

### Profiel

Het Fonds belegt, direct of indirect, in Nederlandse hypotheekleningen, waarvan het onderpand particuliere Nederlandse woonhuizen betreft. Het debiteurenrisico van de hypotheekleningen is verschillend. Het beleggingsbeleid is erop gericht om outperformance te behalen met de debiteurenspread die geldt voor Nederlandse hypothecaire leningen ten opzichte van de Nederlandse obligatiemarkt.



### Algemene gegevens

Oprichtingsdatum	01 Augustus 1997
Fondstype	Hypotheekleningen
Type investeerder	Institutioneel
Dividend	Maandelijks
Structuur	Open End
Beursgenoteerd	Nee
ISIN	NL0000685386
Fondsvaluta	EUR
Fondsgrootte	202.820.198
Koers <sup>1</sup>	5,79
Participaties	34.999.570
Securities lending <sup>2</sup>	
Opbrengst	0,00 bps
Uitgeleend	0,00 %
Gross leverage	144,31 %
Leverage commitment	23,36 %

### Kosten<sup>3</sup>

Beheervergoeding	0,10 %
Servicekosten	0,03 %
Servicing fee	0,10 %
LKF	0,21 %

De servicekosten zijn omgekeerd geschaald met betrekking tot de fondsgrootte. De maximale servicekosten worden weergegeven.

### Risicofactoren

Duration	9,18
----------	------

### Rendement en risico

#### Rendement en risico<sup>4</sup>

	1m	3m	Ytd	3y	5y	SI
Bruto fondsrendement (%)	0,92	0,93	2,23	3,68	4,25	5,75
Netto fondsrendement (%)	0,91	0,91	2,15	3,58	4,15	5,64
Benchmark (%)	1,09	0,67	2,93	3,12	2,46	4,76
Tracking error ex post (%)	-	-	-	1,86	1,85	1,86
Information ratio	-	-	-	0,24	0,89	0,45

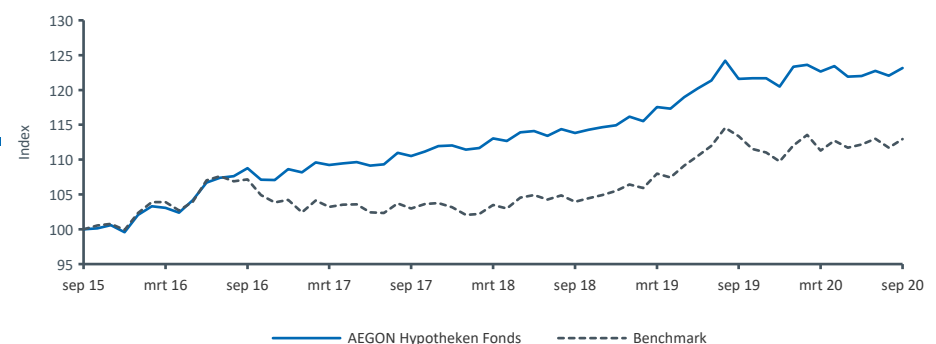
#### Jaarrendement en risico

	sep 20	sep 19	sep 18	sep 17	sep 16
Bruto fondsrendement (%)	1,28	6,82	3,02	1,57	8,79
Netto fondsrendement (%)	1,18	6,71	2,92	1,47	8,68
Benchmark (%)	-0,38	9,08	0,92	-3,91	7,16
Tracking error ex post (%)	2,73	1,17	1,12	1,66	1,69
Information ratio	0,57	-1,85	1,76	3,37	0,84

#### Benchmark

JP Morgan Government Bond Index Traded Netherlands

#### Cumulatief rendement



Het cumulatief fondsrendement is gebaseerd op het totale rendement exclusief beheervergoeding, servicefee, instapkosten en uitstapkosten.

<sup>1</sup> Kijk voor de actuele koersinformatie op [www.aegon.nl](http://www.aegon.nl)

<sup>2</sup> Securities lending draagt bij aan de opbrengst van het Fonds. Van de totale opbrengst van securities lending komt 72% ten goede aan het Fonds. De door Aegon Asset Management en de met haar samenwerkende partijen in rekening gebrachte kosten verbonden aan het uitvoeren van securities lending zijn hierop reeds in mindering gebracht. De hier genoemde opbrengsten zijn geschat. Het exacte bedrag is 3 weken na maandeinde bekend.

<sup>3</sup> Bron: Aegon Asset Management. Indicatie lopende kosten op basis van de werkelijke kosten over het jaar 2019.

<sup>4</sup> Geannualiseerd (voor periodes langer dan een jaar).

## Sectorverdeling (%)

Financiële instellingen	82,7
ABS	13,1
Derivaten	0,4
Staatsobligaties	0,2
Liquiditeiten	3,6

## Valutaverdeling (%)

	Pre hedge	Post hedge
EUR	100,0	100,0
<b>Totaal</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>

## Ratingverdeling (%)

AAA	13,3
AA	82,7
A	0,4
NR	-0,0
Liquiditeiten	3,6

## 10 grootste belangen (%)

Hypotheek	82,7
Storm 2016-2 A 0.109% 31/12/2025	2,3
Edml 2018-1 A 0.152% 15/08/2022	1,9
Storm 2018-1 A 0.157% 22/01/2023	1,9
Storm 2015-2 A 0.000% 28/08/2021	1,4
Tulp 2019-1 A 0.201% 30/04/2024	1,3
Edml 2019-1 A 0.152% 05/05/2025	1,0
Oranl 2015-11 A 0.000% 05/06/2022	0,9
Drmp 2 A 0.000% 20/09/2022	0,6
Storm 2017-1 A 0.157% 21/01/2022	0,5

## Asset allocatie (%)

Leningen	82,7
Obligaties	13,1
Derivaten	0,6
Liquiditeiten	3,6

## Landenverdeling (%)

Nederland	95,8
Frankrijk	0,4
Duitsland	0,2
Eurozone	-0,0
Liquiditeiten	3,6

### Disclaimer

Deze informatie is met zorg samengesteld namens Aegon Investment Management B.V. Er is naar gestreefd de informatie zo juist en volledig mogelijk weer te geven. Onvolkomenheden als gevolg van menselijke vergissingen of informatiesystemen kunnen echter voorkomen, waardoor gegevens en calculaties kunnen afwijken. Aan de verstrekte informatie en berekende waarden kunnen geen rechten worden ontleend. De verstrekte informatie is aan wijziging onderhevig. De waarde van het financiële instrument is afhankelijk van de ontwikkelingen op financiële markten of (indien van toepassing) andere markten. Alleen professionele beleggers in de zin van de Wet op het financieel toezicht die behoren tot de fiscale entiteit van Aegon. N.V. kunnen participeren in het fonds. Aegon Investment Management B.V. beschikt over een vergunning als beheerder van beleggingsinstellingen als bedoeld in de Wet op financieel toezicht en is als zodanig geregistreerd bij de Autoriteit Financiële Markten. Op basis van haar vergunning is Aegon Investment Management B.V. geautoriseerd om individueel vermogensbeheer en beleggingsadvies te verlenen in de zin van de Wet op het financieel toezicht. Meer informatie staat op [www.aegon.nl](http://www.aegon.nl).

Dit rapport is gebaseerd op het "look through" principe. Dit betekent dat er een doorkijk getoond wordt door de beleggingsfondsen heen waardoor er inzicht gegeven wordt in de instrumenten op het laagste niveau. Via Aegon belegt u mogelijk rechtstreeks of indirect in fondsen die niet door Aegon beheerd worden. Graag wijzen we u erop dat de fondsen die niet door Aegon beheerd worden, niet in de look through rapportages opgenomen zijn. Wij kunnen u daarom niet een complete doorkijk geven. Als gevolg hiervan kunnen wij u mogelijk niet een alles omvattend inzicht in de risico's van uw beleggingen leveren. Graag verwijzen wij u, voor definities en het prospectus, naar onze website.