

# 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.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

## Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG
ISIN	CH0023841551
Bloomberg	ZAAKTSI SW
Benchmark	SPI
Erstausgabe	Januar 2006
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	369,60
Inventarwert (NAV/Anteil)	2'380,48
Verwaltungsgebühr	0,12%
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,13%
Ausgabekommission	0,03%
Rücknahmekommission	0,03%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	204
Off-BM Positionen	0,00%

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

## Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1,30	-1,29
3 Monate	0,70	0,73
Laufjahr	4,13	4,14
1 Jahr p.a.	-5,82	-5,72
5 Jahre p.a.	6,69	6,87
10 Jahre p.a.	7,16	7,37
Seit Ausgabe	131,89	141,25
Seit Ausgabe p.a.	5,05	5,29

## Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	15,34	15,32
5 Jahre p.a.	13,24	13,24
10 Jahre p.a.	11,90	11,89
Seit Ausgabe p.a.	12,83	12,85

<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.

## Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,39	0,40
Beta	1,00	1,00
Tracking Error p.a.	0,08	-
Information Ratio	-2,95	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,23	-
Maximalverlust (in %)	-48,92	-48,84
Erholungsdauer*	56	56

\* in Monaten

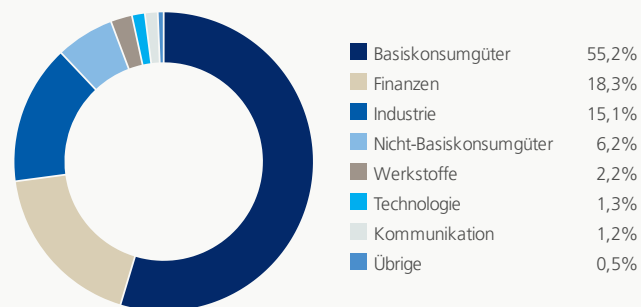
## Grösste Positionen (in %)

	Zurich
Nestle sa	19,00
Roche holding ag	12,94
Novartis ag	11,78
Cie financiere richemont sa	4,81
Zurich insurance group ag	4,37

## Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0,37	0,56	0,65	0,39
Beta	1,00	1,00	1,00	1,00
Tracking Error p.a.	0,05	0,05	0,06	0,08
Tracking Error Ex Ante	0,02	-	-	-
Information Ratio	-1,94	-3,86	-3,43	-2,95
Jensen's Alpha (in %)	-0,10	-0,18	-0,21	-0,23

Sektoren (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