

# Achmea IM ESG Transition Global Multi Factor Equity Fund

Factsheet per 31-10-2025

## FONDSINFORMATIE

|                              |                                   |
|------------------------------|-----------------------------------|
| Vestigingsland               | Nederland                         |
| Oprichtingsdatum Fonds       | 31-3-2015                         |
| Oprichtingsdatum share class | 5-6-2025                          |
| Beleggingscategorie          | Aandelen                          |
| Dividend uitkerend           | Nee                               |
| Basisvaluta                  | EUR                               |
| Rechtsvorm                   | Fonds voor gemene rekening        |
| Administrateur               | BNY Mellon                        |
| SFDR-classificatie           | Artikel 8                         |
| Ex ante tracking error       | 5,00%                             |
| LKF share class              | 0,23%                             |
| Benchmark                    | MSCI World Net Total Return Index |

## KERNCIJFERS

|                                 |               |
|---------------------------------|---------------|
| Totale fondsgrootte             | € 196.347.120 |
| Totale grootte share class      | € 33.460.688  |
| Aantal uitstaande participaties | 106.538       |
| Intrinsieke waarde              | € 314,07      |

## RISICOCIJFERS

|                          | 3 JAAR | 5 JAAR |
|--------------------------|--------|--------|
| Standaarddeviatie        | 11,84% | 13,72% |
| Ex post tracking error   | 2,04%  | 2,77%  |
| Sharpe-ratio (fonds)     | 1,24   | 1,12   |
| Sharpe-ratio (benchmark) | 0,96   | 0,96   |
| Informatieratio          | 1,87   | 1,01   |

## 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](https://achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/mvb). De volgende instrumenten worden ingezet:

- ESG-integratie
- Engagement en stemmen
- Uitsluitingen



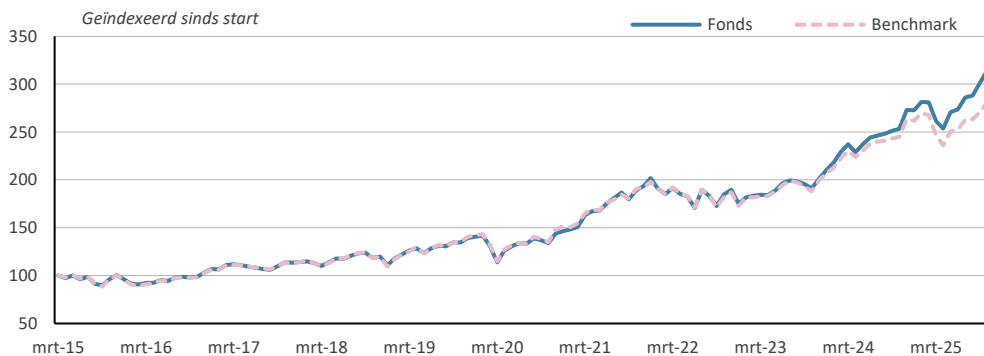
## VERHANDELBAARHEID

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| Liquiditeit     | Dagelijks    |
| ISIN Code       | NL0015002B19 |
| Beursnotering   | Nee          |
| Settlementdatum | T+2          |
| Cut-off tijd    | 15:00 CET    |

## FONDSPROFIEL

Het Fonds belegt wereldwijd hoofdzakelijk in aandelen van beursgenoteerde ondernemingen in ontwikkelde landen. Het Fonds heeft exposure naar de volgende factoren: Value, Quality, Low volatility, Momentum en Small cap (Global Developed Markets Factor Investing). Het Fonds beoogt door actief beheer beter te presteren dan de benchmark. Het Fonds heeft daarnaast als doelstelling de CO<sub>2</sub>-voetafdruk te verkleinen: in 2030 moet deze tenminste 50% lager zijn dan die van de benchmark in 2020. Om dit te realiseren worden de broeikasgasemissies in één keer met 30% verlaagd en daarna tot 2030 jaarlijks met gemiddeld 7%. De langetermijndoelstelling is een klimaatneutrale portefeuille in 2050.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE



|           | 1 maand | 3 maanden | 1 jaar | 3 jaar | 5 jaar | Sinds start |
|-----------|---------|-----------|--------|--------|--------|-------------|
| Fonds     | 4,15%   | 9,77%     | 24,04% | 19,37% | 18,60% | 11,41%      |
| Benchmark | 3,84%   | 7,12%     | 14,78% | 15,55% | 15,80% | 10,26%      |
| Vershil   | 0,31%   | 2,65%     | 9,26%  | 3,82%  | 2,80%  | 1,15%       |

|           | Dit jaar | 2024   | 2023   | 2022    | 2021   | 2020   |
|-----------|----------|--------|--------|---------|--------|--------|
| Fonds     | 15,19%   | 29,81% | 20,02% | -13,36% | 38,11% | 3,96%  |
| Benchmark | 7,47%    | 26,60% | 19,60% | -12,78% | 31,07% | 6,33%  |
| Vershil   | 7,72%    | 3,21%  | 0,42%  | -0,58%  | 7,04%  | -2,37% |

Meerjarige gegevens zijn geannualiseerd

Fondsrendementen zijn na aftrek van de lopende kosten factor

## VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

In oktober zette de aandelenmarkt de opwaartse trend voort. Bedrijven rapporteerden overwegend positieve resultaten, ondanks aanhoudende economische onzekerheid. Het enthousiasme rondom AI leidde tot aanzienlijke investeringen, vooral door technologiebedrijven. Een tijdelijke pauze in het handelsoverval tussen China en de VS bracht rust onder beleggers. Dit resulteerde in een maandrendement van 3,84% voor de MSCI World Index (EUR unhedged). Het Fonds behaalde een rendement dat 0,31% hoger was dan de benchmark.

De stijfactoren droegen negatief bij, voornamelijk door exposure naar de quality- en size-factoren. De value- en momentumfactoren leverden een positieve bijdrage. Zowel land- als sectorpositionering droegen afgelopen maand positief bij aan het resultaat. Ook het aandeel-specifieke effect was afgelopen maand positief.

# Achmea IM ESG Transition Global Multi Factor Equity Fund

Factsheet per 31-10-2025

## BELEGGINGSFILOSOFIE

Wetenschappelijk onderzoek laat zien dat het risico-rendementsprofiel van aandelen samenhangt met duidelijk aanwijsbare kenmerken van deze aandelen (factoren genaamd). Het Fonds speelt hier actief op in door gebruik te maken van een bewezen kwantitatieve beleggingsstrategie ('factorbeleggen') die expliciete blootstelling zoekt naar zorgvuldig geselecteerde factoren.

Om de doelstelling van het Fonds ('hoger rendement dan de benchmark') te realiseren, zijn vier factoren geselecteerd voor de selectie van aandelen: waarde, momentum, kwaliteit en size. De geïntegreerde portefeuilleconstructie methodologie zorgt voor:

- een efficiënte exposure naar de geselecteerde factoren en risicobeheersing op geaggregeerd portefeuilleniveau, en
- een stabilere exposure omdat de interactie tussen de factoren direct wordt meegenomen.

Binnen de strategie zal mede gestuurd worden op de ESG-kwaliteit van ondernemingen. Daarnaast vindt er sturing plaats op CO<sub>2</sub>-reductie.

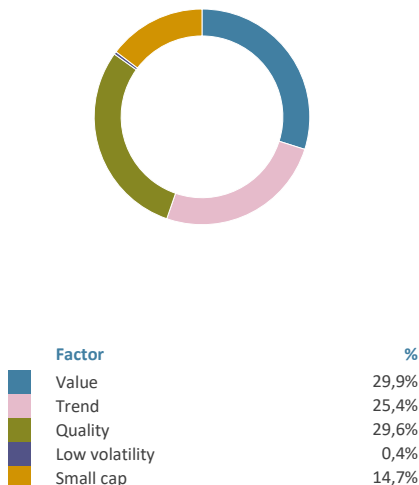
## BENADERING CO<sub>2</sub>-VOETAFDruk

De CO<sub>2</sub>-voetafdruk laat de door het Fonds gefinancierde broeikasgasemissies zien. Voor het bepalen van de CO<sub>2</sub>-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 broeikasgasen een onderneming uitstoot voor elke euro aan financiering. Om tot de CO<sub>2</sub>-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 CO<sub>2</sub>-voetafdruk van het Fonds.

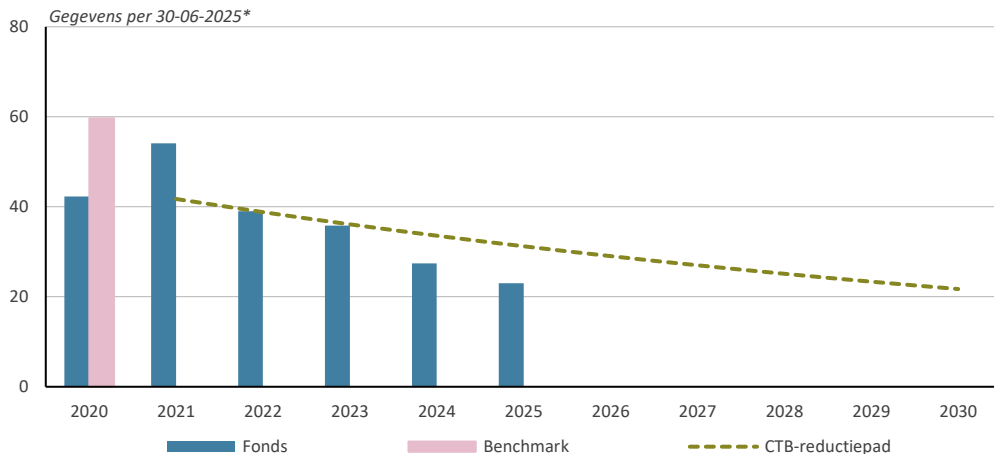
## BELEGGINGSFILOSOFIE

FIGUUR 2: BLOOTSTELLING NAAR FACTOR



## DUURZAAMHEID

FIGUUR 2: CO<sub>2</sub>-reductiedoelstellingen



\*Data wordt per halfjaar geactualiseerd

# Achmea IM ESG Transition Global Multi Factor Equity Fund

Factsheet per 31-10-2025

## VERDELING NAAR SECTOR

Het maximale gewicht per sector mag maximaal 10% afwijken van de benchmarkweging (op basis van de Global Industry Classification Standard niveau 1).

## VERDELING NAAR REGIO

Het maximale gewicht naar regio mag maximaal 10% afwijken van de benchmarkweging.

## PORTEFEUILLE ALLOCATIE

|                        | FONDS       | % BENCHMARK | %     |
|------------------------|-------------|-------------|-------|
| Communication Services | <div></div> | 10,0%       | 8,6%  |
| Consumer Discretionary | <div></div> | 11,4%       | 10,3% |
| Consumer Staples       | <div></div> | 3,6%        | 5,2%  |
| Energy                 | <div></div> | 0,0%        | 3,3%  |
| Financials             | <div></div> | 21,3%       | 16,2% |
| Health Care            | <div></div> | 6,3%        | 9,2%  |
| Industrials            | <div></div> | 8,4%        | 11,1% |
| Information Technology | <div></div> | 33,9%       | 28,6% |
| Materials              | <div></div> | 2,6%        | 3,1%  |
| Real Estate            | <div></div> | 0,5%        | 1,8%  |
| Utilities              | <div></div> | 1,9%        | 2,6%  |

|                     | FONDS       | % BENCHMARK | %     |
|---------------------|-------------|-------------|-------|
| Verenigde Staten    | <div></div> | 68,0%       | 72,7% |
| Verenigd Koninkrijk | <div></div> | 3,9%        | 3,6%  |
| Canada              | <div></div> | 3,8%        | 3,2%  |
| Japan               | <div></div> | 3,4%        | 5,5%  |
| Spanje              | <div></div> | 2,9%        | 0,9%  |
| Frankrijk           | <div></div> | 2,4%        | 2,6%  |
| Zwitserland         | <div></div> | 2,4%        | 2,2%  |
| Italië              | <div></div> | 2,1%        | 0,8%  |
| Australië           | <div></div> | 2,0%        | 1,6%  |
| Nederland           | <div></div> | 1,8%        | 1,2%  |
| Overig              | <div></div> | 7,2%        | 5,7%  |

## 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.