

Aktien Emerging Markets 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 MSCI Emerging Markets Index (NR) sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen.

Anlageprozess

Risikokontrolle

- Indexreplizierung mittels „Sampling-Methode“
- Proprietäre Indexierungs- und Risikosysteme
- Unabhängige Überwachung und Überprüfung

Mehrwert

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

Spezialität EMMA

- Investmentrestriktionen in einzelne Länder können effizient mittels Einsatz von Futures umgesetzt werden.

Manager

UBS AG, UBS Asset Management

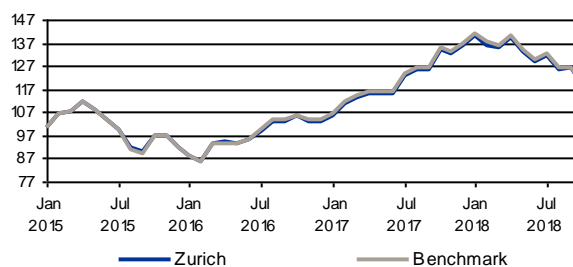
UBS Asset Management, ein Unternehmensbereich von UBS AG, ist einer der weltweit führenden Vermögensverwalter und bietet Anlagelösungen für Privatkunden, Finanzintermediäre und institutionelle Anleger auf der ganzen Welt. Mit rund 3500 Mitarbeitern in 25 Ländern ist UBS Asset Management ein globales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

Aktien Emerging Markets Passiv

Die Anlagegruppe investiert in Beteiligungspapiere und -rechte, welche Bestandteil des MSCI Emerging Markets Index (NR) 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

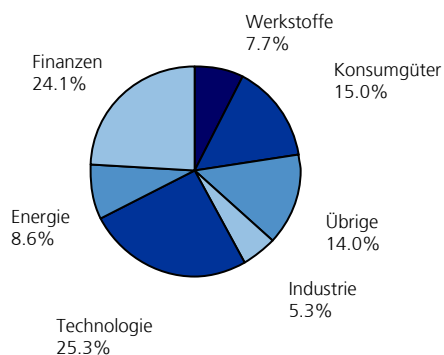
| | |
|---------------------|-----------------------|
| Asset Manager | UBS AG |
| ISIN | CH0260886277 |
| Bloomberg Ticker | ZURAEMP SW |
| Benchmark | MSCI Emerging Markets |
| Ausgabe | 01.2015 |
| Geschäftsjahr | 1.1. - 31.12. |
| Currency | CHF |
| Risikowährung | Übrige |
| Vermögen (in Mio.) | 214.97 |
| Inventarwert (NAV) | 1'223.83 |
| Verwaltungsgebühr | 0.40% |
| TER (gemäss KGASt) | 0.42% |
| Spread | 0.25% |
| Ausgabe/Rücknahme | Täglich |
| Off-BM Positionen | 0.00% |

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Fremdwährungen (in %)

| | Zurich |
|--------|--------|
| HKD | 22.03 |
| KRW | 13.87 |
| TWD | 11.83 |
| USD | 11.53 |
| Übrige | 40.74 |

Sektoren (in %)



Rendite (netto in %, in CHF)

| | Zurich | Benchmark |
|-------------------|--------|-----------|
| 1 Monat | -6.01 | -5.99 |
| 3 Monate | -10.27 | -10.23 |
| Laufjahr | -13.19 | -13.00 |
| 1 Jahr p.a. | -11.93 | -11.71 |
| 5 Jahre p.a. | - | - |
| 10 Jahre p.a. | - | - |
| Seit Ausgabe p.a. | 4.17 | 4.74 |

Volatilität (in %)

| | Zurich | Benchmark |
|-------------------|--------|-----------|
| 1 Jahr p.a. | 11.47 | 11.45 |
| 5 Jahre p.a. | - | - |
| 10 Jahre p.a. | - | - |
| Seit Ausgabe p.a. | 13.47 | 13.47 |

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

| | Zurich | Benchmark |
|-----------------------|--------|-----------|
| Sharpe Ratio | 0.37 | 0.41 |
| Beta | 1.00 | 1.00 |
| Tracking Error p.a. | 0.55 | - |
| Information Ratio | -1.03 | - |
| Jensen's Alpha (in %) | -0.57 | - |
| Maximalverlust (in %) | 30.77 | 30.39 |
| Erholungsdauer* | 13 | 13 |

*) in Monaten

Grösste Positionen (in %)

| | Zurich |
|--------------------------------|--------|
| Samsung Electronics Co Ltd | 4.34 |
| Tencent Holdings Ltd | 4.10 |
| Taiwan Semiconductor Manufactu | 3.92 |
| Alibaba Group Holding Ltd | 3.53 |
| Central Huijin Investment Ltd | 2.39 |

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

| | 1 Jahr p.a. | 5 Jahre p.a. | 10 Jahre p.a. | Seit Ausgabe p.a. |
|------------------------|-------------|--------------|---------------|-------------------|
| Sharpe Ratio | -0.97 | | | 0.37 |
| Tracking Error p.a. | 0.12 | | | 0.55 |
| Tracking Error Ex Ante | 0.15 | | | - |
| Information Ratio | -1.78 | | | -1.03 |
| Jensen's Alpha (in %) | -0.19 | | | -0.57 |

Übersicht Nettoerträgen (in %)

| | Jan | Feb | Mrz | Apr | Mai | Jun | Jul | Aug | Sep | Okt | Nov | Dez | YTD |
|------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2018 | 3.32 | -3.10 | -0.75 | 3.02 | -4.23 | -3.19 | 1.95 | -4.99 | 0.48 | -6.01 | | | -13.19 |
| 2017 | 2.35 | 4.65 | 2.39 | 1.60 | 0.03 | -0.09 | 6.72 | 1.78 | 0.24 | 6.61 | -1.29 | 2.78 | 31.13 |
| 2016 | -4.02 | -2.97 | 9.07 | 0.40 | -0.14 | 1.16 | 4.13 | 4.10 | -0.12 | 2.19 | -1.79 | -0.04 | 11.89 |
| 2015 | | 6.09 | 0.95 | 4.05 | -3.48 | -3.49 | -4.11 | -8.30 | -2.13 | 8.09 | 0.07 | -5.29 | -8.49 |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |

¹ 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.

² 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.