

Zürich Anlagestiftung

BVG Rendite

Mit den BVG und Profil Strategiefonds der Zürich Anlagestiftung stehen Pensionskassen eine umfassende Gesamtlösung zur Verfügung. Einfach und transparent können diese damit an allen wichtigen Anlagemärkten partizipieren.

Ihre Vorteile auf einen Blick

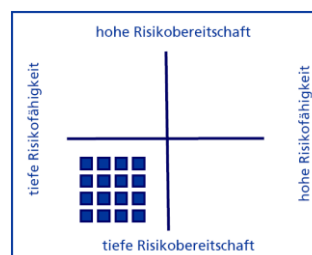
- Effiziente und umfassende Gesamtlösung
- Breit diversifizierte und transparente Anlagen
- Unabhängiger Anlagemanagement-Prozess, der höchste Compliance-Ansprüche erfüllt
- Attraktive Konditionen

Anlageuniversum

Die Anlagegruppe investiert in Aktien, Obligationen und Immobilien innerhalb der jeweils gültigen Vorgaben im Rahmen des Bundesgesetzes über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG/BVV2).

Anlageprozess

Der strategische Aktienanteil beträgt 25% (taktische Bandbreite 20-30%).



Manager

Im Gegensatz zu den meisten Mitbewerbern arbeitet die Zürich Anlagestiftung nicht exklusiv mit einem einzigen Vermögensverwalter zusammen. Mit Hilfe eines unabhängigen und klar strukturierten Anlagemanagement-Prozesses sucht die Zürich Anlagestiftung für jede Anlageklasse den am besten geeigneten Vermögensverwalter.

Die ursprünglichen vorgegebenen Selektionskriterien und die Leistung der Vermögensverwalter werden laufend überprüft. Bei wesentlichen Abweichungen wird der Selektionsprozess für das betroffene Vermögensverwaltungs-Mandat erneut gestartet.

BVG Rendite

Die Anlagegruppe investiert in Aktien, Obligationen und Immobilien innerhalb der aktuellen, gültigen Vorgaben im Rahmen des Bundesgesetzes über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG/BVV2). Der strategische Aktienanteil beträgt 25% (taktische Bandbreite 20-30%).

Angaben per 31.10.2018

Wertentwicklung (brutto, indiziert)



Eckdaten

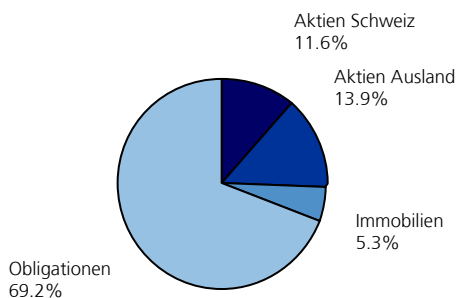
Asset Manager	Diverse
ISIN	CH0007216689
Bloomberg Ticker	ZBVGREN SW
Benchmark	Customized Index
Ausgabe	06.1999
Geschäftsjahr	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Risikowährung	Übrige
Vermögen (in Mio.)	17.11
Inventarwert (NAV)	1'781.81
Verwaltungsgebühr	0.50%
TER (gemäss KGAST)	0.51%
Spread	0.20%
Ausgabe/Rücknahme	Täglich

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Fremdwährungen (in %)

	Zurich
CHF	85.65
USD	6.03
EUR	2.69
JPY	1.81
Übrige	3.82

Asset Allocation (in %)



Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1.10	-1.07
3 Monate	-1.33	-1.41
Laufjahr	-1.96	-1.55
1 Jahr p.a.	-1.57	-1.22
5 Jahre p.a.	2.81	3.56
10 Jahre p.a.	4.01	4.46
Seit Ausgabe p.a.	3.05	3.38

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	2.12	2.10
5 Jahre p.a.	3.12	3.13
10 Jahre p.a.	3.49	3.58
Seit Ausgabe p.a.	3.82	3.76

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0.60	0.70
Beta	0.99	1.00
Tracking Error p.a.	0.88	-
Information Ratio	-0.37	-
Jensen's Alpha (in %)	-0.30	-
Maximalverlust (in %)	13.29	11.78
Erholungsdauer*	12	9

*) in Monaten

Grösste Positionen (in %)

	Zurich
Nestle SA	2.37
Novartis AG	1.94
Roche Holding AG	1.59
UBS Group AG	0.56
Credit Suisse Group AG	0.42

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0.38	1.08	1.19	0.60
Beta	1.00	0.97	0.96	0.99
Tracking Error p.a.	0.31	0.64	0.69	0.88
Information Ratio	-1.13	-1.18	-0.65	-0.37
Jensen's Alpha (in %)	-0.35	-0.65	-0.25	-0.30

Übersicht Nettoerenditen (in %)

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	YTD
2018	-0.40	-1.21	-0.08	0.63	-0.47	0.07	0.81	-0.27	0.03	-1.10			-1.96
2017	-0.03	1.64	0.16	1.01	0.42	-0.64	0.89	0.38	0.34	1.24	0.01	0.39	5.94
2016	-0.03	-0.56	0.67	0.44	0.97	0.00	1.05	0.24	-0.05	-0.91	-0.59	0.92	2.14
2015	-1.43	1.94	0.80	-0.37	0.32	-1.97	1.93	-1.57	-0.67	2.34	1.01	-1.83	0.36
2014	0.89	0.77	0.22	0.55	1.30	0.14	0.25	1.36	0.29	0.19	1.18	0.52	7.92
2013	0.77	1.19	0.95	1.20	0.18	-2.27	0.96	-0.65	1.07	1.37	0.49	-0.53	4.75
2012	1.29	1.07	0.19	-0.06	0.01	0.40	2.06	0.10	0.52	0.21	0.60	0.26	6.82
2011	0.43	0.51	-0.86	0.17	0.20	-0.85	-1.12	0.24	1.52	1.04	0.00	1.61	2.87
2010	0.20	1.29	0.95	0.24	0.11	-1.90	1.09	-0.18	0.47	1.03	-1.06	-0.40	1.81
2009	0.06	-2.62	1.32	2.76	0.45	0.86	3.34	1.40	0.82	-0.67	0.59	1.08	9.66
2008	-1.92	-0.55	-1.72	1.90	0.08	-2.78	1.86	1.18	-2.38	-3.72	2.30	-1.88	-7.58

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.