



#### Fondsprofiel

Zwitserleven Long Duration Fonds belegt zijn vermogen, via de onderliggende beleggingsinstelling Cardano Long Duration Fund, in obligaties, rentederivaten, geldmarktinstrumenten en rechten van deelneming in geldmarktfondsen. Het beleggingsbeleid van het Fonds is gericht op het voeren van een renterisicobeleid dat gebruikt kan worden voor het afdekken van het renterisico op verplichtingen van verzekeringsproducten. 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.

#### Rendement en risico karakteristieken

|                          | Fonds  |
|--------------------------|--------|
| Standaard deviatie 36m   | 20,74% |
| Sharpe ratio 36m         | -0,77  |
| Effectief rendement      | 2,94%  |
| Gemiddelde rating        | AA+    |
| Green Bonds <sup>2</sup> | 33,48% |
| Modified Duration        | 21,84  |

#### Rendement op basis van intrinsieke waarde

|                                      | Fonds   |
|--------------------------------------|---------|
| 1 maand                              | 0,63%   |
| 3 maanden                            | -5,24%  |
| 12 maanden                           | -0,37%  |
| 3 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | -14,48% |
| 5 jaar, geannualiseerd <sup>1)</sup> | -8,44%  |
| 2024                                 | -6,28%  |

|       | 2019   | 2020   | 2021   | 2022    | 2023  |
|-------|--------|--------|--------|---------|-------|
| Fonds | 16,75% | 13,73% | -8,95% | -39,16% | 8,73% |

#### Geïndexeerd rendementsverloop



#### Rentegevoeligheidscontributie

##### Looptijd

(in jaren)

|         | Bonds | Swaps | Futures | Totaal |
|---------|-------|-------|---------|--------|
| 0 - 5   | 0,32  | -0,98 | -0,54   | -1,19  |
| 5 - 10  | 0,27  | 0,35  | 0,00    | 0,62   |
| 10 - 15 | 0,72  | -1,48 | 0,00    | -0,77  |
| 15 - 20 | 4,52  | 2,85  | 0,00    | 7,36   |
| 20 - 25 | 3,56  | 2,32  | 0,00    | 5,88   |
| 25 - 35 | 6,22  | 4,88  | 0,00    | 11,10  |
|         | 15,60 | 7,93  | -0,54   | 23,00  |

#### Kerngegevens per 30 juni 2024

|                           |   |
|---------------------------|---|
| Beleggingsinstelling      | Zwitserleven Institutionele Beleggingsfondsen |
| Valuta van notering       | Euro  |
| Oprichtingsdatum          | 15-11-2012                                    |
| Fondsbeheerder            | Cardano Asset Management N.V.                 |
| Land van vestiging        | Nederland                                     |
| Lopende kostenfactor      | 0,040% (2023)                                 |
| Beschikbaar via Benchmark | Verzekeringsproduct Zwitserleven              |

#### Koersen (euro) en fondsfeiten

|                                 |             |
|---------------------------------|-------------|
| Intrinsieke waarde ultimo maand | 28,59       |
| Hoogste koers 12 maanden        | 31,35       |
| Laagste koers 12 maanden        | 24,73       |
| Fondsomvang                     | 892.279.425 |
| Uitstaande participaties        | 31.214.666  |
| SFDR classificatie              | 8           |

#### Fundamentele Beleggingsbeginselen (ESG-criteria)



#### Duurzaamheid en Impact



ESG-score



CO2-uitstoot



Waterverbruik

Dit fonds heeft duurzame karakteristieken zonder meetbare doelstelling

#### Instrumenten ESG-beleid



#### Debiteuren / ratings

##### Debiteuren (vijf grootste)

|                          |        |
|--------------------------|--------|
| Duitsland                | 30,74% |
| Nederland                | 23,62% |
| Frankrijk                | 19,91% |
| Oostenrijk               | 11,12% |
| International Developmen | 4,93%  |

##### Ratings

|        |       |
|--------|-------|
| AAA    | 53,0% |
| AA     | 44,2% |
| Overig | 2,7%  |

#### Grootste belangen

|                               |          |      |
|-------------------------------|----------|------|
| Bundesrepub. Deutschland 1.8% | 15082053 | 8,3% |
| Netherlands Government 3.25%  | 15012044 | 6,7% |
| Bundesrepub. Deutschland 0%   | 04072042 | 6,0% |
| Netherlands Government 0%     | 15012052 | 4,5% |
| France (Govt Of) 0.5%         | 25062044 | 4,2% |
| Br Ics-Euro Liq-Prem Acc To   |          | 4,0% |
| Republic Of Austria 1.85%     | 23052049 | 3,6% |
| Bundesrepub. Deutschland 2.5% | 04072044 | 3,1% |
| Netherlands Government 2.75%  | 15012047 | 3,0% |
| France (Govt Of) 3%           | 25062049 | 2,8% |