



#### 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 oktober 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	3,71%
Sharpe ratio 36m	0,52
Effectief rendement	0,04%
Gemiddelde rating	AAA
Modified Duration	7,96
Green Bonds	3,81%

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds				
1 maand	-0,72%				
3 maanden	-2,64%				
12 maanden	-3,87%				
3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	1,64%				
5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	0,93%				
2021	-3,57%				
	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds	3,89%	-0,71%	2,18%	4,36%	3,39%

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	30,94
Hoogste koers 12 maanden	32,23
Laagste koers 12 maanden	30,92
Fondsomvang	508.832.131
Uitstaande participaties	16.447.715
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

Waternutrisie

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	35,55%	AAA	73,1%
Nederland	27,70%	AA	25,6%
Oostenrijk	14,12%	Overig	1,3%
Frankrijk	11,42%		
European Investment Bank	3,30%		

#### Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,92	-0,05	0,88
5 - 10	2,18	0,00	2,18
10 - 15	3,36	1,55	4,91
Totaal	6,46	1,51	7,96

#### Grootste belangen

Netherlands Government 2.25% 15072022	9,8%
Netherlands Government 2.5% 15012033	8,8%
Bundesrepub. Deutschland 4.75% 04072034	7,6%
Bundesobligation 0% 18102024	6,2%
Bundesrepub. Deutschland 0% 15052035	5,8%
Republic Of Austria 0.75% 20102026	5,3%
Bundesrepub. Deutschland 0% 15082029	5,3%
France (Govt Of) 1.5% 25052031	5,1%
Netherlands Government 5.5% 15012028	4,4%
France (Govt Of) 1.25% 25052034	4,0%