Achmea IM ESG Transition Euro Investment Grade Credit Fund - I

Factsheet per 30-09-2026

FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Netherlands
Oprichtingsdatum	31-3-2016
Beleggingscategorie	Vastrentende Waarden
Dividend uitkerend	Nee
Basisvaluta	Euro
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNY Mellon
SFDR-classificatie	Artikel 8
Lopende kosten factor	0,185%
Benchmark	Bloomberg Euro-Aggregate 500MM Ex Treasury Total Return Index

KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 1.563.429.865
Aantal uitstaande participaties	14.807.521
Intrinsieke waarde	€ 105,58

RISICOCIJFERS	3 JAAR	5 JAAR
Standaarddeviatie	3,73%	5,48%
Ex post tracking error	0,23%	0,31%
Sharpe-ratio (fonds)	0,17	-0,59
Sharpe-ratio (benchmark)	0,11	-0,64
Informatieratio	1,09	0,94

Duurzaamheidsprofiel

Het Achmea IM MVB beleid is van toepassing op het Fonds. Het Fonds promoot ESG-kenmerken, maar heeft duurzame beleggingen niet als doel. Meer informatie over de beleidsinvulling is te vinden op achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/mvb. De volgende instrumenten worden ingezet:

- Engagement
- ESG-integratie
- Uitsluitingen

VERHANDELBAARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL00150029A4
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	15:00 CET

KARAKTERISTIEKEN	FONDS	BENCHMARK
Duratie (modified)	4,93	4,94
Aantal belangen	562	7.119

Fondsmanager

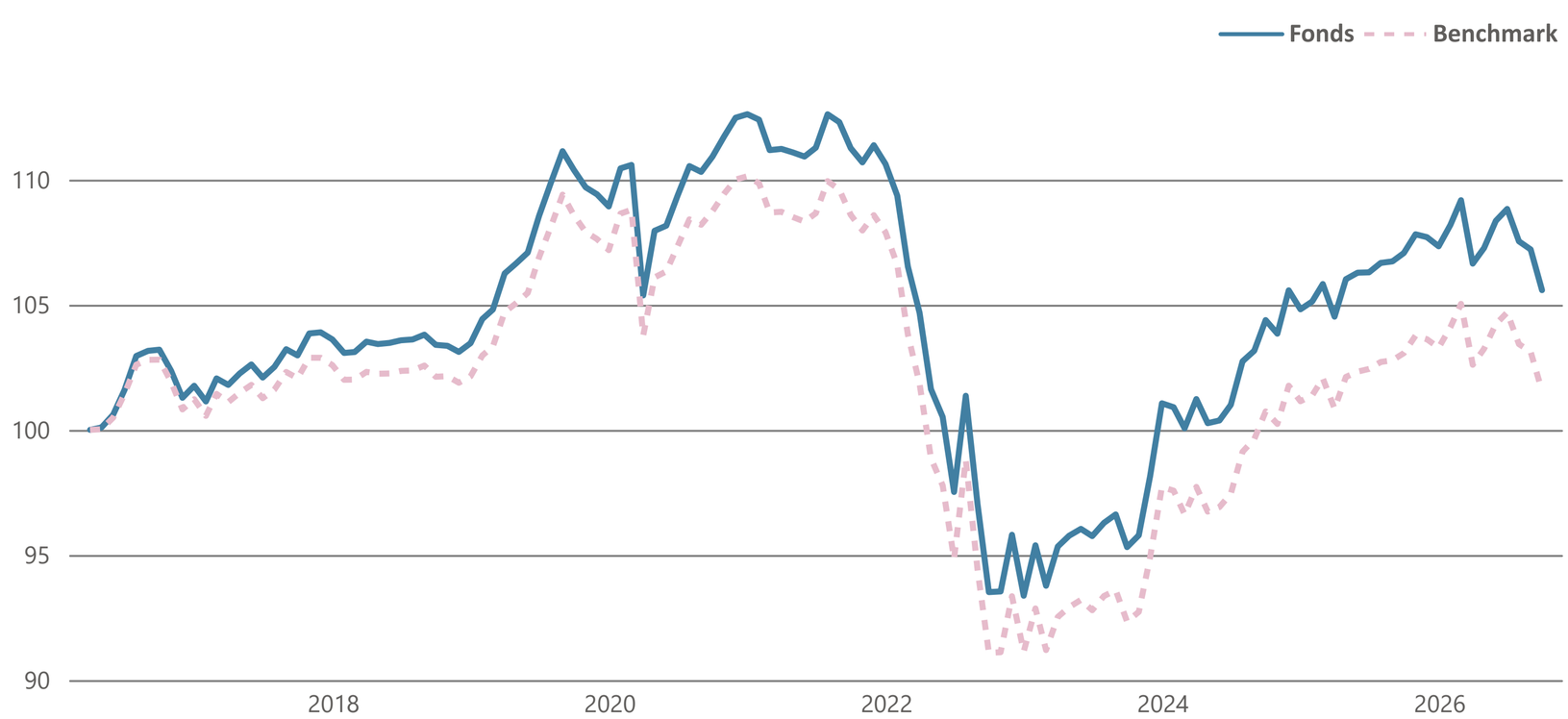
Martijn Hesterman

FONDSPROFIEL

Het Fonds belegt voornamelijk in euro gedenomineerde investment grade non-sovereign obligaties. Het Fonds beoogt door actief beheer op langere termijn en voor aftrek van de lopende kosten factor (LKF) 0,40% op jaarbasis beter te presteren dan de benchmark. Het Fonds heeft daarnaast als doelstelling om minimaal 50% reductie van de CO2-uitstoot in het jaar 2030 te behalen ten opzichte van de benchmark in 2020. Dit wordt gerealiseerd aan de hand van een reductiepad waarbij de broeikasgasemissies in één keer met 30% en daarna tot 2030 jaarlijks met gemiddeld 7% worden verlaagd.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE

Geïndexeerd sinds start



Type	1 maand	QTD	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	-1,52%	-2,98%	-1,39%	3,47%	-1,04%	0,52%
Benchmark	-1,52%	-3,00%	-1,47%	3,22%	-1,33%	0,15%
Verschil	0,00%	0,02%	0,08%	0,25%	0,29%	0,37%

Type	2021	2022	2023	2024	2025	2026
Fonds	-1,77%	-15,60%	8,24%	3,72%	2,40%	-1,63%
Benchmark	-2,03%	-15,53%	7,21%	3,51%	2,11%	-1,68%
Verschil	0,26%	-0,07%	1,02%	0,21%	0,29%	0,04%

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

VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

Euro investment grade-spreads liepen in september fors uit, van 79 naar 90 basispunten. Ook de spreads op semistaats- en gedekte obligaties liepen fors op. Met name in de tweede helft van de maand kwamen spreads onder druk door stijgende rentes als gevolg van oplopende energieprijzen, sterke economische groei en een hawkish houding van centrale banken. Daarnaast leidden tegenvallende verwachtingen voor het Franse begrotingstekort tot een forse underperformance van Franse staatsobligaties, wat vooral druk zette op Franse semistaatsinstellingen en banken.

Voordat de markt halverwege de maand onder druk kwam, was de primaire markt bijzonder sterk. Er werden vooral veel nieuwe financiële obligaties uitgegeven, terwijl de langverwachte uitgiftegolf van Amerikaanse hyperscalers uitbleef. De orderboeken waren aan het begin van de maand zeer sterk, maar verslechterden daarna licht. Toen de markt aan het einde van de maand door de stijgende rentes verder onder druk kwam, werd nauwelijks nog nieuw papier geplaatst.

De portefeuille realiseerde een underperformance ten opzichte van de benchmark, voornamelijk als gevolg van de overwogen top-downrisicopositie. Positieve bijdragen kwamen uit banken, vastgoed en gedekte obligaties. Op naamniveau leverde Vesteda de grootste positieve bijdrage, nadat het bedrijf met een verbeterd aanbod kwam om de documentatie van zijn obligaties aan te passen. Ook Quebec en Amazon droegen positief bij. De grootste negatieve bijdrage kwam van hybride obligaties van Alstom.

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

achmea
Investment Management

Achmea IM ESG Transition Euro Investment Grade Credit Fund - I

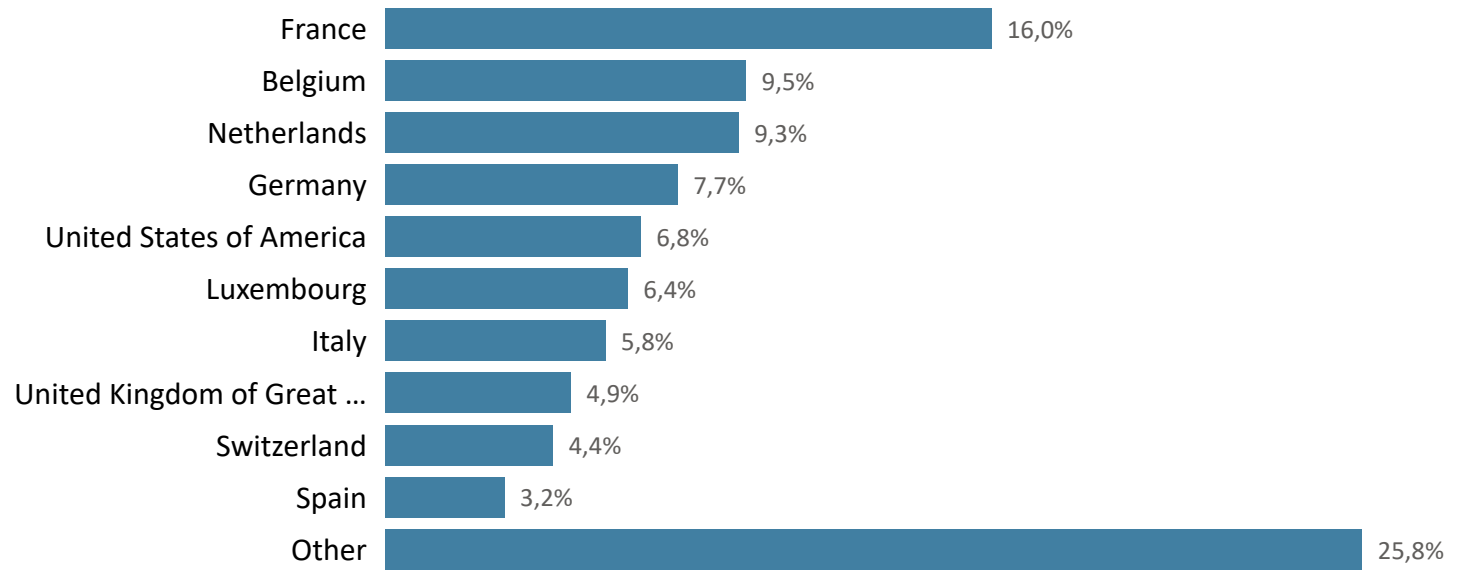
Factsheet per 30-09-2026

VERDELING NAAR REGIO

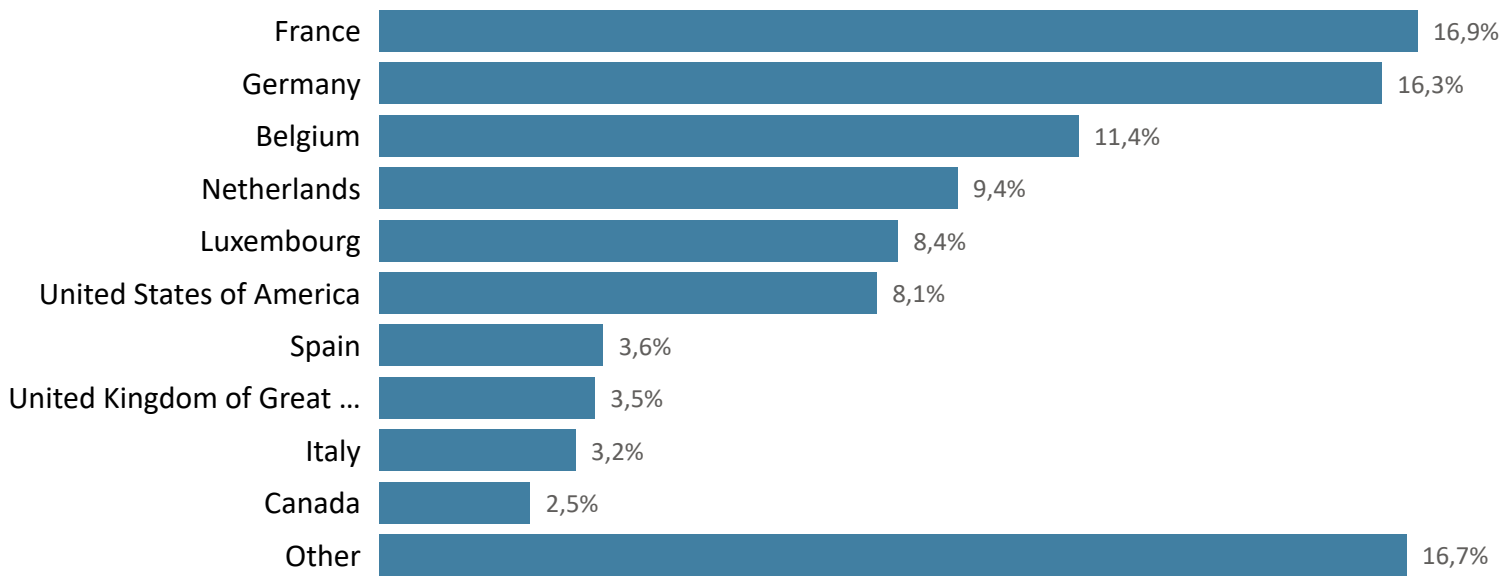
Het Fonds voert geen actief landenbeleid.

PORTEFEUILLE ALLOCATIE

FONDS



BENCHMARK



achmea
Investment Management

Achmea IM ESG Transition Euro Investment Grade Credit Fund - I

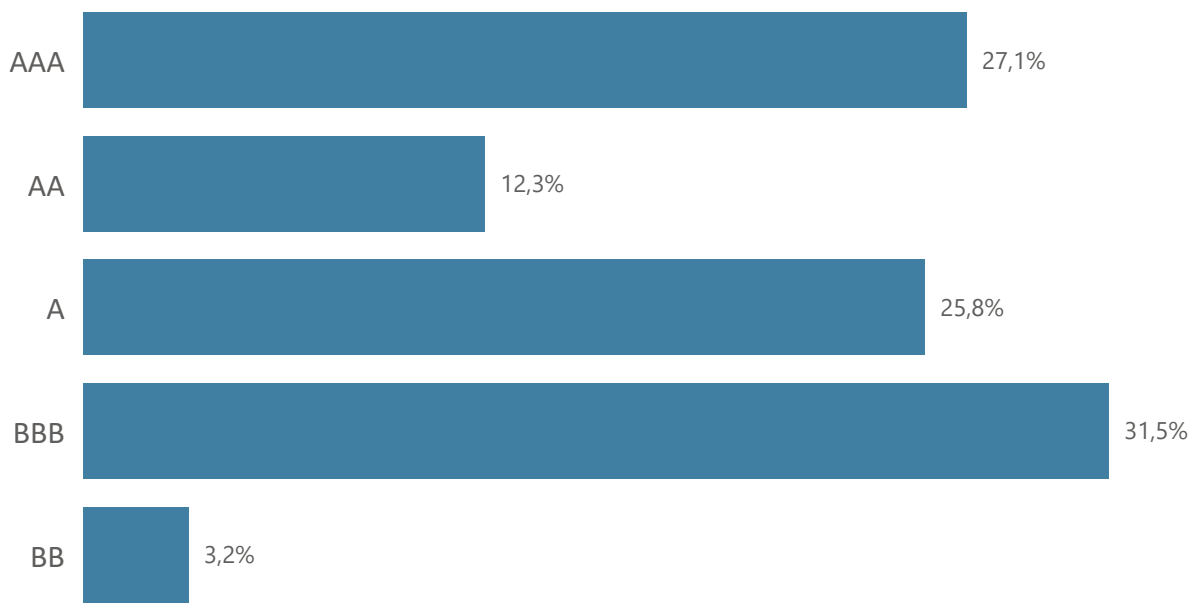
Factsheet per 30-09-2026

VERDELING NAAR RATING

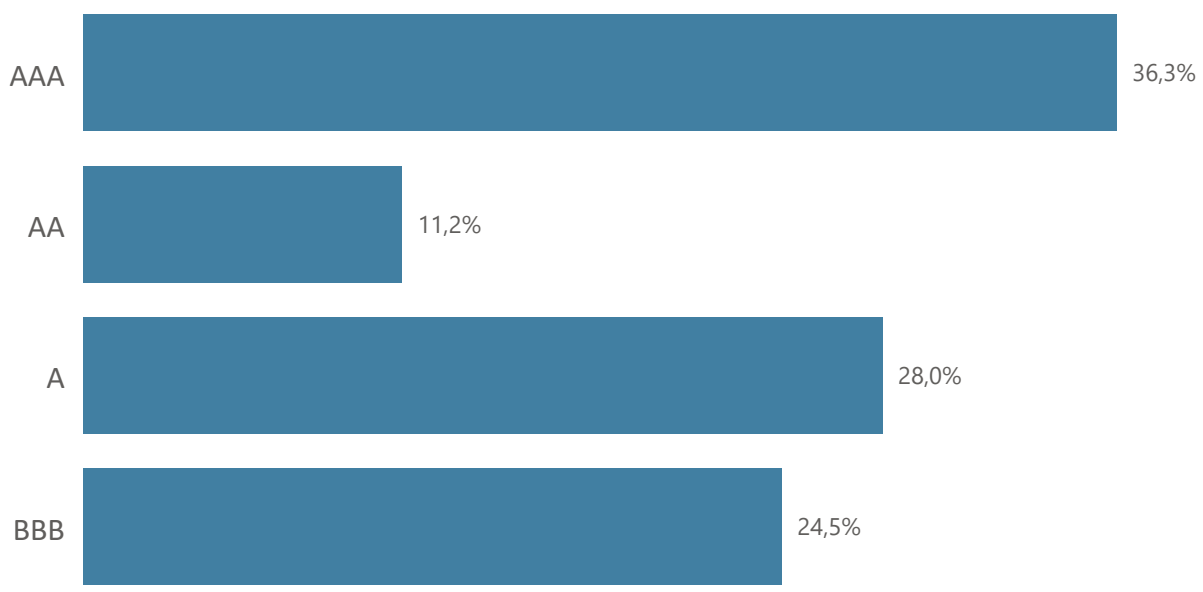
Het Fonds belegt alleen in obligaties met een rating van minimaal "BB-" bij aankoop. Het maximale gewicht van alle obligaties met een rating lager dan "BBB-" bedraagt 15% van het fondsvermogen. Het maximale gewicht in de rating categorieën "AAA", "AA", "A" en "BBB" mag per categorie maximaal 20% afwijken van de benchmarkweging.

PORTEFEUILLE ALLOCATIE

FONDS



BENCHMARK



achmea
Investment Management

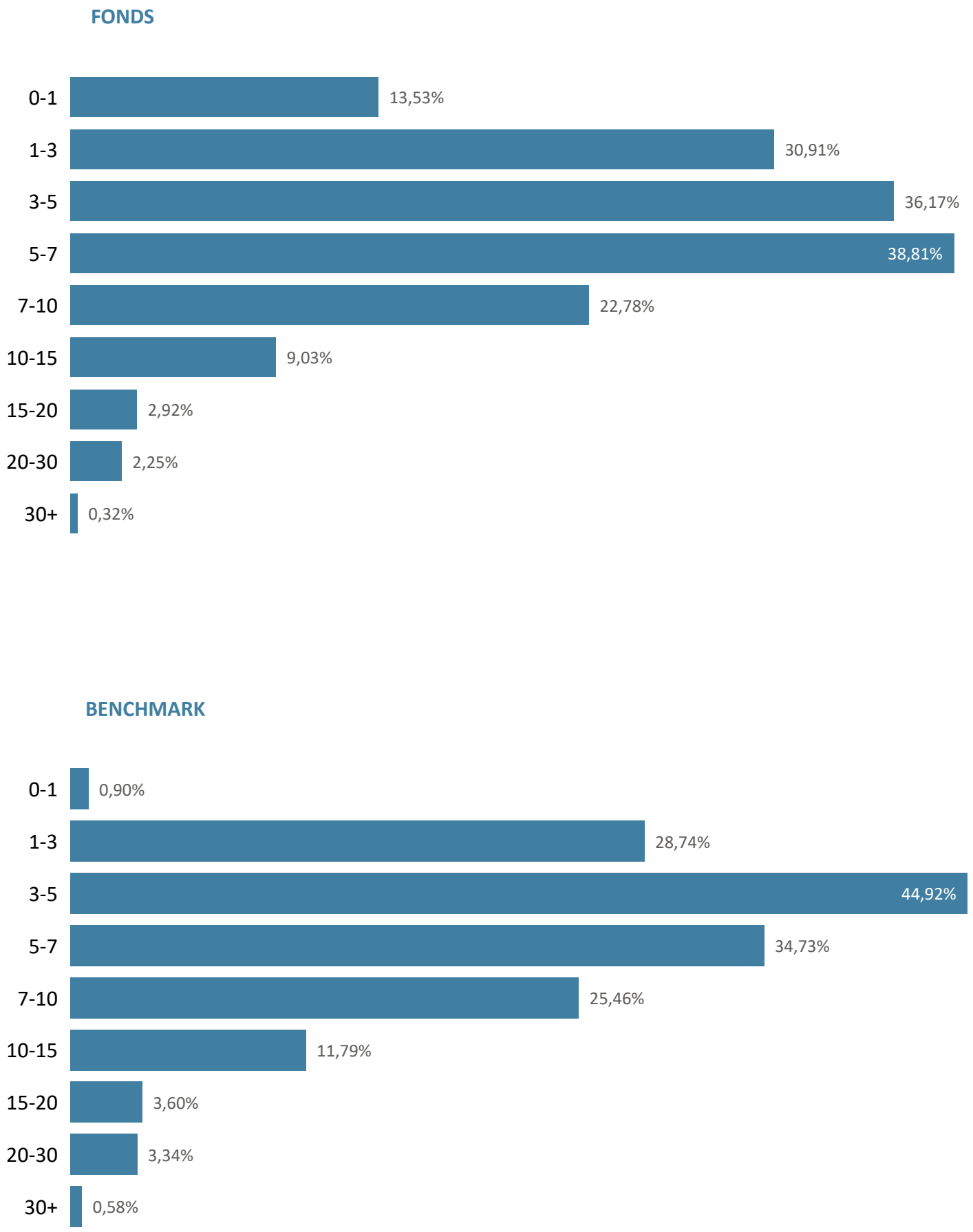
Achmea IM ESG Transition Euro Investment Grade Credit Fund - I

Factsheet per 30-09-2026

VERDELING NAAR LOOPTIJD

Het Fonds voert geen actief looptijdbeleid.

PORTEFEUILLE ALLOCATIE



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

achmea
Investment Management

Achmea IM ESG Transition Euro Investment Grade Credit Fund - I

Factsheet per 30-09-2026

BENADERING CO2-VOETAFDRUK

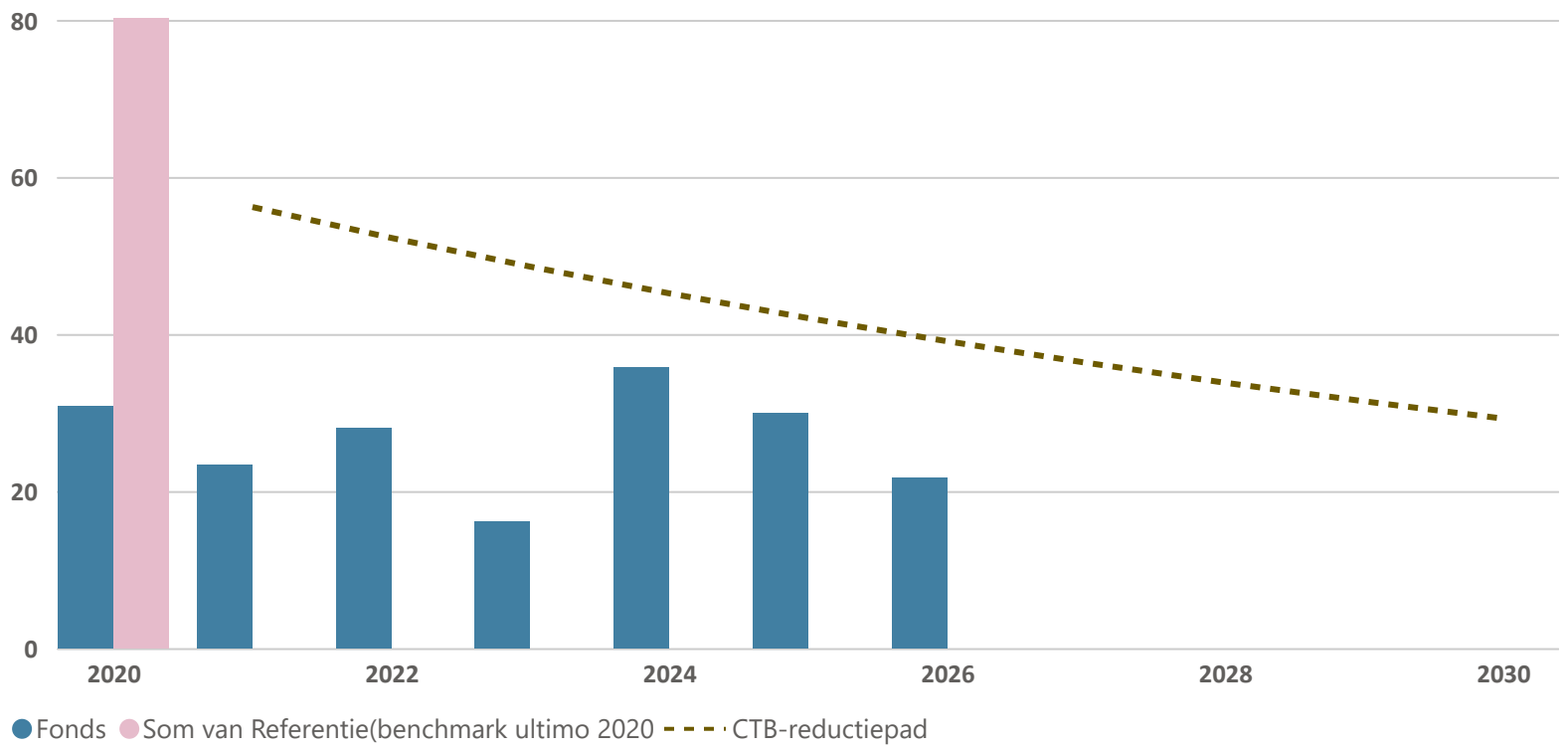
De CO2-voetafdruk laat de door het Fonds gefinancierde broeikasgasemissies zien. Voor het bepalen van de CO2-voetafdruk berekenen we van elke onderneming in het Fonds de totale broeikasgasemissies (GHG) per jaar. We kijken daarbij naar de emissies die de onderneming zelf veroorzaakt door bedrijfsactiviteiten (scope 1 volgens het Greenhouse Gas Protocol) en naar de emissies die samenhangen met de productie van energie die de onderneming inkoopt (scope 2 volgens het Greenhouse Gas Protocol).

De totale broeikasgasemissies delen we door de ondernemingswaarde inclusief contanten (EVIC) in datzelfde jaar. Dit levert per onderneming een attributiefactor op die weergeeft hoeveel broeikasgassen een onderneming uitstoot voor elke euro aan financiering. Om tot de CO2-voetafdruk van het hele Fonds te komen, berekenen we het gewogen gemiddelde van de attributiefactor van alle ondernemingen waarin wij beleggen. De ondernemingen waarin we veel beleggen tellen dus zwaarder mee in het berekenen van de CO2-voetafdruk van het Fonds.

DUURZAAMHEID

FIGUUR: **CO_2-reductiedoelstellingen**

*Gegevens per 31-12-2025**



*Data wordt per half jaar geactualiseerd

achmea
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