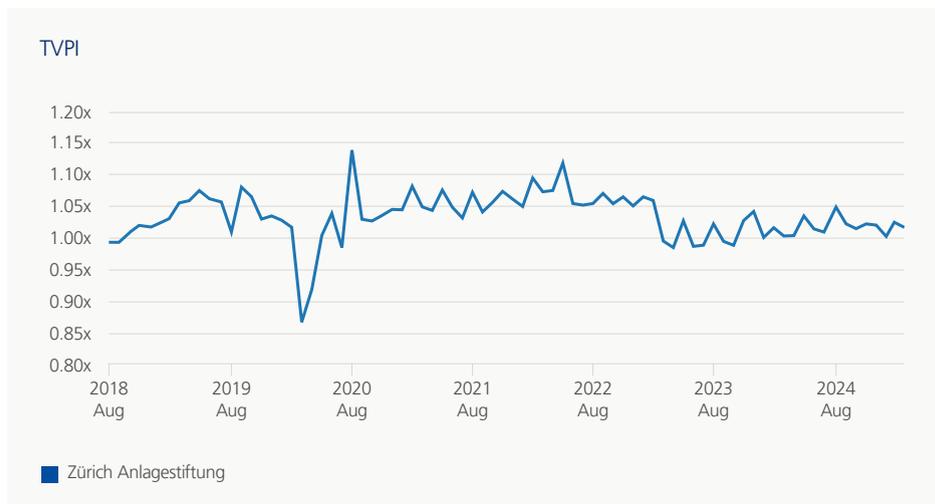


# Insurance Linked Strategies Life I

Die Anlagegruppe bietet Investoren eine attraktive Ergänzung ihrer traditionellen und alternativen Anlagen. Das regulatorische Umfeld ermöglicht attraktive Renditen bei gleichzeitig äusserst vorteilhafter Diversifikationseigenschaften, sogar gegenüber Anlagen in Naturkatastrophen. Der Ausschluss reiner Langlebkeitsrisiken macht ILS Life I zur idealen Anlagelösung für Pensionskassen. Die Anlagegruppe kann die Begrenzung nach den Artikeln 54 und 54a BVV 2 überschreiten und bis zu max. 20% Gegenparteirisiko eingehen. Details zu den aktuellen Überschreitungen sind an separater Stelle ausgewiesen.



## Eckdaten

Asset Manager	Schroders Investment Management
ISIN	CH0376682313
Bloomberg	ZAILSLI SW
Benchmark	Keine Benchmark
Währung	EUR
Risikowährung	Übrige
Inventarwert (NAV/Anteil)	262.20
Verwaltungsgebühr	0,50%
Performancegebühr	0,00%
Hurdle Rate	0,00%
TER (NAV) <sup>4</sup>	0,58%
Finale Schliessung	11.12.2017

Weitere Informationen unter [www.zurichinvest.ch](http://www.zurichinvest.ch)

<sup>4</sup> TER gemäss KGAST: Die Angabe entspricht der Betriebsaufwandquote (Total Expense Ratio) im letzten abgeschlossenen Geschäftsjahr und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

## Währungsexposure (in %)

	<b>Zurich</b>
AUD	70,29
USD	25,19
CHF	3,77
EUR	0,75

## Rendite und Kennzahlen

	Aktuell	Vorheriges Quartal
Kapitalzusagen <sup>3</sup>	181,00	181,00
Einbezahltes Kapital <sup>3</sup>	60,67	60,67
Ausschüttungen <sup>3</sup>	45,07	43,82
Fondsvermögen <sup>3</sup>	16,53	17,99
TVPI <sup>1</sup>	1,02x	1,02x
DPI <sup>2</sup>	0,74x	0,72x
IRR seit Erstausgabe	0,49%	0,62%
Anzahl Zielfonds	5	6
Risiko p.a. (in %)	7,50	7,54
Maximalverlust (in %)	-8,82	-8,82
Erholungsdauer*	3	3

\* Die Erholungsdauer wird in Anzahl Monaten ausgewiesen

<sup>1</sup> TVPI: Total value to paid-in oder Gesamtwert inkl. Ausschüttungen im Verhältnis zum einbezahlten Kapital

<sup>2</sup> DPI: Distributed to paid-in oder Ausschüttungen im Verhältnis zum einbezahlten Kapital

<sup>3</sup> Kapitalzusagen, einbezahltes Kapital, Ausschüttungen und Net Asset Value in Mio. EUR

## Risikotypen

	<b>Zürich</b>
In-Force-Finanzierung	100,00

## Gegenparteien grösser 10% (vs. Einbezahltes Kapital)

**Zürich**

Länder (in %)



Alle Angaben in diesem Dokument sind mit Sorgfalt und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt worden. Zurich Invest AG und die Zürich Anlagestiftung übernehmen keine Verantwortung hinsichtlich deren Richtigkeit und Vollständigkeit und lehnen jede Haftung für Verluste ab, die sich aus der Verwendung dieser Angaben ergeben. Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Das Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken und der Nutzung durch den Empfänger. Es stellt weder ein Angebot, noch eine Empfehlung zum Erwerb von Finanzprodukten dar und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung bzw. der Beurteilung Dritter. Die Angaben stellen keine Entscheidungshilfe für wirtschaftliche, rechtliche, steuerliche oder andere Beratungen dar. Sämtliche Dokumente, welche die rechtlichen Grundlagen für eine Investition bilden, können bei der Zurich Invest AG resp. Zürich Anlagestiftung kostenlos bezogen werden. Diese Dokumentation darf ohne schriftliche Genehmigung von Zurich Invest AG weder auszugsweise noch vollständig vervielfältigt und/oder weitergeleitet werden.

**Zurich Invest AG/Zürich Anlagestiftung**  
Postfach, CH-8085 Zürich  
Telefon +41 (0)44 628 78 88, Fax +41(0)446291866  
anlagestiftung@zurich.ch, www.zurichinvest.ch