

# AEGON Long Duration Overlay

## Profiel

Het Fonds is een zogeheten overlay structuur met als doel (een deel van) het beoogde renterisicoprofiel van de totale vastrentende portefeuille van een Participant in overeenstemming te brengen met het individueel gewenste renterisicoprofiel. Het beleggingsbeleid is gericht op beleggen op het lange eind van de euro rentecurve.



## Rendement en Risico

	Afgelopen maand	Afgelopen kwartaal	Year to date	Afgelopen 12 mnd	Afgelopen 36 mnd*	Afgelopen 60 mnd*	Sinds oprichting*
Bruto fondsrendement	99.69%	36.89%	83.22%	83.22%	-24.67%	-8.85%	-13.07%
Netto fondsrendement	99.53%	36.58%	81.31%	81.31%	-25.4%	-9.7%	-13.88%

\* Gemiddeld per jaar.

De waarde van beleggingen kan fluctueren. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst.

## Toelichting rendement en risico

- LDO-fondsen brengen de rentegevoeligheid van de beleggingen van pensioenfondsen in lijn met de rentegevoeligheid van de verplichtingen.
- In het vierde kwartaal van 2011 daalde de 25-jaars swaprente in Europa met 16 basispunten tot 2,62%. Hierdoor steeg de waarde van de participaties sterk. De pensioenverplichtingen van de participanten stegen echter ook.
- Het aantal participaties in het LDO-fonds nam gedurende het kwartaal toe.
- Het fonds bestaat uit een gediversifieerde swapportefeuille en een buffer van AAA-staatsobligaties. Binnen het LDO-fonds wordt maandelijks gestuurd op een vaste rentegevoeligheid per participatie.
- In de loop van het kwartaal bewoog de koers van het fonds tussen de ondergrens van 2.000 euro en de bovengrens van 10.000 euro. Hierdoor vonden er geen bijstortingen of afromingen plaats.

## Kerngegevens

**Fondstype:** Vastrentende waarden

**Oprichtingsdatum:** 30 november 2004

**Beursnotering:** Nee

**Dividend:** Het fonds keert geen dividend uit. De ontvangen inkomsten worden herbelegd.

**Valutarisico:** Nee

**Benchmark:** Merrill Lynch EMU Direct Gov. Bond Idx, AAA Rated + (200/duration van ML EMU direct Gov. Bond Idx (Cust))\* (ML EMU Direct Gov. Bond Idx (Cust) - Euribor 6 month / 12)

**Koers (eindstand kwartaal)\*\*:** € 6,340.07

**Totaal belegd vermogen:** € 358,524,396

**Aantal participaties:** 56,549

**Toe-/uittreding:** Op de eerste werkdag van iedere maand kan worden toe- en uitgetreden tegen de intrinsieke waarde van het Fonds. Conform de voorwaarden van uw verzekerings- en pensioencontract.

\*\* Kijk voor de actuele koersinformatie op [www.aegon.nl](http://www.aegon.nl)

## Kosten

**Beheervergoeding per jaar:** € 45 per participatie

**Servicefee per jaar:** 1,50 euro per participatie per jaar.

**TER (2010):** 0.76%

# AEGON Long Duration Overlay

Rating	
AAA	42.4%
Overig	57.6%

Grootste belangen	
Frankrijk Gov Bonds	36.4%
Duitsland Gov Bonds	27.1%
Nederland Gov Bond	15.5%
Oostenrijk Gov Bonds	8.9%
Finland Gov Bonds	3.2%
Euro Community 3.25% 04/2018	1.1%
Euro Community 3.5% 06/2021	1.1%
Obb-Infrastrukt Ag 4.5% 07/2019	1.1%
Kreditanst Fur Wie 2% 09/2016	0.7%
European Investment Bank 2.75% 09/2021	0.7%

Regio/landenverdeling	
Frankrijk	36.8%
Duitsland	28.9%
Nederland	15.5%
Oostenrijk	12.1%
Supranational	3.4%
Finland	3.2%

Een toelichting op de begrippen die in deze Fondsinformatie worden gebruikt, vindt u in de 'Algemene Informatie over de beleggingsfondsen bij uw AEGON beleggingsverzekering of AEGON pensioenverzekering'.