

# Aktien Emerging Markets

Die Anlagegruppe investiert hauptsächlich in eine gut diversifizierte Auswahl von Emerging Markets Aktien und stützt sich dabei auf drei verschiedene Strategien verwaltet durch zwei Asset Manager ab. Dabei darf ein einzelner Titel 5% des NAV nicht überschreiten.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



## Eckdaten

|                           |                                                             |
|---------------------------|-------------------------------------------------------------|
| Asset Manager             | Wellington Management International Ltd, Fisher Investments |
| ISIN                      | CH0022618836                                                |
| Bloomberg                 | ZAAKTEM SV                                                  |
| Benchmark                 | MSCI Emerging Markets (NDUEEGF)                             |
| Erstausgabe               | September 2005                                              |
| Fiskaljahr                | 1.1. - 31.12.                                               |
| Währung                   | CHF                                                         |
| Risikowährung             | Übrige                                                      |
| Vermögen (NAV in Mio.)    | 689,78                                                      |
| Inventarwert (NAV/Anteil) | 1'693.28                                                    |
| Verwaltungsgebühr         | 0,65%                                                       |
| TER (NAV) <sup>1</sup>    | 0,69%                                                       |
| Ausgabespread             | 0,30%                                                       |
| Rücknahmespread           | 0,30%                                                       |
| Ausgabefrequenz           | Täglich                                                     |
| Anzahl Positionen         | 389                                                         |
| Off-BM Positionen         | 8,11%                                                       |

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

## Währungsexposure (in %)

|        | Zürich |
|--------|--------|
| HKD    | 22,28  |
| USD    | 19,71  |
| TWD    | 12,77  |
| INR    | 10,42  |
| Übrige | 34,82  |

## Rendite (netto in %, in CHF)

|                   | Zürich | Benchmark |
|-------------------|--------|-----------|
| 1 Monat           | -0,71  | -1,32     |
| 3 Monate          | 1,36   | 0,49      |
| Laufjahr          | 1,36   | 0,49      |
| 1 Jahr p.a.       | 7,63   | 6,18      |
| 5 Jahre p.a.      | 6,84   | 6,03      |
| 10 Jahre p.a.     | 2,60   | 2,74      |
| Seit Ausgabe      | 69,33  | 81,36     |
| Seit Ausgabe p.a. | 2,74   | 3,10      |

## Volatilität (in %)

|                   | Zürich | Benchmark |
|-------------------|--------|-----------|
| 1 Jahr p.a.       | 9,15   | 9,34      |
| 5 Jahre p.a.      | 15,15  | 14,04     |
| 10 Jahre p.a.     | 15,34  | 14,82     |
| Seit Ausgabe p.a. | 18,16  | 18,17     |

<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

|                       | Zürich | Benchmark |
|-----------------------|--------|-----------|
| Sharpe Ratio          | 0,14   | 0,16      |
| Beta                  | 0,98   | 1,00      |
| Tracking Error p.a.   | 3,11   | -         |
| Information Ratio     | -0,12  | -         |
| Jensen's Alpha (in %) | -0,32  | -         |
| Maximalverlust (in %) | -62,42 | -61,40    |
| Erholungsdauer*       | 144    | 142       |

\* in Monaten

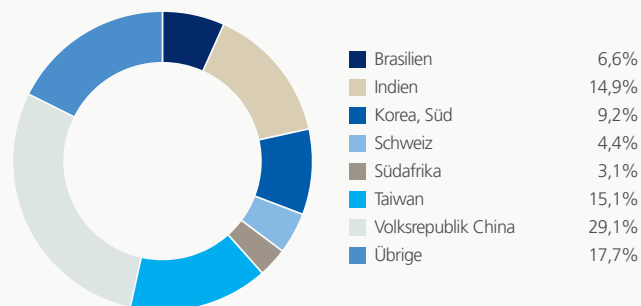
## Grösste Positionen (in %)

|                                           | Zürich |
|-------------------------------------------|--------|
| Taiwan semiconductor manufacturing co ltd | 8,42   |
| Tencent holdings ltd                      | 5,45   |
| Alibaba group holding ltd                 | 3,72   |
| Samsung electronics co ltd                | 2,66   |
| Meituan                                   | 2,33   |

## Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

|                        | 1 Jahr p.a. | 5 Jahre p.a. | 10 Jahre p.a. | Seit Ausgabe p.a. |
|------------------------|-------------|--------------|---------------|-------------------|
| Sharpe Ratio           | 0,71        | 0,44         | 0,19          | 0,14              |
| Beta                   | 0,96        | 1,06         | 1,02          | 0,98              |
| Tracking Error p.a.    | 2,06        | 2,82         | 2,70          | 3,11              |
| Tracking Error Ex Ante | 1,53        | -            | -             | -                 |
| Information Ratio      | 0,70        | 0,29         | -0,05         | -0,12             |
| Jensen's Alpha (in %)  | 1,67        | 0,45         | -0,20         | -0,32             |

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

