

# Aktien Schweiz Passiv

Aktien sind ein wichtiger Bestandteil einer erfolgreichen Vermögensanlage. Dank ihres Potenzials, Kapitalgewinne zu erzielen, können sie zu attraktiven Portfoliorenditen beitragen. Die Chance, mit Aktien höhere Erträge zu erzielen, ist allerdings auch mit grösseren Risiken verbunden.

### Ihre Vorteile auf einen Blick

- Baustein zur flexiblen Umsetzung der Anlagestrategie einer Vorsorgeeinrichtung
- Breit diversifizierte und transparente Anlagen
- Unabhängiger Anlagemanagement-Prozess, der höchste Compliance-Ansprüche erfüllt
- Attraktive Konditionen

### Anlageuniversum

Die Anlagegruppe investiert in Beteiligungspapiere und -rechte, welche Bestandteil des Swiss Performance Index (SPI) sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen.

### Anlageprozess

Risikokontrolle

- Optimale Indexreplizierung
- Proprietäre Indexierungs- und Risikosysteme
- Kein Gegenparteirisiko durch effektive Aktienkäufe und keine Ausleihung der Wertschriften
- Unabhängige Überwachung und Überprüfung

Mehrwert

- Intelligenter Handel bei Indexänderungen
- Wertmaximierung in "corporate events"
- Minimierung der Transaktionskosten

Stratified Sampling Methode für Small Cap Segment (Full Replication für Large & Midcap)

- Portfoliooptimierung um den Tracking Error zu minimieren unter Berücksichtigung von Transaktionskosten
- Restriktionen der Einzelwertgewichtungen relativ zum Vergleichsindex

### Manager

UBS AG, Global Asset Management

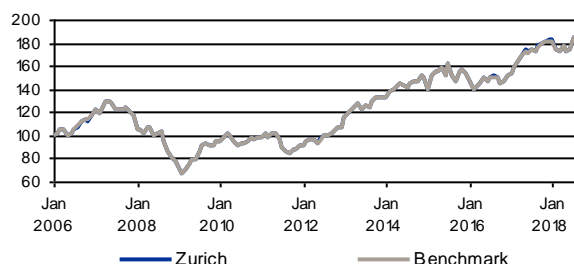
UBS Global Asset Management, ein Unternehmensbereich von UBS AG, ist einer der weltweit führenden Vermögensverwalter und bietet Anlagelösungen für Privatkunden, Finanzintermediäre und institutionelle Anleger auf der ganzen Welt. Mit rund 3500 Mitarbeitern in 25 Ländern ist UBS Global Asset Management ein globales Unternehmen, welches diesen Namen wirklich verdient.

## Aktien Schweiz Passiv

Die Anlagegruppe investiert in Beteiligungspapiere und -rechte, welche Bestandteil des Swiss Performance Index (SPI) sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen.

Angaben per 31.10.2018

### Wertentwicklung (brutto, indiziert)



### Eckdaten

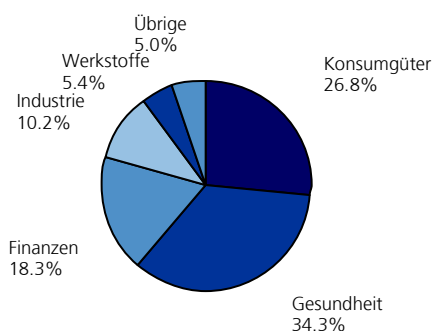
Asset Manager	UBS AG
ISIN	CH0023841551
Bloomberg Ticker	ZAAKTSI SW
Benchmark	SPI
Ausgabe	01.2006
Geschäftsjahr	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Risikowährung	CHF
Vermögen (in Mio.)	259.56
Inventarwert (NAV)	1'783.51
Verwaltungsgebühr	0.20%
TER ( gemäss KGAST)	0.20%
Spread	0.05%
Ausgabe/Rücknahme	Täglich
Anzahl Schuldner	184
Off-BM Positionen	0.00%

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

### Fremdwährungen (in %)

	Zurich
CHF	100.00

### Sektoren (in %)



### Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1.61	-1.59
3 Monate	-2.45	-2.41
Laufjahr	-1.21	-1.08
1 Jahr p.a.	0.13	0.29
5 Jahre p.a.	6.11	6.32
10 Jahre p.a.	7.47	7.74
Seit Ausgabe p.a.	4.43	4.69

### Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	9.46	9.45
5 Jahre p.a.	10.66	10.64
10 Jahre p.a.	11.88	11.91
Seit Ausgabe p.a.	12.54	12.58

### Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0.32	0.34
Beta	1.00	1.00
Tracking Error p.a.	0.09	-
Information Ratio	-2.89	-
Jensen's Alpha (in %)	-0.25	-
Maximalverlust (in %)	95.76	95.48
Erholungsdauer*	56	56

\*) in Monaten

### Grösste Positionen (in %)

	Zurich
Nestle SA	20.03
Novartis AG	16.24
Roche Holding AG	13.21
UBS Group AG	4.17
Zurich Insurance Group AG	3.64

## Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	0.10	0.63	0.64	0.32
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00
Tracking Error p.a.	0.03	0.07	0.09	0.09
Tracking Error Ex Ante	0.02	-	-	-
Information Ratio	-5.55	-2.92	-2.84	-2.89
Jensen's Alpha (in %)	-0.16	-0.22	-0.25	-0.25

## Übersicht Nettoerenditen (in %)

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	YTD
2018	-0.15	-4.47	-0.68	3.26	-3.44	1.59	5.53	-1.47	0.62	-1.61			-1.21
2017	1.07	3.34	2.87	3.63	2.73	-1.19	1.78	-1.30	2.63	1.48	0.65	0.71	19.86
2016	-5.34	-4.22	0.79	3.00	3.73	-2.57	1.93	0.97	-0.39	-3.45	0.50	3.96	-1.62
2015	-6.74	7.97	2.38	0.74	1.84	-4.91	7.16	-6.03	-3.40	5.24	1.04	-1.52	2.45
2014	-0.13	4.19	0.48	1.57	2.66	-1.23	-1.52	2.81	1.49	-0.05	3.45	-1.54	12.64
2013	7.93	3.44	3.10	2.47	0.92	-3.32	2.05	-0.63	3.47	2.83	0.47	-0.40	24.25
2012	1.26	3.15	2.34	-0.35	-4.25	3.22	4.97	-0.22	1.80	1.27	3.05	0.23	17.38
2011	0.39	2.34	-2.72	3.78	0.14	-5.64	-6.52	-5.02	-0.86	4.09	-1.56	4.11	-7.97
2010	-1.01	3.41	4.18	-2.64	-4.85	-2.77	1.44	-0.47	2.34	2.83	-1.80	2.45	2.68
2009	-4.18	-10.10	5.20	8.32	2.78	0.99	9.46	4.57	2.11	-1.10	-0.28	4.37	22.59
2008	-9.96	-0.76	-3.66	5.53	0.57	-7.54	1.87	1.65	-8.25	-9.32	-5.26	-4.44	-34.11

<sup>1</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.

<sup>2</sup> Spread: Abrechnung zu einem festen Ausgabeaufschlag bzw. Rücknahmeabschlag (Verwässerungsschutz der Fondspersormance)

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.