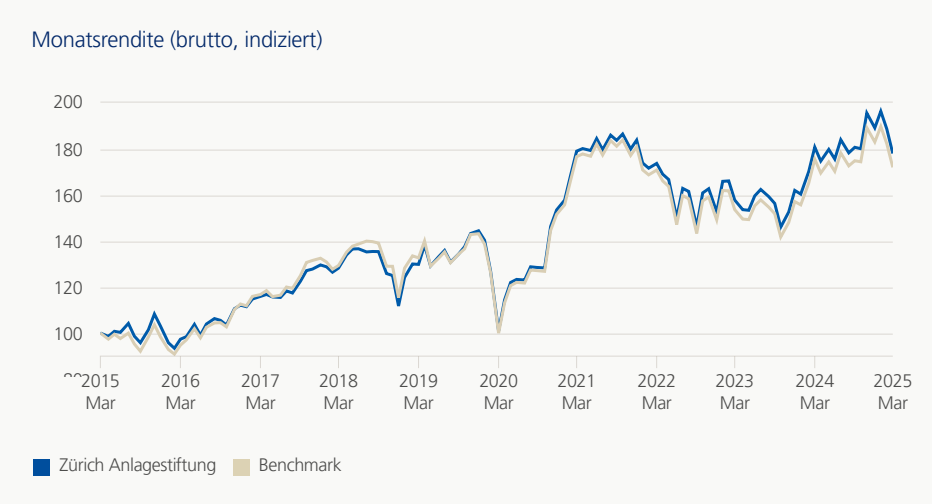
Aktien Global Small Cap Passiv

Die Anlagegruppe investiert in Beteiligungspapiere und -rechte, welche Bestandteil des MSCI World Small Cap sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen. (Managerwechsel und Passivierung des Mandates per 01.02.2020)



Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG
ISIN	CH0201365837
Bloomberg	ZISWPCH SW
Benchmark	MSCI Small Cap (NCUDWI)
Erstausgabe	Januar 2013
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	Übrige
Vermögen (NAV in Mio.)	234,02
Inventarwert (NAV/Anteil)	2'306.60
Verwaltungsgebühr	0,24%
TER (NAV)[1]	0,32%
Ausgabespread	0,06%
Rücknahmespread	0,03%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	2 721
Off-BM Positionen	0,11%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

[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.

Währungsexposure (in %)

	Zurich
USD	60,07
JPY	12,91
EUR	6,65
GBP	4,75
Übrige	15,62

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-5,65	-5,63
3 Monate	-5,94	-6,01
Laufjahr	-5,94	-6,01
1 Jahr p.a.	-1,76	-2,03
5 Jahre p.a.	11,73	11,44
10 Jahre p.a.	5,31	5,56
Seit Ausgabe	133,50	143,90
Seit Ausgabe p.a.	7,22	7,61

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	14,96	14,83
5 Jahre p.a.	17,43	17,43
10 Jahre p.a.	17,19	17,20
Seit Ausgabe p.a.	16,47	16,42

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,45	0,48
Beta	1,00	1,00
Tracking Error p.a.	1,81	-
Information Ratio	-0,21	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,36	-
Maximalverlust (in %)	-30,14	-30,12
Erholungsdauer*	8	8

* in Monaten

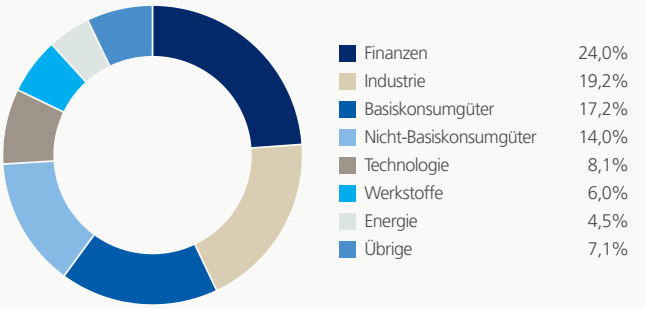
Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0,20	0,66	0,33	0,45
Beta	1,01	1,00	0,99	1,00
Tracking Error p.a.	0,21	0,25	1,75	1,81
Tracking Error Ex Ante	0,17	-	-	-
Information Ratio	1,24	1,16	-0,14	-0,21
Jensen's Alpha (in %)	0,29	0,29	-0,22	-0,36

Grösste Positionen (in %)

	Zurich
Liquidity	0,52
Casey's general stores inc	0,22
Tapestry inc	0,21
Us foods holding corp	0,20
Sprouts farmers market inc	0,19

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

ZURICH®