

# Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged

Factsheet per 31-03-2024

## FONDSINFORMATIE

Vestigingsland	Nederland
Oprichtingsdatum	31-7-2007
Beleggingscategorie	Vastrentende Waarden
Dividend uitkerend	Nee
Basisvaluta	EUR
Rechtsvorm	Fonds voor gemene rekening
Administrateur	BNY Mellon
SFDR-classificatie	Artikel 8
Ex ante tracking error	4,50%
Lopende kosten factor	0,52%
Benchmark	ICE BofA Non-Financial Developed Markets High Yield Constrained TR Index (EUR hedged)

## KERNCIJFERS

Totale fondsgrootte	€ 2.031.739.294
Aantal uitstaande participaties	943.024
Intrinsieke waarde	€ 2.154,49

## KARAKTERISTIEKEN

Duratie (modified)	3,3	3,53
--------------------	-----	------

## RISICOIJFERS

	3 JAAR	5 JAAR
Standaarddeviatie	7,35%	8,80%
Ex post tracking error	1,09%	1,02%
Sharpe-ratio (fonds)	-0,13	0,16
Sharpe-ratio (benchmark)	-0,13	0,13
Informatieratio	0,14	0,15

## 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
- Uitsluitingen



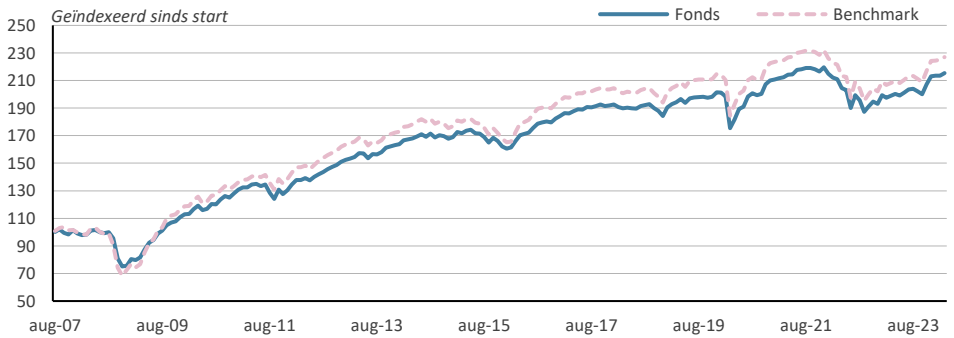
## VERHANDELBAARHEID

Liquiditeit	Dagelijks
ISIN Code	NL0015436387
Beursnotering	Nee
Settlementdatum	T+2
Cut-off tijd	T-1 15:00 CET

## FONDSPROFIEL

Het Fonds belegt hoofdzakelijk in bedrijfsobligaties met een relatief hoge rentevergoeding en een relatief lage kredietwaardigheid ('high yield'). Er is sprake van een wereldwijde spreiding, met een focus op bedrijven in de VS en in Europa. Doelstelling is om door actief beheer op de lange termijn na kosten een hoger rendement te behalen dan de benchmark. Binnen het Fonds zijn drie managers actief op de Amerikaanse high yield markt, de vierde manager richt zich op de Europese high yield markt. Het Fonds voldoet aan de Sustainable Finance Disclosure Regulation (SFDR). Bij het beheer van dit beleggingsfonds houdt Achmea IM rekening met duurzaamheidsrisico's.

FIGUUR 1: CUMULATIEVE PERFORMANCE



	1 maand	3 maanden	1 jaar	3 jaar	5 jaar	Sinds start
Fonds	0,86%	1,10%	8,38%	0,48%	2,09%	4,71%
Benchmark	0,84%	1,18%	8,96%	0,32%	1,94%	5,04%
Vershil	0,02%	-0,08%	-0,58%	0,16%	0,15%	-0,33%

	Dit jaar	2023	2022	2021	2020	2019
Fonds	1,10%	10,32%	-12,03%	4,53%	4,31%	9,29%
Benchmark	1,18%	10,97%	-12,88%	4,20%	3,75%	10,64%
Vershil	-0,08%	-0,65%	0,85%	0,33%	0,56%	-1,35%

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

## VERSLAG VAN DE FONDSBEHEERDER

In het eerste kwartaal behaalde het Fonds een nettorendement van 1,10%, vrijwel gelijk aan de benchmark. Positief was vooral de allocatie naar bankleningen in de portefeuille van de manager Polen. De managers Columbia, Nomura en Threadneedle bleven daarentegen achter bij hun regionale benchmark.

Ga voor meer informatie over onze beleggingsfondsen naar:  
[achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen](https://achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen)

# Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged

Factsheet per 31-03-2024

## VERDELING NAAR REGIO

Het Fonds voert geen actief landenbeleid.

## VERDELING NAAR RATING

Het Fonds belegt hoofdzakelijk in bedrijfsobligaties met een relatief lage kredietwaardigheid ('high yield').

Maximaal 20% van de totale netto vermogens-waarde van het Fonds mag belegd worden in instrumenten met een kredietbeoordeling van BBB- of hoger.

## VERDELING NAAR SECTOR

Het Fonds voert geen actief sectorbeleid.

## 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.

## PORTEFEUILLE ALLOCATIE

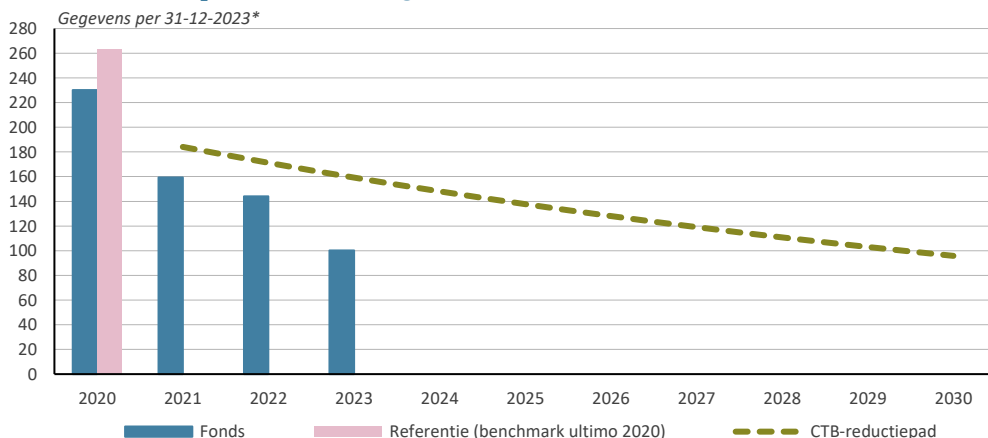
	FONDS	%
Verenigde Staten		72,2%
Canada		6,0%
Groot-Brittannië		4,4%
Frankrijk		3,9%
Spanje		2,2%
Nederland		2,0%
Duitsland		2,0%
Italië		1,8%
Luxemburg		1,0%
India		0,6%
Overig		3,9%

	FONDS	%	BENCHMARK	%
AAA		3,4%		0,0%
AA-		0,0%		0,0%
A		0,1%		0,0%
BBB		2,2%		2,0%
BB		31,2%		38,1%
B		37,7%		42,6%
CCC		20,9%		11,1%
NR		4,5%		6,2%

	FONDS	%	BENCHMARK	%
Gezondheidszorg		9,5%		8,3%
Basismaterialen		8,9%		9,0%
Kapitaalgoederen		8,7%		7,0%
Leisure		7,6%		7,3%
Dienstverlening		7,1%		7,8%
Telecom		7,0%		8,4%
Energie		6,4%		10,8%
Technologie		6,2%		5,2%
Media		6,1%		8,1%
Retail		4,2%		7,3%

## DUURZAAMHEID

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



Ga voor meer informatie over onze beleggingsfondsen naar:  
[achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen](https://achmeainvestmentmanagement.nl/institutioneel/beleggingsfondsen)

**achmea**   
Investment Management

# Achmea IM Global High Yield Fund EUR hedged

Factsheet per 31-03-2024



## 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.