragen bij gebruik van of toegang tot deze informatie.
Voor dit fonds is een prospectus beschikbaar, waarin de relevante gegevens met betrekking tot dit fonds zijn vermeld. Lees het prospectus voordat u besluit tot belegging in dit fonds. Achmea Investment Management B.V., statutair gevestigd te Zeist (KvK 18059537), beschikt over een vergunning als beheerder van beleggingsinstellingen, zoals bedoeld in de Wet op het financieel toezicht. Achmea Investment Management B.V. is ingeschreven in het register van de Stichting Autoriteit Financiële Markten onder nummer 15001209.

achmea
Investment Management