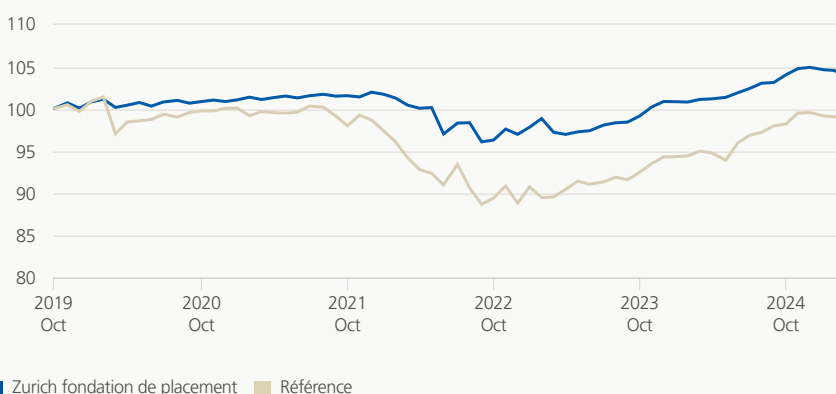


# Hypothèques Suisse

Le groupe d'investissement investit ses actifs principalement dans un portefeuille diversifié de crédits hypothécaires à intérêt fixe d'une durée résiduelle moyenne allant jusqu'à 9 ans.

Performance (brute, indexée)



## Caractéristiques

Gestionnaire	Zurich Invest AG
ISIN	CH0490192207
Bloomberg	ZUAHSPF SV
Référence	SBI AAA-A 5-7Y T (STA57T)
Date de lancement	novembre 2019
Année fiscale	1.1. - 31.12.
Monnaie	CHF
Monnaies investies	CHF
Volume (NAV en mio.)	372,81
Valeur d'inventaire	1'024.94
Nantissement moyen	49,50%
Nombre d'hypothèques	460
Frais de gestion	0,25%
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,27%
Frais de souscription	0,10%
Frais de rachat	0,25%
Fréquence d'émission	Mensuelle

Informations supplémentaires sur [www.zurichinvest.ch](http://www.zurichinvest.ch)

## Performance (nette en &, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	-0,64	-0,23
3 mois	-1,02	-0,72
Année en cours	-1,02	-0,72
1 an p.a.	2,50	4,06
5 ans p.a.	0,48	0,37
10 ans p.a.	N/A	N/A
Depuis lancement	2,49	-1,16
Depuis lancement p.a.	0,46	-0,21

## Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	1,50	2,94
5 ans p.a.	2,54	3,80
10 ans p.a.	N/A	N/A
Depuis lancement p.a.	2,53	4,16

<sup>1</sup> TER selon CAFP: Les indications correspondent au taux de charges d'exploitation (Total Expense Ratio) de l'exercice terminée et ne donne aucune garantie pour une telle performance dans l'avenir.

## Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0,12	-0,09
Tracking Error p.a.	3,43	-
Ratio d'information	0,20	-
Jensen's Alpha (en %)	0,44	-
Perte maximale (en %)	-5,93	-0,78
Période de reprise*	23	1
Duration modifiée	3,64	5,70
Rendement à l'échéance	1,47	-

\* en mois

## Ventilation par hypothèque (en %)

	Zurich
<50%	50,38
50% - 66,7%	41,43
66,8% - 75%	5,63
75% - 80%	2,56

## Durées (en %)

	Zurich
>10 ans	4,47
7 - 10 ans	18,00
5 - 7 ans	11,10
3 - 5 ans	17,96
1 - 3 ans	32,13
<1 an	16,34

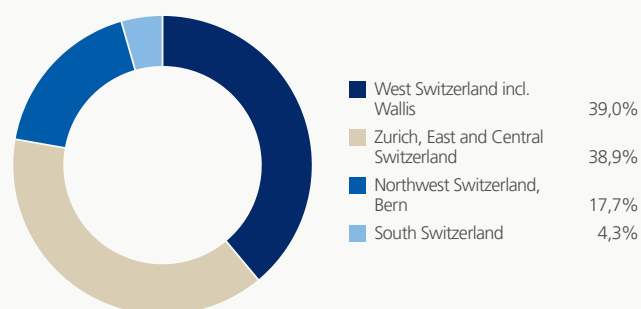
## Allocation type de propriété (en %)

	Zurich
Résidentiel	90,35
Mixte	8,63
Commercial	1,02

## Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis lancement p.a.
Sharpe Ratio	0,89	0,10	N/A	0,12
Bêta	0,28	0,36	N/A	0,34
Tracking Error p.a.	2,46	3,24	N/A	3,43
Tracking Error Ex Ante	0,00	-	-	-
Ratio d'information	-0,63	0,03	N/A	0,20
Jensen's Alpha (en %)	0,53	0,20	N/A	0,44

## Secteurs (en %)



Toutes les informations contenues dans ce document ont été établies avec soin et en toute conscience. Zurich Invest SA et la Zurich fondation de placement ne sont aucunement responsables de leur exactitude ni de leur exhaustivité et ne sauraient être tenues responsables des pertes éventuelles résultant de l'utilisation de ces informations. La performance historique ne constitue pas un indicateur de la performance actuelle ou future. Le document sert uniquement à des fins d'information et à l'utilisation par le destinataire. Il ne représente ni une offre ni une recommandation pour l'acquisition de produits financiers et il ne dispense pas le destinataire de sa propre appréciation ou de l'appréciation de tiers. Les informations ne constituent pas une aide à la décision pour des conseils économiques, juridiques, fiscaux ou autres. Tous les documents constituant les bases légales d'un investissement peuvent être obtenus gratuitement auprès de Zurich Invest SA ou de la Zurich fondati

Zurich Invest SA / Zurich fondation de placement

Case postale, CH-8085 Zurich

Téléphone +41 (0)44 628 78 88, Fax +41 (0)44 629 18 66

fondation@zurich.ch, www.zurichinvest.ch



**ZURICH**<sup>®</sup>