



Fondsprofiel

Zwitserleven Medium Duration Fonds belegt in euro's genoteerde obligaties, geldmarktinstrumenten, geldmarktfondsen en in rentederivaten, waarbij minimale ratings per beleggingsinstrument zijn vastgelegd. De gemiddelde rating van de portefeuille is minimaal AA-. Het fonds heeft duurzame karakteristieken en beoogt bij te dragen aan lange termijn duurzaamheidsdoelstellingen op het gebied van milieu en sociale ontwikkeling en goed ondernemerschap. Het fonds heeft als beleggingsdoel om met een beperkt kredietrisico, te streven naar het matchen van een cashflowoverzicht dat gebaseerd is op de gemiddelde verplichtingenkant van separate accounts van Zwitserleven.

Rendement en risico karakteristieken

	Fonds
Standaard deviatie 36m	6,78%
Sharpe ratio 36m	-1,18
Effectief rendement	3,13%
Gemiddelde rating	AA+
Modified Duration	7,83
Green Bonds ²	13,10%

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds
1 maand	-2,49%
3 maanden	-4,07%
12 maanden	-16,48%
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-7,71%
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-2,61%
2023	-0,32%

	2018	2019	2020	2021	2022
Fonds	2,18%	4,36%	3,39%	-3,28%	-18,59%

Geïndexeerd rendementsverloop



Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd
(in jaren)

	Bonds	Swaps	Futures	Totaal
0 - 5	0,83	-0,08	0,00	0,75
5 - 10	2,26	0,38	0,00	2,64
10 - 15	2,56	1,87	0,00	4,44
	5,65	2,17	0,00	7,83

Kerngegevens per 28 februari 2023

Beleggingsinstelling	Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen
Valuta van notering	Euro
Oprichtingsdatum	15-11-2012
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Lopende kostenfactor	0,040% (2022)
Beschikbaar via	Verzekeringsproduct Zwitserleven

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	25,18
Hoogste koers 12 maanden	30,64
Laagste koers 12 maanden	25,18
Fondsomvang	308.602.576
Uitstaande participaties	12.254.433
SFDR classificatie	8

Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)*



* Klik op de symbolen voor meer informatie

Duurzaamheid en Impact



Dit fonds heeft duurzame karakteristieken zonder meetbare doelstelling

Instrumenten ESG-beleid (*Klik op de symbolen voor meer informatie)



Debiteuren / ratings

Debiteuren (vijf grootste)	Ratings
Nederland	23,08% AAA 66,8%
Duitsland	22,16% AA 32,5%
Frankrijk	21,05% Overig 0,8%
Oostenrijk	13,79%
Bayerische Landesbodenk	5,22%

Grootste belangen

Bundesrepub. Deutschland 2%	15082023	7,8%
France (Govt Of) 1.5%	25052031	6,7%
France (Govt Of) 4.25%	25102023	6,6%
Bayerische Landesboden 1.75%	24042024	4,8%
Netherlands Government 0.75%	15072027	4,6%
Netherlands Government 5.5%	15012028	4,3%
Republic Of Austria 4.85%	15032026	4,1%
France (Govt Of) 1.25%	25052034	3,6%
Bundesrepub. Deutschland 4.75%	04072028	3,3%
Republic Of Austria 0.25%	20102036	3,2%