

Achmea IM ESG Transition Diversified Return Fund - P

Factsheet per 31-07-2026

FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Netherlands
Oprichtingsdatum	6-7-2023
Beleggingscategorie	Aandelen, vastrentend + vastgoed
Dividend uitkerend	Ja
Basisvaluta	Euro
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNYMellon
SFDR-classificatie	Artikel 8
Lopende kosten factor	0,160%
Benchmark	• MSCI World Net Total Return Index • MSCI World Net Total Return Index (EUR hedged) • MSCI Emerging Markets Net Total Return Index • JP Morgan Government Bond Index Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified Total Return • ICE Bank of America (BofA) Non-Financial Developed Markets High Yield Constrained Total Return Index (EUR hedged) • FTSE EPRA/NAREIT Developed Net Total Return Index • FTSE EPRA/NAREIT Developed Net Total Return Index (EUR hedged)

* Hierbij volgen we de strategische beleggingsmix van het Fonds

KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 4.431.270.843
Aantal uitstaande participaties	27.867.788
Intrinsieke waarde	€ 159,01

RISICOCIJFERS

	3 JAAR	5 JAAR
Standaarddeviatie	10,18%	-
Ex post tracking error	0,73%	-
Sharpe-ratio (fonds)	1,20	-
Sharpe-ratio (benchmark)	1,06	-
Informatieratio	2,31	-

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-en-impact. De volgende instrumenten worden ingezet:

- Engagement en stemmen
- ESG-integratie
- Uitsluitingen

VERHANDELBAARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL0015001DJ2
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	15:00 CET

Fondsmanager

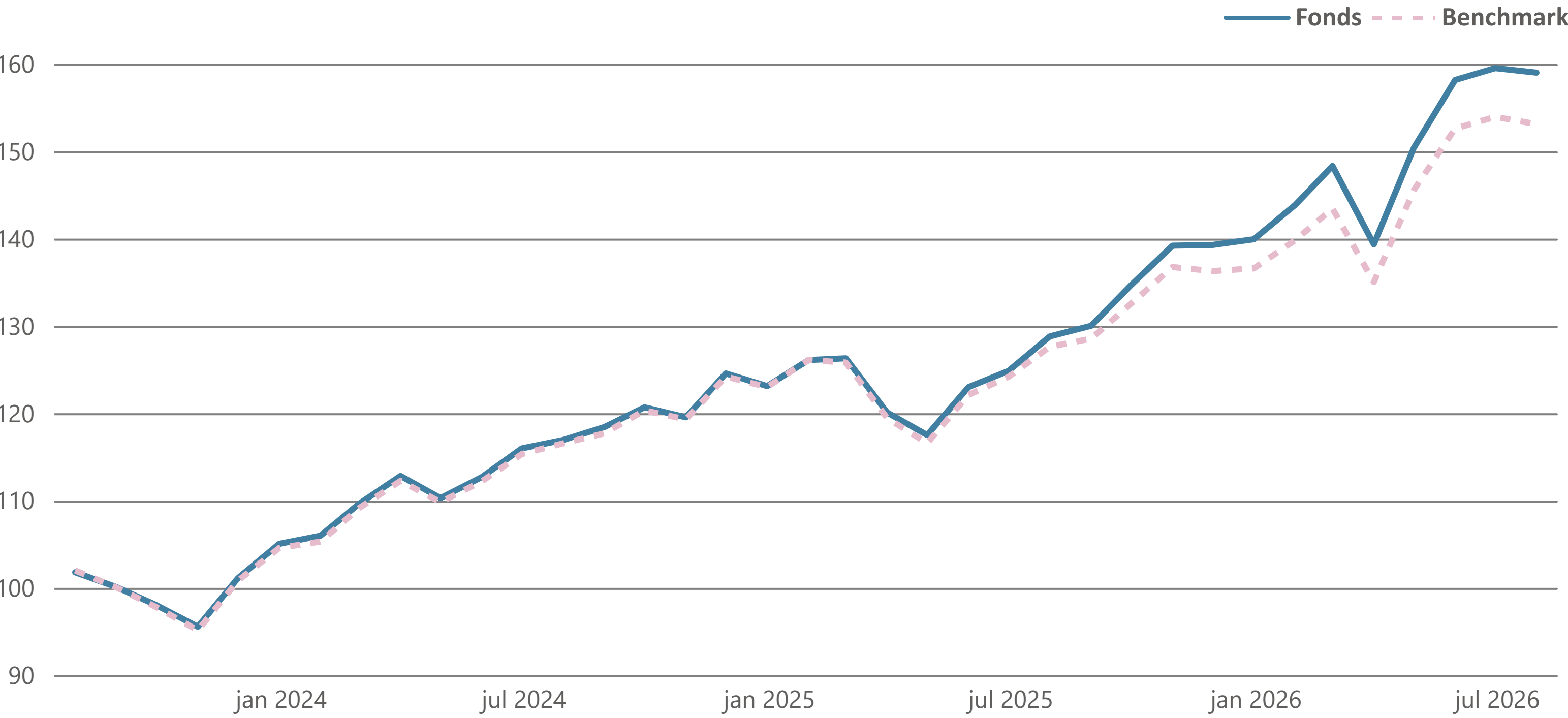
Mark Pieterse

FONDSPROFIEL

Het Fonds richt zich op vermogensgroei op de lange termijn. Het Fonds streeft een optimaal rendement- en risicoprofiel na en promoot ook sociale en/of ecologische kenmerken. Het Fonds belegt indirect in een gediversifieerde mix van aandelen van uitgevende instellingen wereldwijd, aandelen van uitgevende instellingen in opkomende markten, hoogrentende bedrijfsobligaties, staatsobligaties van opkomende landen in lokale valuta en beursgenoteerd vastgoed.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE

Geïndexeerd sinds start



Type	1 maand	QTD	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	-0,32%	-0,32%	23,65%	16,20%	-	16,48%
Benchmark	-0,54%	-0,54%	19,98%	14,50%	-	14,90%
Vershil	0,22%	0,22%	3,67%	1,70%	-	1,57%

Type	2023	2024	2025	2026
Fonds	5,04%	17,20%	13,67%	13,82%
Benchmark	4,57%	17,62%	11,05%	12,10%
Vershil	0,47%	-0,43%	2,62%	1,72%

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

VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

De AI-hausse en het conflict in het Midden-Oosten zetten ook in juli de markten in beweging. Binnen aandelen was sprake van een rotatie uit de AI-winnaars van de eerste helft van 2026 naar de achterblijvers. Vooral halfgeleideraandelen gingen in de uitverkoop. Waardeaandelen en Chinese aandelen profiteerden. De Zuid-Koreaanse aandelenmarkt behoorde tot de grootste verliezers en dit trok het rendement van de brede index voor opkomende markten (MSCI EM) naar beneden. Ook de Japanse en Nederlandse aandelenmarkten werden geraakt. Dit kalenderjaar staan deze markten echter nog steeds op een forse winst.

Het centralebankbeleid was het dominante thema op de obligatiemarkten. De meeste ogen waren gericht op de Fed onder de nieuwe voorzitter Kevin Warsh. De Fed bleef hawkish over de inflatie waardoor de kapitaalmarktrentes opliepen. Na meevallende inflatiecijfers viel de kans op een snelle renteverhoging echter terug. Door de oplopende spanningen in het Midden-Oosten keerde de inflatieangst echter weer terug. Dit vertaalde zich in oplopende kapitaalmarktrentes. Tegelijkertijd liepen de risico-opslagen beperkt op. Per saldo eindigden vrijwel alle vastrentende categorieën de maand met een negatief rendement. Ook sinds het begin van het jaar staan veel categorieën op verlies. Obligaties uit de opkomende markten in lokale valuta (EMD LC) blijven met afstand de best presterende obligaties van 2026.

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

Achmea IM ESG Transition Diversified Return Fund - P

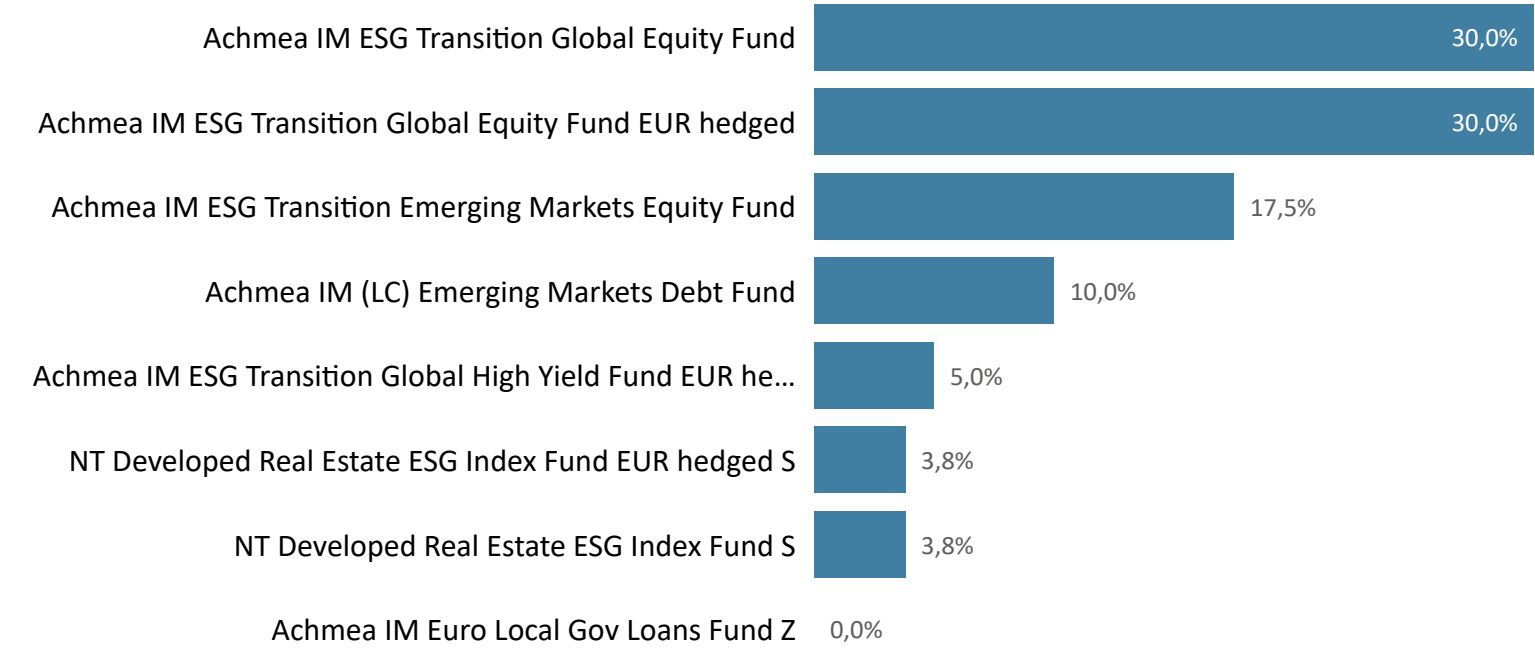
Factsheet per 31-07-2026

STRATEGISCHE ALLOCATIE

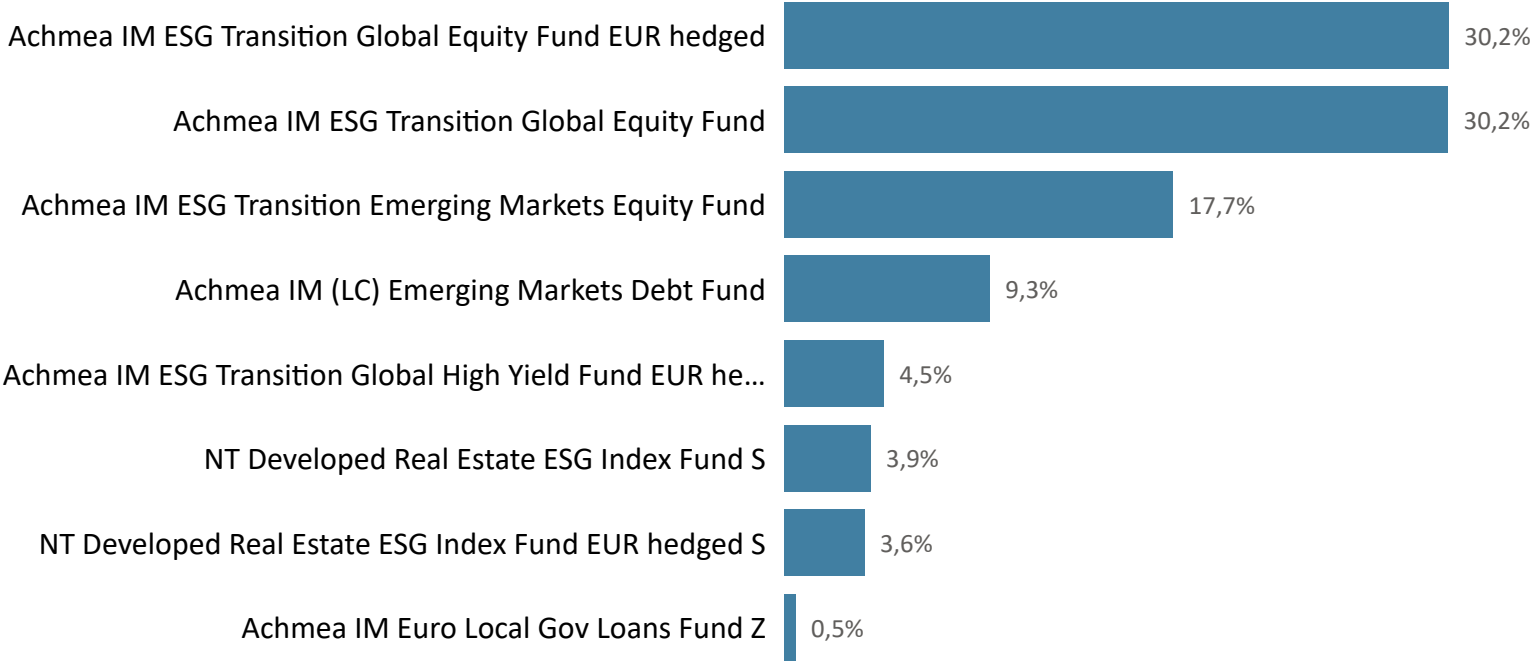
Het Fonds geeft invulling aan de lange termijn beleggingsportefeuille op basis van de strategische allocatie naar onderliggende beleggingsfondsen.

PORTEFEUILLE ALLOCATIE

STRATEGISCHE ALLOCATIE



HUIDIGE ALLOCATIE



Achmea IM ESG Transition Diversified Return Fund - P

Factsheet per 31-07-2026

BENADERING CO2-VOETAFDruk

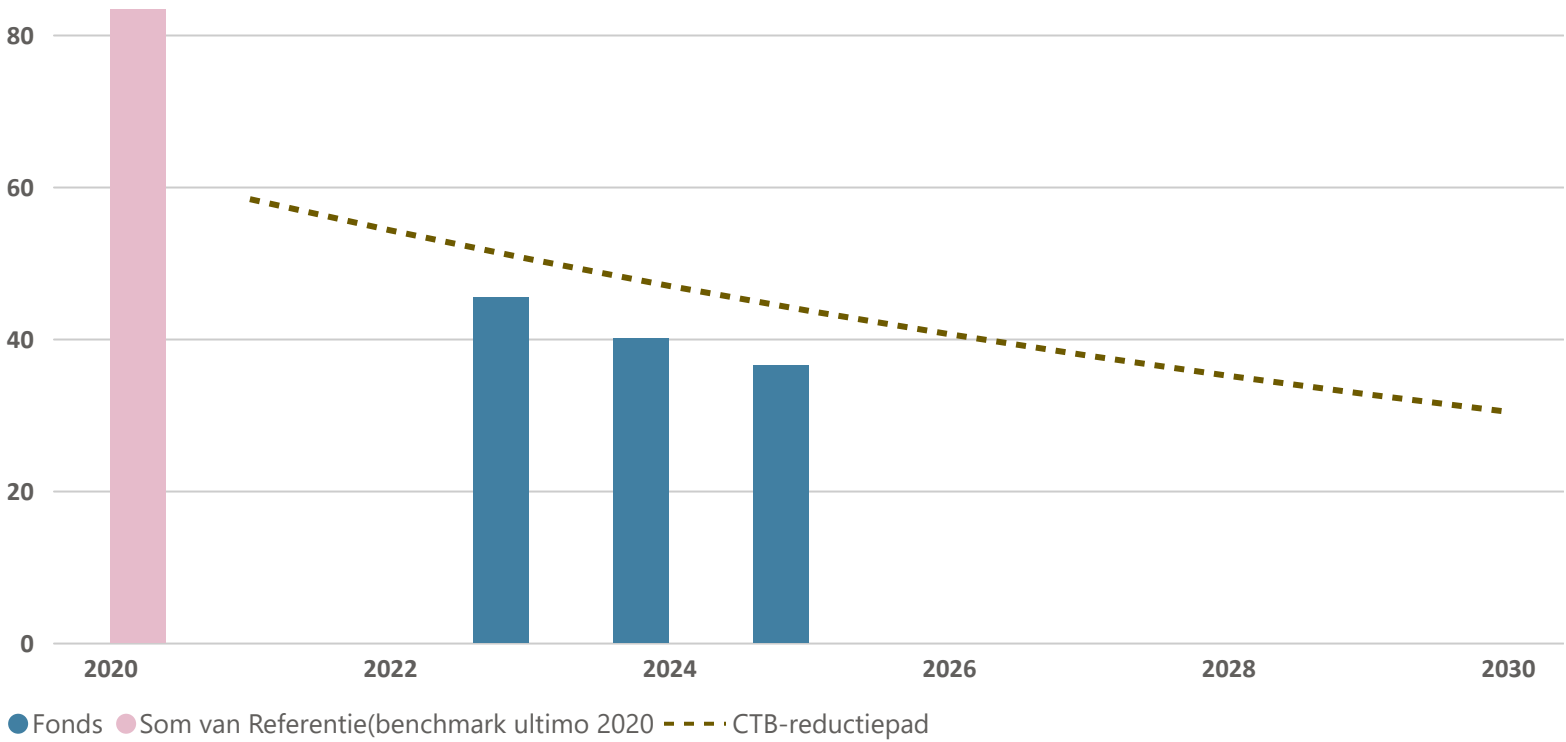
De CO2-voetafdruk laat de door het Fonds gefinancierde broeikasgasemissies zien. Voor het bepalen van de CO2-voetafdruk berekenen we van elke onderneming in het Fonds de totale broeikasgasemissies (GHG) per jaar. We kijken daarbij naar de emissies die de onderneming zelf veroorzaakt door bedrijfsactiviteiten (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: CO₂-reductiedoelstellingen

Gegevens per 31-12-2025*



*Data wordt per half jaar geactualiseerd

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 ontleen. 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.