



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 mei 2022

Beleggingsinstelling	Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen
Valuta van notering	Euro
Oprichtingsdatum	15-11-2012
Fondsbeheerder	ACTIAM N.V.
Land van vestiging	Nederland
Lopende kostenfactor	0,040% (2021)
Beschikbaar via	Verzekeringsproduct Zwitserleven

Rendement en risico karakteristieken

	Fonds
Standaard deviatie 36m	4,62%
Sharpe ratio 36m	-0,68
Effectief rendement	1,49%
Gemiddelde rating	AAA
Modified Duration	7,84
Green Bonds	4,73%

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds				
1 maand	-1,26%				
3 maanden	-7,79%				
12 maanden	-10,65%				
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-3,43%				
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-0,97%				
2022	-10,41%				
	2017	2018	2019	2020	2021
Fonds	-0,71%	2,18%	4,36%	3,39%	-3,28%

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	27,80
Hoogste koers 12 maanden	31,90
Laagste koers 12 maanden	27,68
Fondsomvang	454.519.635
Uitstaande participaties	16.349.196
SFDR classificatie	8

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

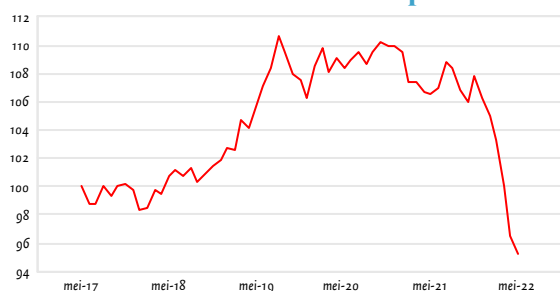
ESG-score

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	
Duitsland	32,54%	AAA	73,3%
Nederland	31,52%	AA	25,3%
Oostenrijk	14,44%	Overig	1,4%
Frankrijk	11,64%		
European Investment Bank	3,54%		

Grootste belangen

Netherlands Government 2.25% 15072022	9,5%
Netherlands Government 2.5% 15012033	8,3%
France (Govt Of) 1.5% 25052031	7,3%
Netherlands Government 0% 15012024	7,0%
Bundesrepub. Deutschland 4.75% 04072034	6,8%
Bundesobligation 0% 18102024	6,7%
Republic Of Austria 4.85% 15032026	5,5%
Republic Of Austria 0% 20092022	4,4%
Bundesrepub. Deutschland 4.75% 04072028	3,9%
Bundesrepub. Deutschland 0% 15082029	3,9%

Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,75	-0,02	0,73
5 - 10	2,07	0,42	2,49
10 - 15	2,70	1,92	4,61
Totaal	5,52	2,32	7,84