



Fondsprofiel

Zwitserleven Ultra 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 mini maal 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	20,75%
Sharpe ratio 36m	0,69
Effectief rendement	0,46%
Gemiddelde rating	AA+
Modified Duration	38,75
Green Bonds	0,83%

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds
1 maand	-3,46%
3 maanden	-17,23%
12 maanden	-9,54%
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	14,14%
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	5,84%
2021	-17,23%
	2016 2017 2018 2019 2020
Fonds	19,87% -8,63% 9,46% 32,96% 27,65%

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	63,10
Hoogste koers 12 maanden	77,96
Laagste koers 12 maanden	62,25
Fondsomvang	253.320.057
Uitstaande participaties	4.014.289

Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)*



* 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)



Screening voor in-/uitsluiting

Debiteuren / ratings

Debiteuren (vijf grootste)		Ratings	
Duitsland	34,46%	AAA	67,5%
Nederland	30,54%	AA	30,6%
Frankrijk	18,04%	Overig	1,8%
Oostenrijk	13,08%		
European Investment Bank	2,76%		

Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,14	-0,26	-0,12
15 - 20	0,15	-0,18	-0,03
20 - 25	6,62	-6,72	-0,10
25 - 35	5,56	7,79	13,35
35+	6,70	18,95	25,64
Totaal	19,16	19,58	38,75

Grootste belangen

Bundesrepub. Deutschland 0%	04072042	15,0%
Netherlands Government 0%	15012022	14,7%
Republic Of Austria 3,8%	26012062	12,6%
Bundesrepub. Deutschland 2,5%	04072044	9,9%
France (Govt Of) 1,75%	25052066	6,8%
France Oat Fungible Strp 0%	25042055	6,5%
Netherlands Government 0%	15012052	6,3%
Bundesrepub. Deutschland 0%	04072044	5,7%
France (Govt Of) 4%	25042060	4,0%
Dutch Treasury Cert 0%	30082021	4,0%