



#### 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.

#### 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 | 3,54%  |
| Sharpe ratio 36m       | 0,75   |
| Effectief rendement    | -0,14% |
| Gemiddelde rating      | AAA    |
| Modified Duration      | 8,59   |
| Green Bonds            | 1,73%  |

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

|                                      | Fonds  |        |       |       |       |
|--------------------------------------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 1 maand                              | 0,07%  |        |       |       |       |
| 3 maanden                            | -2,26% |        |       |       |       |
| 12 maanden                           | -0,57% |        |       |       |       |
| 3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | 2,48%  |        |       |       |       |
| 5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | 1,39%  |        |       |       |       |
| 2021                                 | -2,26% |        |       |       |       |
|                                      | 2016   | 2017   | 2018  | 2019  | 2020  |
| Fonds                                | 3,89%  | -0,71% | 2,18% | 4,36% | 3,39% |

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

|                                 |             |
|---------------------------------|-------------|
| Intrinsieke waarde ultimo maand | 31,36       |
| Hoogste koers 12 maanden        | 32,23       |
| Laagste koers 12 maanden        | 31,19       |
| Fondsomvang                     | 495.513.194 |
| Uitstaande participaties        | 15.803.038  |

#### 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 <sup>①</sup>

CO2-uitstoot <sup>①</sup>

Waterverbruik <sup>①</sup>

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 |       |
|----------------------------|--------|---------|-------|
| Duitsland                  | 35,02% | AAA     | 73,6% |
| Nederland                  | 31,79% | AA      | 23,6% |
| Frankrijk                  | 14,87% | Overig  | 2,8%  |
| Oostenrijk                 | 8,60%  |         |       |
| Bayerische Landesbodenkr   | 3,26%  |         |       |

#### Rentegevoeligheidscontributie

| Looptijd (in jaren) | Rentegevoeligheidscontributie |       |        |
|---------------------|-------------------------------|-------|--------|
|                     | Bonds                         | Swaps | Totaal |
| 0 - 5               | 0,82                          | -0,06 | 0,75   |
| 5 - 10              | 2,46                          | 0,22  | 2,69   |
| 10 - 15             | 3,38                          | 1,77  | 5,15   |
| Totaal              | 6,66                          | 1,93  | 8,59   |

#### Grootste belangen

|  |      |
|--|------|
| Netherlands Government 2.5% 15012033   | 9,5% |
| Netherlands Government 2.25% 15072022  | 7,5% |
| Bundesrepub. Deutschland 5.5% 04012031 | 6,5% |
| Bundesobligation 0% 18102024           | 6,4% |
| Republic Of Austria 0.75% 20102026     | 6,2% |
| Bundesrepub. Deutschland 0% 15052035   | 6,0% |
| Bundesrepub. Deutschland 0% 15082029   | 5,5% |
| France (Govt Of) 1.5% 25052031         | 5,2% |
| French Discount T-Bill 0% 08092021     | 5,1% |
| Netherlands Government 5.5% 15012028   | 4,5% |