

Profiel

Het Fonds belegt, direct of indirect, in asset backed securities (inclusief structured credits) genoteerd in euro, gespreid over verschillende issuers, onderpanden, sectoren en landen. Het beleggingsproces is gericht op waarde toevoeging door middel van een actief selectiebeleid van issuers, onderpanden, sectoren en landen.



Algemene gegevens

Oprichtingsdatum	30 Juni 2011
Fondstype	Vastrentende waarden
Type investeerder	Institutioneel
Dividend	Nee
Structuur	Open End
Beursgenoteerd	Nee
ISIN	NL0009821792
Fondsvaluta	EUR
Fondsgrootte	90.075.547
Koers ¹	14,75
Participaties	6.108.797
Securities lending ²	
Opbrengst	0,00 bps
Uitgeleend	0,00 %
Gross leverage	147,12 %
Leverage commitment	28,07 %

Kosten³

Beheervergoeding	0,25 %
Servicekosten	0,06 %
LKF	0,31 %
Instapkosten	0,05 %
Uitstapkosten	0,05 %

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

Risicofactoren

Duration	0,50
----------	------

Rendement en risico

Rendement en risico⁴

	1m	3m	Ytd	3y	5y	SI
Bruto fondsrendement (%)	0,08	0,01	0,08	1,24	1,54	4,23
Netto fondsrendement (%)	0,06	-0,06	0,06	0,98	1,29	3,97
Benchmark (%)	-0,08	-0,15	-0,08	0,53	0,54	2,11
Tracking error ex post (%)	-	-	-	1,42	1,17	1,59
Information ratio	-	-	-	0,32	0,64	1,14

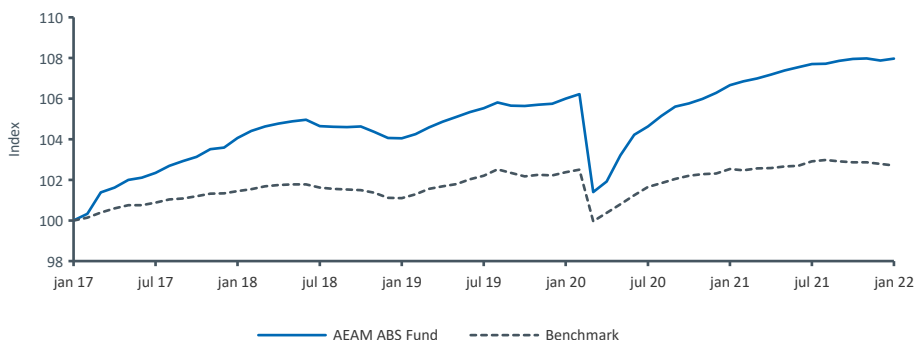
Jaarrendement en risico

	jan 22	jan 21	jan 20	jan 19	jan 18
Bruto fondsrendement (%)	1,22	0,63	1,87	0,00	4,05
Netto fondsrendement (%)	0,96	0,38	1,61	-0,25	3,79
Benchmark (%)	0,17	0,16	1,25	-0,34	1,45
Tracking error ex post (%)	0,34	2,49	0,22	0,37	0,70
Information ratio	2,29	0,09	1,59	0,24	3,31

Benchmark

Bloomberg Barclays Capital Euro Asset Backed Securities Floating Rate Note Composite Index and the Bloomberg Barclays Capital Euro Asset Backed Securities Fixed Coupon Composite Index

Cumulatief rendement



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

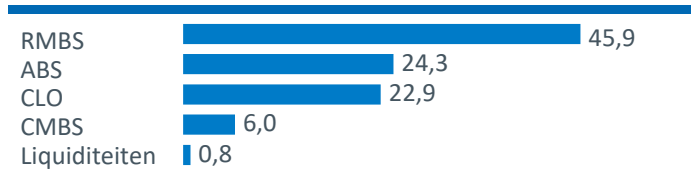
¹ Kijk voor de actuele koersinformatie op www.aegonam.com

² 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.

³ Bron: Aegon Asset Management. Indicatie lopende kosten op basis van de werkelijke kosten over het jaar 2020.

⁴ Geannualiseerd (voor periodes langer dan een jaar).

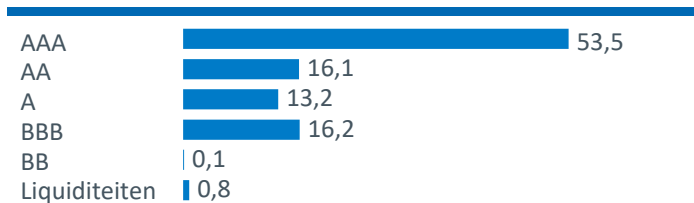
Sectorverdeling (%)



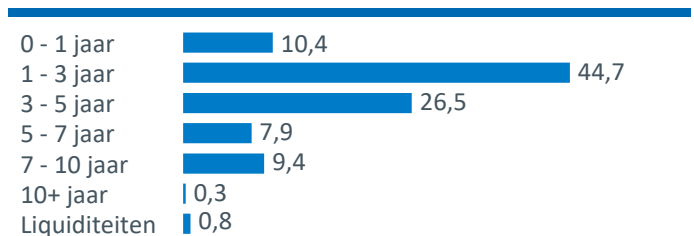
Valutaverdeling (%)

	Pre hedge	Post hedge
EUR	71,6	100,2
GBP	28,4	-0,2
Totaal	100,0	100,0

Ratingverdeling (%)



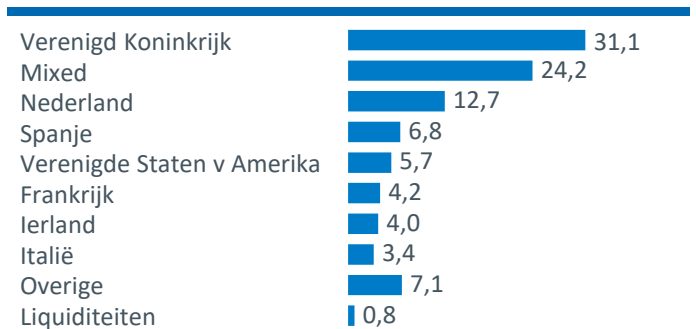
Looptijdverdeling (%)



10 grootste belangen (%)

SLMA 2004-5X A6	3,0
SLM STUDENT LOAN	1,7
FSQ 2021-1GRX AGRN	1,4
HLFCT 2021-G A	1,4
BUMP 2021-BE1 A	1,0
FNGAL 1 A	1,0
TPMF 2019-A13X A1	1,0
TAGST 2009-ENGY A1	1,0
SLMA 2004-10X A8	1,0
RNBAI 1 A	0,9

Landenverdeling (%)



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 kunnen participeren in het fonds. Aegon Investment Management B.V. beschikt over een vergunning als beheerder van beleggingsinstellingen als bedoeld in de Wet op het 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. In het verleden behaalde resultaten bieden geen garantie voor de toekomst. Meer informatie staat op 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.