

## 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                | 01 November 2004     |
| Fondstype                       | Vastrentende waarden |
| Type investeerder               | Institutioneel       |
| Dividend                        | Maandelijks          |
| Structuur                       | Open End             |
| Beursgenoteerd                  | Nee                  |
| ISIN                            | NL0006354466         |
| SFDR classification             | Article 8            |
| Fondsvaluta                     | EUR                  |
| Fondsgrootte                    | 51.622.306           |
| Koers <sup>1</sup>              | 10,40                |
| Participaties                   | 4.963.161            |
| Securities lending <sup>2</sup> |                      |
| Opbrengst                       | 0,00 bps             |
| Uitgeleend                      | 0,00 %               |
| Gross leverage                  | 130,77 %             |
| Leverage commitment             | 1,05 %               |

## Kosten<sup>3</sup>

|                  |        |
|------------------|--------|
| Beheervergoeding | 0,12 % |
| Servicekosten    | 0,03 % |
| LKF              | 0,15 % |
| Instapkosten     | 0,05 % |
| Uitstapkosten    | 0,05 % |

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

De kosten van beleggen zijn van invloed op uw investering. Het rendement wordt verminderd met mogelijke kosten van het beheren van de investering. Kosten kunnen een cumulatief effect hebben.

## Rendement en risico

In het verleden behaalde resultaten vormen geen indicatie voor toekomstige resultaten.

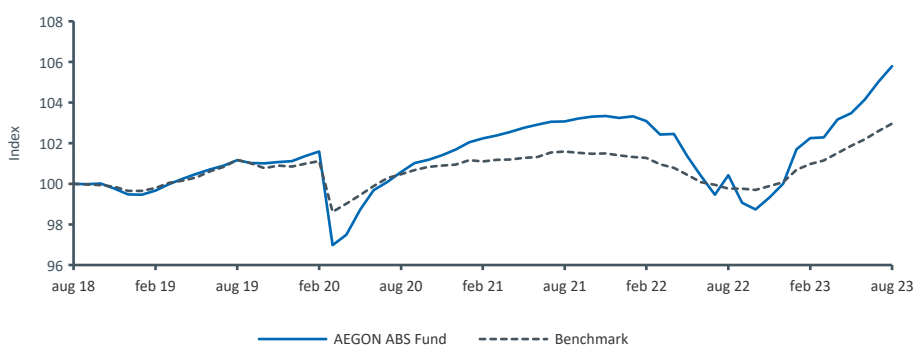
### Rendement en risico

|                            | 1m   | 3m   | Ytd  | 3y   | 5y   | SI   |
|----------------------------|------|------|------|------|------|------|
| Bruto fondsrendement (%)   | 0,73 | 2,24 | 5,80 | 1,70 | 1,13 | 4,34 |
| Netto fondsrendement (%)   | 0,72 | 2,20 | 5,69 | 1,56 | 1,00 | 4,21 |
| Benchmark (%)              | 0,35 | 1,07 | 2,88 | 0,82 | 0,55 | 2,13 |
| Tracking error ex post (%) | -    | -    | -    | 1,61 | 1,64 | 2,14 |
| Information ratio          | -    | -    | -    | 0,45 | 0,27 | 0,95 |

### 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.

## Risicofactoren

|          |      |
|----------|------|
| Duration | 0,30 |
|----------|------|

<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 2022.

## Jaarrendement en risico

In het verleden behaalde resultaten vormen geen indicatie voor toekomstige resultaten.

| 12 maanden tot             | aug 23 | aug 22 | aug 21 | aug 20 | aug 19 | aug 18 | aug 17 | aug 16 | aug 15 | aug 14 |
|----------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Bruto fondsrendement (%)   | 5,34   | -2,57  | 2,47   | -0,57  | 1,16   | 1,90   | 5,47   | 2,23   | 2,15   | 17,60  |
| Netto fondsrendement (%)   | 5,19   | -2,71  | 2,35   | -0,69  | 1,04   | 1,78   | 5,34   | 2,11   | 2,03   | 17,45  |
| Benchmark (%)              | 3,21   | -1,80  | 1,12   | -0,67  | 1,18   | 0,91   | 2,38   | 1,88   | 1,03   | 8,99   |
| Tracking error ex post (%) | 2,07   | 1,84   | 0,37   | 2,55   | 0,32   | 0,56   | 0,56   | 2,07   | 1,14   | 1,85   |
| Information ratio          | 0,93   | -0,50  | 3,24   | 0,03   | -0,43  | 1,54   | 5,18   | 0,11   | 0,87   | 4,20   |

## Sectorverdeling (%)

|               |      |
|---------------|------|
| RMBS          | 40,7 |
| CLO           | 24,7 |
| ABS           | 23,7 |
| CMBS          | 7,4  |
| Liquiditeiten | 3,5  |

## Valutaverdeling (%)

|        | Pre hedge | Post hedge |
|--------|-----------|------------|
| EUR    | 71,6      | 99,6       |
| GBP    | 28,3      | 0,3        |
| USD    | 0,1       | 0,1        |
| Totaal | 100,0     | 100,0      |

## Ratingverdeling (%)

|               |      |
|---------------|------|
| AAA           | 38,4 |
| AA            | 16,5 |
| A             | 19,0 |
| BBB           | 22,6 |
| BB            | 0,1  |
| Liquiditeiten | 3,5  |

## Looptijdverdeling (%)

|               |      |
|---------------|------|
| 0 - 1 jaar    | 14,3 |
| 1 - 3 jaar    | 44,9 |
| 3 - 5 jaar    | 17,7 |
| 5 - 7 jaar    | 9,5  |
| 7 - 10 jaar   | 10,2 |
| Liquiditeiten | 3,5  |

## 10 grootste belangen (%)

|                    |     |
|--------------------|-----|
| SLMA 2004-5X A6    | 3,0 |
| SLM STUDENT LOAN   | 1,7 |
| SLMA 2004-10X A8   | 1,3 |
| FSQ 2021-1GRX AGRN | 1,0 |
| DPF 2022-1 A       | 0,9 |
| MIRAV 2020-1 A     | 0,8 |
| TPMF 2019-A13X A1  | 0,8 |
| VCL 39 A           | 0,8 |
| DPF 2023-1 A       | 0,8 |
| DPF 2021-2 A       | 0,7 |

## Landenverdeling (%)

|                            |      |
|----------------------------|------|
| Verenigd Koninkrijk        | 29,4 |
| Mixed                      | 26,6 |
| Nederland                  | 12,0 |
| Verenigde Staten v Amerika | 6,0  |
| Duitsland                  | 5,3  |
| Spanje                     | 5,2  |
| Ierland                    | 4,5  |
| Italië                     | 2,7  |
| Overige                    | 4,7  |
| Liquiditeiten              | 3,5  |

Alleen voor professionele beleggers - dit dient niet te worden verspreid aan en is niet de bedoeld voor particuliere klanten. Dit is een marketingcommunicatie. Raadpleeg het Prospectus van het Fonds en het Essentiële Beleggersinformatie alvorens definitieve beleggingsbeslissingen te nemen. De relevante documenten zijn beschikbaar op [aegonam.com](http://aegonam.com). Het grootste risico van dit product is het verlies van kapitaal. Dit fonds is alleen beschikbaar voor entiteiten die deel uitmaken van de Aegon NV-groep en die in aanmerking komen als professioneel belegger volgende de Nederlandse Wet op het financieel toezicht (Wft). Dit fonds is vrijgesteld van de Wft onder artikel 1:13a van de Wft.

In het verleden behaalde resultaten vormen geen indicatie voor toekomstige resultaten. De resultaten, waaronder inkomstenuitkeringen, zijn niet gegarandeerd. Kosten kunnen toenemen of afnemen als gevolg van valuta- en wisselkoersschommelingen

Alle gegevens zijn afkomstig van Aegon Asset Management, tenzij anders vermeld. Het document is correct op datum van schrijven, maar kan zonder voorafgaande kennisgeving worden gewijzigd. Gegevens die worden toegeschreven aan een externe partij ('Gegevens externe partij') zijn eigendom van die externe partij en/of andere leveranciers (de 'Gegevenseigenaar') en worden door Aegon Investment Management B.V. onder licentie gebruikt. Gegevens externe partijen: (i) mogen niet worden gekopieerd of verspreid; en (ii) zijn niet gegarandeerd nauwkeurig, volledig of actueel. Geen van de Gegevenseigenaren, Aegon Investment Management B.V. of enige andere persoon verbonden met, of betrokken door bronnen van Aegon Investment Management B.V., is aansprakelijk voor verlies of aansprakelijkheid voortvloeiend uit het gebruik van Gegevens van externe partijen.

Het doelfonds van deze marketing is een in Nederland gevestigd Alternatief beleggingsfonds. De marketing en het aanbod van het fonds is beperkt tot alleen professionele beleggers. Aegon Investment Management BV is de Beheerder van het Alternatieve beleggingsfonds.

Aegon Investment Management B.V. is bij de Autoriteit Financiële Markten geregistreerd als vergunninghoudende fondsbeheerder. Op basis van haar vergunning voor fondsbeheer is Aegon Investment Management B.V. ook bevoegd individueel portefeuillebeheer en adviesdiensten aan te bieden.