

Zurich

# Aktien Europa Passiv

Die Anlagegruppe investiert in Beteiligungspapiere und - rechte, welche Bestandteil des MSCI Europe ex Schweiz sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen.



Asset Manager	DWS CH AG		
ISIN	CH0023841783		
Bloomberg	ZAAKTEI SW		
Benchmark	MSCI Europe ex CH (NDDUEXSZ		
Erstausgabe	Januar 2006		
Fiskaljahr	1.1 31.12		
Währung	CHF		
Risikowährung	Übrige		
Vermögen (NAV in Mio.)	192,69		
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'605.61		
Verwaltungsgebühr	0,12%		
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,14%		
Ausgabespread	0,24%		
Rücknahmespread	0,02%		
Ausgabefrequenz	Täglich		
Anzahl Positionen	365		
Off-BM Positionen	0,00%		

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 %)

EUR	60,39
GBP	26,34
SEK	5,60
DKK	4,18
DKK Übrige	3,48

## Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-2,18	-2,21
3 Monate	7,80	7,70
Laufjahr	7,80	7,70
1 Jahr p.a.	4,51	4,36
5 Jahre p.a.	11,97	11,90
10 Jahre p.a.	4,61	4,58
Seit Ausgabe	55,95	58,51
Seit Ausgabe p.a.	2,35	2,43

### Volatilität (in %)

	Zurich Bench		
1 Jahr p.a.	9,88	9,87	
5 Jahre p.a.	15,63	15,60	
10 Jahre p.a.	15,80		
Seit Ausgabe p.a.	17,08	17,15	

### Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,12	0,13
Beta	1,00	1,00
Tracking Error p.a.	0,23	-
Information Ratio	-0,38	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,08	-
Maximalverlust (in %)	-59,95	-60,34
Erholungsdauer*	150	150

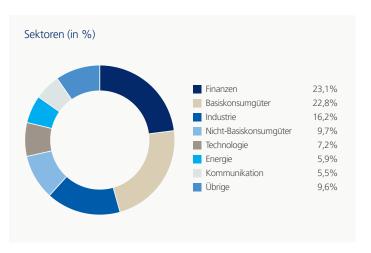
#### \* in Monaten

#### Grösste Positionen (in %)

Zunch
2,79
2,61
2,29
2,26
2,26

### Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre	Seit Ausgabe
	p.a.	p.a.	p.a.	p.a.
Sharpe Ratio	0,34	0,75	0,31	0,12
Beta	1,00	1,00	1,00	1,00
Tracking Error p.a.	0,09	0,13	0,19	0,23
Tracking Error Ex Ante	0,08	-	-	-
Information Ratio	1,66	0,57	0,14	-0,38
Jensen's Alpha (in %)	0,15	0,06	0,01	-0,08



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.

