



#### Fondsprofiel

Zwitserleven Long Duration Fonds belegt in euro's genoteerde obligaties, geldmarktinstrumenten, geldmarktfondsen en in rentederivaten. De leningen van overheden wordt door kredietbeoordelaar Standard & Poor's, Moody's of Fitch gewaardeerd met gemiddeld min imaal AA-. Leningen en geldmarktinstrumenten van lagere en regionale overheden en supranationale organisaties dienen een minimale rating van AAA te hebben. Geldmarktinstrumenten van ondernemingen met een minimale rating van AA- zijn beperkt toegestaan. 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.

#### Rendement en risico karakteristieken

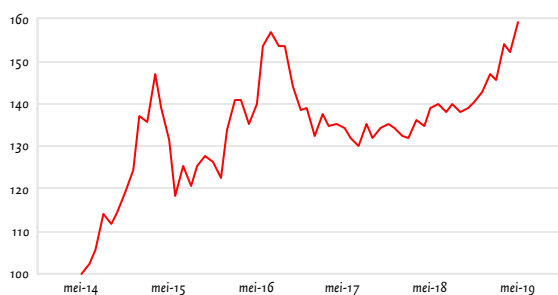
|                        |        |
|------------------------|--------|
| Standaard deviatie 36m | 10,37% |
| Sharpe ratio 36m       | 0,39   |
| Effectief rendement    | 0,64%  |
| Gemiddelde rating      | AAA    |

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

|                                      | Fonds  |
|--------------------------------------|--------|
| 1 maand                              | 4,67%  |
| 3 maanden                            | 9,46%  |
| 12 maanden                           | 14,63% |
| 3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | 4,34%  |
| 5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | 9,74%  |
| 2019                                 | 11,42% |

|       | 2014   | 2015   | 2016   | 2017   | 2018  |
|-------|--------|--------|--------|--------|-------|
| Fonds | 42,37% | -1,45% | 13,42% | -3,36% | 6,38% |

#### Geïndexeerd rendementsverloop



#### Rentegevoeligheidscontributie

| Looptijd (in jaren) | Rentegevoeligheidscontributie |       |        |
|---------------------|-------------------------------|-------|--------|
|                     | Bonds                         | Swaps | Totaal |
| 0 - 5               | 0,16                          | -0,18 | -0,02  |
| 15 - 20             | 1,79                          | 3,69  | 5,48   |
| 20 - 25             | 4,95                          | 3,27  | 8,22   |
| 25 - 35             | 7,32                          | 1,38  | 8,70   |
| Totaal              | 14,23                         | 8,16  | 22,38  |

#### Kerngegevens per 31 mei 2019

|                      |   |
|----------------------|---|
| Beleggingsinstelling | Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen |
| Valuta van notering  | Euro  |
| Oprichtingsdatum     | 15-11-2012                                    |
| Fondsbeheerder       | ACTIAM N.V.                                   |
| Land van vestiging   | Nederland                                     |
| Lopende kostenfactor | 0,040% (2018)                                 |
| Beschikbaar via      | Verzekeringsproduct Zwitserleven              |

#### Duratie portefeuille

|                   |       |
|-------------------|-------|
| Modified Duration | 22,38 |
|-------------------|-------|

#### Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)

Ondernemingen, overheden en instellingen worden beoordeeld op naleving van milieu, maatschappelijke en bestuurlijke prestaties: rechten van de mens, fundamentele arbeidsrechten, corruptie, het milieu, wapens, dierenwelzijn, klant- en productintegriteit. Schending van de beginselen kunnen leiden tot uitsluiting.

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

|                                 |       |
|---------------------------------|-------|
| Intrinsieke waarde ultimo maand | 42,49 |
| Hoogste koers 12 maanden        | 42,49 |
| Laagste koers 12 maanden        | 36,02 |

|                          |             |
|--------------------------|-------------|
| Fondsomvang              | 997.924.719 |
| Uitstaande participaties | 23.484.008  |

#### Debiteuren / ratings

##### Debiteuren (vijf grootste)

|            |        |
|------------|--------|
| Nederland  | 37,81% |
| Duitsland  | 35,71% |
| Frankrijk  | 12,45% |
| Oostenrijk | 7,57%  |
| BlackRock  | 3,44%  |

##### Ratings

|        |       |
|--------|-------|
| AAA    | 75,9% |
| AA     | 20,5% |
| Overig | 3,6%  |