



Fondsprofiel

Zwitslerleven 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 Zwitslerleven.

Kerngegevens per 31 oktober 2022

Beleggingsinstelling	Zwitslerleven 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 Zwitslerleven

Rendement en risico karakteristieken

	Fonds
Standaard deviatie 36m	6,32%
Sharpe ratio 36m	-1,04
Effectief rendement	2,66%
Gemiddelde rating	AAA
Modified Duration	7,33
Green Bonds	11,50%

Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds
1 maand	0,09%
3 maanden	-9,42%
12 maanden	-16,86%
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-6,56%
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	-2,51%
2022	-17,11%
	2017 2018 2019 2020 2021
Fonds	-0,71% 2,18% 4,36% 3,39% -3,28%

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	25,72
Hoogste koers 12 maanden	31,54
Laagste koers 12 maanden	25,23
Fondsvomvang	410.790.740
Uitstaande participaties	15.971.600
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

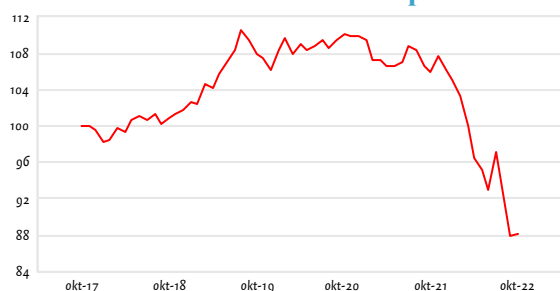
ESG-score

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	28,92%	AAA	71,3%
Nederland	25,02%	AA	26,3%
Frankrijk	12,08%	Overig	2,4%
Oostenrijk	10,37%		
Austria Treasury Bill	5,17%		

Grootste belangen

Netherlands Government 2.5% 15012033	8,4%
Netherlands Government 0% 15012024	7,6%
France (Govt Of) 1.5% 25052031	7,5%
Bundesobligation 0% 18102024	7,3%
Republic Of Austria 4.85% 15032026	5,9%
Austrian T-Bill 0% 26012023	4,8%
Bundesrepub. Deutschland 0% 15082029	4,0%
Bundesrepub. Deutschland 4.75% 04072028	3,9%
France (Govt Of) 1.25% 25052034	3,8%
Netherlands Government 5.5% 15012028	3,7%

Rentegevoelighedscontributie

Looptijd (in jaren)	Bonds	Swaps	Futures	Totaal
0 - 5	0,73	-0,03	0,00	0,70
5 - 10	2,34	0,02	0,00	2,35
10 - 15	2,53	1,75	0,00	4,28
	5,60	1,74	0,00	7,33