



#### Fondsprofiel

Zwitserleven Long 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.

#### Kerngegevens per 31 maart 2021

Beleggingsinstelling	Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen
Valuta van notering	Euro
Oprichtingsdatum	15-11-2012
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Lopende kostenfactor	0,040% (2020)
Beschikbaar via	Verzekeringsproduct Zwitserleven

#### Rendement en risico karakteristieken

	Fonds
Standaard deviatie 36m	11,55%
Sharpe ratio 36m	0,72
Effectief rendement	0,33%
Gemiddelde rating	AAA
Modified Duration	22,80
Green Bonds	10,57%

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds				
1 maand	-1,51%				
3 maanden	-9,09%				
12 maanden	-3,25%				
3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	8,14%				
5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	4,13%				
2021	-9,09%				
	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds	13,42%	-3,36%	6,38%	16,75%	13,73%

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	46,04
Hoogste koers 12 maanden	51,32
Laagste koers 12 maanden	45,73
Fondsomvang	1.130.603.831
Uitstaande participaties	24.559.349

#### Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)\*

Mensen rechten

Fundamentele arbeids rechten

Wapens

Sancties

Corruptie

Klant & product integriteit

Milieu

\* Klik op de symbolen voor meer informatie

#### Duurzaamheid en Impact

ESG-score ⓘ

CO2-uitstoot ⓘ

Waterverbruik ⓘ

Dit fonds heeft duurzame karakteristieken zonder meetbare doelstelling

#### Geïndexeerd rendementsverloop



#### Instrumenten ESG-beleid

(\*Klik op de symbolen voor meer informatie)



#### Debiteuren / ratings

Debiteuren (vijf grootste)		Ratings	
Nederland	36,34%	AAA	71,5%
Duitsland	31,86%	AA	27,1%
Frankrijk	15,81%	Overig	1,4%
Oostenrijk	10,90%		
Swaps	1,41%		

#### Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,11	-0,29	-0,19
10 - 15	0,13	-0,14	-0,01
15 - 20	2,32	3,67	5,99
20 - 25	5,40	2,48	7,88
25 - 35	8,09	1,04	9,13
Totaal	16,05	6,75	22,80

#### Grootste belangen

Bundesrepub. Deutschland 2.5% 15082046	13,0%
Netherlands Government 0% 15012022	8,5%
Bundesrepub. Deutschland 0% 04072042	8,4%
Netherlands Government 2.75% 15012047	7,7%
Netherlands Government 3.75% 15012042	7,4%
Bundesrepub. Deutschland 1.25% 15082048	5,3%
France (Govt Of) 2% 25052048	4,5%
Bundesrepub. Deutschland 2.5% 04072044	4,0%
Republic Of Austria 4.15% 15032037	3,8%
Netherlands Government 0.5% 15012040	3,6%