

# Achmea IM Duration Matching Fund P

Factsheet per 31-08-2025

## 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                  |
| Lopende kosten factor | 0,12%                      |
| Benchmark             | n.v.t.                     |

## KERNCIJFERS

|                                 |              |
|---------------------------------|--------------|
| Totale fondsgrootte             | € 35.909.503 |
| Aantal uitstaande participaties | 371.711      |
| Intrinsieke waarde              | € 96,61      |

## VERHANDELBAARHEID

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| Liquiditeit     | Dagelijks     |
| ISIN Code       | NL0015001DM6  |
| Beursnotering   | Nee           |
| Settlementdatum | T+2           |
| Cut-off tijd    | T-1 15:00 CET |
| Opslag          | 0,10%         |
| Afslag          | 0,10%         |

## KARAKTERISTIEKEN

|                    |      |
|--------------------|------|
| Duratie (modified) | 36,6 |
|--------------------|------|

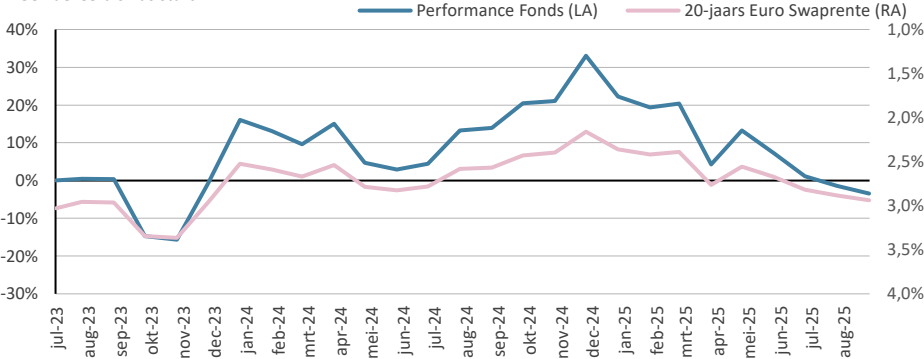
## FONDSPROFIEL

Het Fonds heeft als doel om te sturen op een modified duration van 40. Het Fonds biedt daarmee op een efficiënte manier een blootstelling aan Europese rentebewegingen.

Om aan haar beleggingsdoelstelling te voldoen belegt het Fonds voornamelijk in renteswaps, staatsleningen en in één of meerdere geldmarktfondsen en liquiditeitsfondsen.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE VERSUS SWAPRENT

Geïndexeerd sinds start



|       | 1 maand | 3 maanden | 1 jaar  | 3 jaar | 5 jaar | Sinds start |
|-------|---------|-----------|---------|--------|--------|-------------|
| Fonds | -2,12%  | -10,01%   | -15,27% | -      | -      | -1,59%      |

|       | Dit jaar | 2024  | 2023   |
|-------|----------|-------|--------|
| Fonds | -21,05%  | 5,39% | 16,11% |

Meerjarige gegevens zijn geannualiseerd

Fondsrendementen zijn na aftrek van de lopende kosten factor

## VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

Veranderingen van de niveaus van Europese renteswaps hingen in augustus af van de looptijd. Swaps met looptijden langer dan 30 jaar stegen met ongeveer 10 basispunten. Swaprentes met kortere looptijden (tot en met 5 jaar) daalden daarentegen: ongeveer 5 basispunten. Rentenniveaus van swaps met 10 jaar looptijd bleven ongeveer onveranderd.

De swapcurve is hiermee weer sterk versteild. Het renteverschil tussen 30- en 10-jaar swaprentes steeg met ongeveer 9 basispunten. Het renteverschil tussen 50- en 30-jaar swaprentes steeg met ongeveer 2 basispunten. De verdeling van de rentestructuur van het afgelopen jaar heeft zich daarmee voortgezet.

Swapsreads (het verschil tussen swaprentes en Duitse staatsobligatie rentes) daalden deze maand. Swaps presteerden daarmee beter dan Duitse staatsobligaties. Kortlopende swapsreads, met een looptijd van 5 jaar, daalden met ongeveer een basispunt. Langer lopende swapsreads daalden iets meer.

## 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 de 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.