

Dit is een marketingdocument

KNAB DIVERSIFIED BOND FUND II



Factsheet per 31 Januari 2024

Profiel

Het Fonds belegt, direct of indirect, in vastrentende waarden. Onder vastrentende waarden vallen onder andere de volgende beleggingscategorieën: staatsobligaties, bedrijfsobligaties, high yield obligaties, emerging market debt, asset backed securities en liquiditeiten. De Beheerder kan andere beleggingscategorieën toewijzen, waarbij de belangen van de participant (onder andere risico en rendement) gewaarborgd zullen blijven. Het Fonds kan zodoende beleggen in nieuwe beleggingscategorieën, instrumenten, technieken of structuren, die door de Beheerder geschikt worden geacht voor het realiseren van de doelstelling en/of het beleggingsbeleid van het Fonds.



Algemene gegevens

Oprichtingsdatum	16 September 2019
Fondstype	Mix
Type investeerder	Retail
Dividend	Nee
Structuur	Open End
Beursgenoteerd	Nee
ISIN	NL0013771629
SFDR classification	Article 8
Fondsvaluta	EUR
Fondsgrootte	151.990.819
Koers ¹	11,15
Participaties	13.627.951
Securities lending ²	
Opbrengst	0,02 bps
Uitgeleend	7,42 %
Gross leverage	136,95 %
Leverage commitment	8,83 %

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 (%)	0,15	5,87	0,15	-1,77	-	-0,56
Netto fondsrendement (%)	0,13	5,81	0,13	-1,96	-	-0,74
Benchmark (%)	-0,20	5,49	-0,20	-2,98	-	-1,57
Tracking error ex post (%)	-	-	-	0,67	-	1,20
Information ratio	-	-	-	1,56	-	0,70

Benchmark

40%: Bloomberg Barclays Capital Euro-Aggregate Corporate Index; 30%: ICE BAML Core Eurozone Government Bond Index (Customized); 12%: Bloomberg Barclays Capital Asset Backed Securities Fixed Rate Euro Index (Customized) and the Bloomberg Barclays Capital Asset Backed Securities Floating Rate Euro Index (Customized); 8%: JP Morgan Emerging Markets Bond Index Global Diversified (Hedged); 7%: Bloomberg Barclays US High Yield 2% Issuer Cap Index (Hedged to Euro); 3%: Bloomberg Barclays Pan-European High Yield (Euro) 3% Issuer Cap Index ex Financials

Kosten³

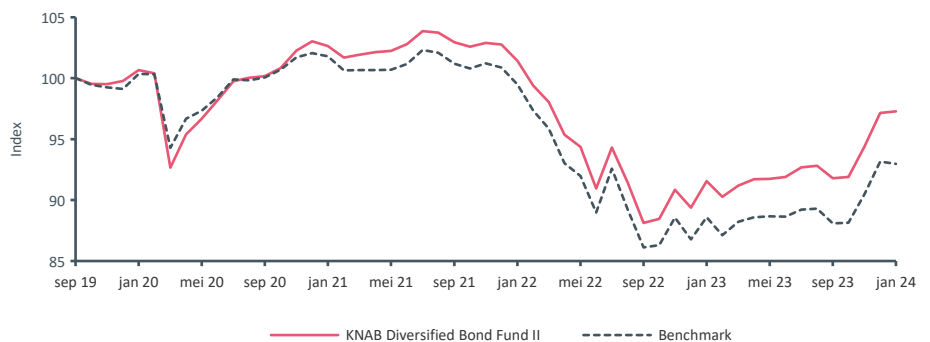
Beheervergoeding	0,17 %
Servicekosten	0,03 %
LKF	0,21 %
Instapkosten	0,23 %
Uitstapkosten	0,23 %

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

Aegon Asset Management past volledige swing pricing (full ADL) toe, wat impliceert dat de NAV van een fonds wordt aangepast met de swing factor bij netto instroom of uitstroom.

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.

Cumulatief rendement



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

Risicofactoren

Duration	4,71
----------	------

¹ Kijk voor de actuele koersinformatie op www.aegon.nl

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 2022.

Jaarrendement en risico

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

12 maanden tot	jan 24	jan 23	jan 22	jan 21	jan 20	jan 19	jan 18	jan 17	jan 16	jan 15
Bruto fondsrendement (%)	6,25	-9,73	-1,17	1,96	-	-	-	-	-	-
Netto fondsrendement (%)	6,04	-9,91	-1,35	1,79	-	-	-	-	-	-
Benchmark (%)	4,95	-10,95	-2,28	1,45	-	-	-	-	-	-
Tracking error ex post (%)	0,58	0,99	0,37	2,24	-	-	-	-	-	-
Information ratio	1,78	1,18	2,58	0,15	-	-	-	-	-	-

Sectorverdeling (%)

Staatsobligaties	23,8
Financiële instellingen	22,5
ABS	12,3
Overheid Gerelateerd	6,9
Cyclische Goederen	6,8
Industrie	6,8
Telecommunicatie	6,5
Niet-cyclische Goederen	6,3
Overige	7,1
Liquiditeiten	0,9

10 grootste belangen (%)

France (Govt Of) 5.500% 25/04/2029	0,8
Bundesrepub. Deutschland 1.000% 15/08/2025	0,8
Bundesobligation 1.300% 15/10/2027	0,8
France (Govt Of) 5.750% 25/10/2032	0,7
Bundesrepub. Deutschland 0.000% 15/08/2026	0,7
France (Govt Of) 0.250% 25/11/2026	0,7
Bundesrepub. Deutschland 0.000% 15/08/2031	0,6
France (Govt Of) 1.500% 25/05/2031	0,6
Bundesrepub. Deutschland 4.750% 04/07/2028	0,6
Bundesrepub. Deutschland 0.000% 15/08/2030	0,6

Valutaverdeling (%)

	Pre hedge	Post hedge
EUR	79,1	100,0
USD	16,3	-0,3
GBP	4,3	0,0
Overige	0,3	0,3
Totaal	100,0	100,0

Asset allocatie (%)

Europese IG obligaties	41,5
Core Eurozone obligaties	23,6
Europese ABS	13,6
US high yield	9,1
Schuld opkomend landen	7,6
Europese high yield	4,5
Liquiditeiten	-0,0

Ratingverdeling (%)

AAA	19,0
AA	15,3
A	22,4
BBB	25,4
BB	8,4
B	7,0
CCC	1,3
CC	0,2
Overige	0,2
Liquiditeiten	0,9

Landenverdeling (%)

Verenigde Staten v Amerika	18,4
Frankrijk	17,7
Duitsland	15,5
Verenigd Koninkrijk	10,5
Nederland	7,8
Mixed	3,5
België	2,8
Zwitserland	2,4
Overige	20,5
Liquiditeiten	0,9

Looptijdverdeling (%)

0 - 1 jaar	5,9
1 - 3 jaar	23,5
3 - 5 jaar	23,2
5 - 7 jaar	18,6
7 - 10 jaar	17,1
10+ jaar	10,8
Liquiditeiten	0,9

Voor professionele en particuliere beleggers. Het kapitaal loopt risico.

Het grootste risico van dit product is het verlies van kapitaal. Raadpleeg het Essentiële Beleggersinformatie en/of het prospectus of de aanbiedingsdocumenten voor nadere informatie over alle relevante risico's. Vraag deze aan en lees ze alvorens het product te kopen. Deze documenten zijn beschikbaar op onze website: aegonam.com/documents. Indien u, als niet-professionele belegger, obligaties met financiële gevolgen op basis van de gegevens wilt aangaan, raden wij u aan contact op te nemen met een tussenpersoon, hypotheekadviseur of fiscaal jurist.

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 fonds is een compartiment van AEGON Paraplufonds Fund I, een Nederlands particulier AIF. Het (de) doelfonds(en) van deze marketing/dit document wordt (worden) beheerd door Aegon Investment Management B.V.

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.

Dit fonds wordt ook aangeboden onder de naam Aegon Diversified Bond Fund II.

Dit rapport is gebaseerd op het zogenaamde doorkijkprincipe. In andere woorden, door door de Beleggingsfondsen heen te kijken, wordt volledig inzicht verkregen in de posities van de effecten. Via Aegon Investment Management B.V. kunt u ook direct of indirect beleggen in fondsen die niet worden beheerd door Aegon Investment Management B.V. We willen u erop wijzen dat de fondsen die niet worden beheerd door Aegon Investment Management B.V. niet zijn opgenomen in de doorkijkrapporten. Daarom kunnen we geen volledige doorkijk bieden. Als gevolg daarvan kunnen we u mogelijk niet volledig inzicht bieden in de risico's van uw beleggingen op basis van deze rapporten. Raadpleeg onze website voor een woordenlijst en het prospectus.