



Fondsprofiel

Zwitserleven 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 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 augustus 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	11,86%
Sharpe ratio 36m	0,73
Effectief rendement	0,18%
Gemiddelde rating	AAA
Modified Duration	22,49
Green Bonds	10,47%

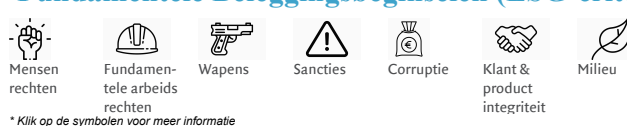
Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds				
1 maand	-1,17%				
3 maanden	5,81%				
12 maanden	-1,40%				
3 jaar, geannualiseerd ¹⁾	8,43%				
5 jaar, geannualiseerd ¹⁾	3,05%				
2021	-5,91%				
	2016	2017	2018	2019	2020
Fonds	13,42%	-3,36%	6,38%	16,75%	13,73%

Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	47,65
Hoogste koers 12 maanden	51,32
Laagste koers 12 maanden	44,17
Fondsomvang	1.270.708.886
Uitstaande participaties	26.668.264

Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)*



* Klik op de symbolen voor meer informatie

Duurzaamheid en Impact



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	33,17%	AAA	69,4%
Nederland	32,67%	AA	29,1%
Frankrijk	17,18%	Overig	1,5%
Oostenrijk	11,24%		
Swaps	2,26%		

Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,12	-0,23	-0,11
10 - 15	0,11	-0,12	-0,01
15 - 20	2,49	3,27	5,76
20 - 25	5,46	2,27	7,73
25 - 35	9,12	0,00	9,12
Totaal	17,31	5,18	22,49

Grootste belangen

Bundesrepub. Deutschland 0%	15082050	8,1%
Bundesrepub. Deutschland 0%	04072042	7,8%
Netherlands Government 0%	15012052	7,6%
Netherlands Government 0%	15012022	7,5%
Netherlands Government 2.75%	15012047	7,1%
Netherlands Government 3.75%	15012042	6,8%
Bundesrepub. Deutschland 1.25%	15082048	6,2%
Bundesrepub. Deutschland 2.5%	04072044	5,8%
Netherlands Government 0.5%	15012040	4,0%
France (Govt Of) 2%	25052048	4,0%