

Achmea IM Duration Matching Fund P

Factsheet per 30-09-2024

FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Nederland
Oprichtingsdatum	6-7-2023
Beleggingscategorie	LDI Overlay
Dividend uitkerend	Nee
Basisvaluta	EUR
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNYMellon
SFDR-classificatie	Artikel 6
Benchmark	n.v.t.

KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 49.270.148
Aantal uitstaande participaties	408.946
Intrinsieke waarde	€ 120,48

VERHANDELBAARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL0015001DM6
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	T-1 15:00 CET

KARAKTERISTIEKEN

FONDS

Duratie (modified)*	36,8
---------------------	------

Gegevens per 30-06-2024

*Deze data wordt per kwartaal geactualiseerd

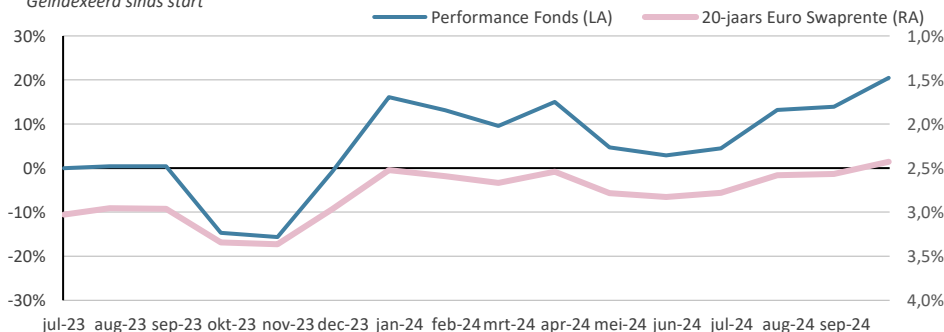
FONDSPROFIEL

Het Fonds biedt een relatief hoge rentegevoeligheid om renterisico efficiënt af te kunnen dekken. Het Fonds stuurt op een voorspelbaar renterisicoprofiel met een duratie van 40 jaar door te beleggen in een mix van het Achmea IM 20 Year Overlay Fund en het Achmea IM Euro Local Government Loans Fund. Het gebruik van andere Achmea IM Overlay Funds is toegestaan.

Het Achmea IM Euro Local Government Loans Fund wordt ingezet als liquiditeitsbuffer om binnen het Fonds zelf aan eventuele bijstortverplichtingen van de Achmea IM Overlay Funds te kunnen voldoen.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE VERSUS SWAPRENT

Geïndexeerd sinds start



	1 maand	3 maanden	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	5,74%	15,31%	41,29%	-	-	16,25%

	Dit jaar	2023
Fonds	3,79%	16,08%

Meerjarige gegevens zijn geannualiseerd

Fondsrendementen zijn na aftrek van de lopende kosten factor

VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

Net zoals de maand ervoor daalden renteniveaus van swaps in euro in september weer. Swaps met kortere looptijden (zoals 2-jaar) daalden harder dan langere looptijden. Swaps met een looptijd van 2 jaar daalden namelijk met ongeveer 40 basispunten in de maand, terwijl langere looptijden (zoals 10-jaar) met ongeveer 20 basispunten daalden, en ultra-lange looptijden (zoals 30-jaar en 50-jaar) met 5 tot 10 basispunten. Het verschil tussen 10-jaar en 30-jaar swaprentes is daarmee ook deze maand weer versteeld, en steeg met ongeveer 10 basispunten. De versteiling van de afgelopen paar maanden zette zich daarmee voort.

Swapsreads (het verschil tussen swaprentes en Duitse staatsobligatie rentes) daalden deze maand ook. Kortlopende swapsreads daalden met ongeveer 3 basispunten, en bereikten weer het laagste niveau van de afgelopen 3 jaar. Langlopende swapsreads, die al langere tijd negatief zijn, daalden iets minder hard.

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 1805937), 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.

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

achmea 
Investment Management