

Obligationen CHF Inland

Die Anlagegruppe investiert vorzugsweise in festverzinsliche Wertpapiere erstklassiger Schweizer Emittenten in Schweizer Franken. Es dürfen nicht mehr als 10% der Anlagegruppe in Titeln des gleichen Schuldners angelegt werden. Davon ausgenommen sind Forderungen gegen Bund, Kantone, Banken und Versicherungen mit statutarischem Sitz in der Schweiz.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG, Lombard Odier Investment Managers (Switzerland) SA
ISIN	CH0007226944
Bloomberg	ZOBLSWZ SW
Benchmark	SBI Domestic AAA-BBB TR (SBD14T)
Erstausgabe	Mai 1999
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	1 546,96
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'487,51
Verwaltungsgebühr	0,30%
TER (NAV) ¹	0,31%
Ausgabekommission	0,40%
Rücknahmekommission	0,00%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	994
Off-BM Positionen	3,98%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	24,28
7 - 10 Jahre	18,97
5 - 7 Jahre	17,43
3 - 5 Jahre	21,10
1 - 3 Jahre	17,45
<1 Jahr	0,76

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1,60	-1,57
3 Monate	-2,01	-2,11
Laufjahr	0,89	0,89
1 Jahr p.a.	-9,31	-9,13
5 Jahre p.a.	-2,03	-1,79
10 Jahre p.a.	-0,24	-0,09
Seit Ausgabe	49,42	60,49
Seit Ausgabe p.a.	1,71	2,01

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	8,30	8,15
5 Jahre p.a.	5,60	5,43
10 Jahre p.a.	4,60	4,48
Seit Ausgabe p.a.	3,78	3,84

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.

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,32	0,39
Tracking Error p.a.	0,46	-
Information Ratio	-0,67	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,27	-
Maximalverlust (in %)	-4,85	-6,29
Erholungsdauer*	7	9
Modified Duration	7,44	7,41

* in Monaten

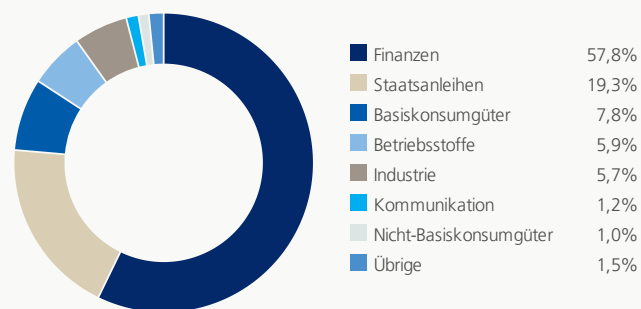
Kredit-Ratings (in %)

	Zurich
AAA	52,53
AA	22,21
A	13,47
BBB	8,04
LIQ	2,45
N.A.	0,26
Not Rated	1,04

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-1,10	-0,24	0,07	0,32
Beta	1,02	1,03	1,02	0,98
Tracking Error p.a.	0,48	0,40	0,36	0,46
Tracking Error Ex Ante	1,32	-	-	-
Information Ratio	-0,37	-0,61	-0,41	-0,67
Jensen's Alpha (in %)	-0,03	-0,22	-0,16	-0,27

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