



#### Fondsprofiel

Zwitserleven Ultra 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 mini maal 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.

#### Rendement en risico karakteristieken

	Fonds
Standaard deviatie 36m	22,74%
Sharpe ratio 36m	0,56
Effectief rendement	0,40%
Gemiddelde rating	AA+
Modified Duration	38,19
Green Bonds	0,92%

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

	Fonds
1 maand	-8,65%
3 maanden	1,66%
12 maanden	-16,12%
3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	12,50%
5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup>	7,32%
2021	-16,12%
	2016 2017 2018 2019 2020
Fonds	19,87% -8,63% 9,46% 32,96% 27,65%

#### Geïndexeerd rendementsverloop



#### Rentegevoeligheidscontributie

Looptijd (in jaren)	Rentegevoeligheidscontributie		
	Bonds	Swaps	Totaal
0 - 5	0,01	-0,19	-0,17
15 - 20	0,45	-0,45	0,00
20 - 25	6,90	-6,97	-0,07
25 - 35	6,56	6,37	12,93
35+	7,27	18,24	25,51
Totaal	21,19	17,00	38,19

#### Kerngegevens per 31 december 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

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

Intrinsieke waarde ultimo maand	63,95
Hoogste koers 12 maanden	76,81
Laagste koers 12 maanden	59,30
Fondsomvang	223.543.919
Uitstaande participaties	3.495.503
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

#### Instrumenten ESG-beleid

(\*Klik op de symbolen voor meer informatie)



Screening voor in-/uitsluiting

#### Debiteuren / ratings

Debiteuren (vijf grootste)		Ratings	
Duitsland	39,47%	AAA	67,0%
Nederland	21,52%	AA	30,3%
Frankrijk	17,74%	Overig	2,7%
Oostenrijk	12,92%		
European Investment Bank	3,02%		

#### Grootste belangen

Bundesrepub. Deutschland 0%	04072042	16,8%
Republic Of Austria 3.8%	26012062	12,1%
Bundesrepub. Deutschland 2.5%	04072044	10,2%
Netherlands Government 0%	15012022	9,8%
Netherlands Government 0%	15012052	8,0%
France Oat Fungible Strp 0%	25042055	6,9%
Bundesrepub. Deutschland 0%	04072044	6,6%
France (Govt Of) 1.75%	25052066	6,1%
France (Govt Of) 4%	25042060	4,5%
Bundesrepub. Deutschland 1.25%	15082048	3,9%