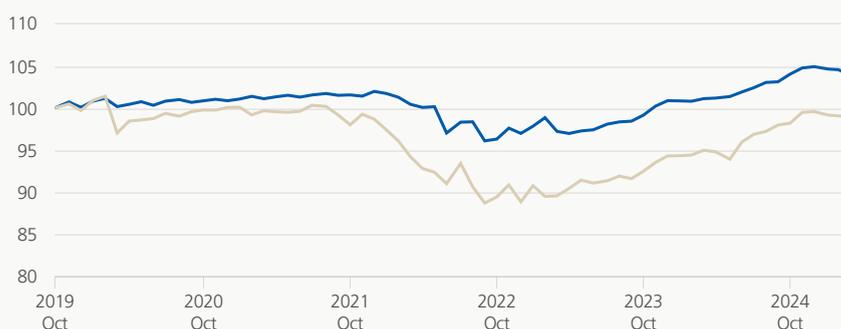


Hypotheken Schweiz

Die Anlagegruppe investiert ihr Vermögen vorwiegend in ein diversifiziertes Portfolio von festverzinsten Hypothekarforderungen auf Schweizer Liegenschaften. Die durchschnittliche Restlaufzeit des Portfolios ist auf 9 Jahre limitiert.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

Eckdaten

Asset Manager	Zurich Invest AG
ISIN	CH0490192207
Bloomberg	ZUAHSPF SW
Benchmark	SBI AAA-A 5-7Y T (STA57T)
Erstausgabe	November 2019
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	372,81
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'024.94
Durchschnittliche Belehnung	49,50%
Anzahl Hypotheken	460
Verwaltungsgebühr	0,25%
TER (NAV) ¹	0,27%
Ausgabespread	0,10%
Rücknahmespread	0,25%
Ausgabefrequenz	Monatlich

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-0,64	-0,23
3 Monate	-1,02	-0,72
Laufjahr	-1,02	-0,72
1 Jahr p.a.	2,50	4,06
5 Jahre p.a.	0,48	0,37
10 Jahre p.a.	N/A	N/A
Seit Ausgabe	2,49	-1,16
Seit Ausgabe p.a.	0,46	-0,21

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	1,50	2,94
5 Jahre p.a.	2,54	3,80
10 Jahre p.a.	N/A	N/A
Seit Ausgabe p.a.	2,53	4,16

¹ TER gemäss KGAST: Die Angabe entspricht der Betriebsaufwandsquote (Total Expense Ratio) im letzten abgeschlossenen Geschäftsjahr und bietet keine Gewähr für eine entsprechende Höhe in der Zukunft.

Risikokennzahlen seit Erstaussgabe

	Zürich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,12	-0,09
Tracking Error p.a.	3,43	-
Information Ratio	0,20	-
Jensen's Alpha (in %)	0,44	-
Maximalverlust (in %)	-5,93	-0,78
Erholungsdauer*	23	1
Modified Duration	3,64	5,70
Yield to Maturity	1,47	-

* in Monaten

Allokation nach Belehnung (in %)

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

Laufzeiten (in %)

	Zürich
>10 Jahre	4,47
7 - 10 Jahre	18,00
5 - 7 Jahre	11,10
3 - 5 Jahre	17,96
1 - 3 Jahre	32,13
<1 Jahr	16,34

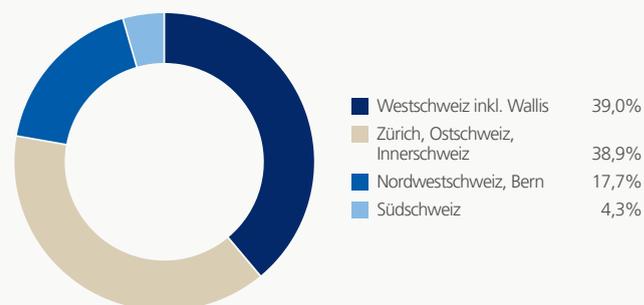
Allokation nach Objekttypen (in %)

	Zürich
Wohnen	90,35
Gemischt	8,63
Gewerbe	1,02

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	0,89	0,10	N/A	0,12
Beta	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	-	-	-
Information Ratio	-0,63	0,03	N/A	0,20
Jensen's Alpha (in %)	0,53	0,20	N/A	0,44

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