

Obligations Domestique CHF

Le groupe de placement investit de préférence dans des titres à taux d'intérêt fixe d'émetteurs suisses de premier ordre en francs suisses. Pas plus de 10% du groupe de placement peuvent être investis en titres du même emprunteur, à l'exception des créances envers la Confédération, les cantons, les banques ou les institutions d'assurances ayant leur siège statutaire en Suisse.

Performance (brute, indexée)



■ Zurich fondation de placement ■ Référence

Caractéristiques

Gestionnaire	DWS CH AG, Lombard Odier Investment Managers (Switzerland) SA
ISIN	CH0007226944
Bloomberg	ZOBLSWZ SW
Référence	SBI Domestic AAA-BBB TR (SBD14T)
Erstausgabe	mai 1999
Année fiscale	1.1. - 31.12.
Monnaie	CHF
Monnaies investies	CHF
Volume (NAV en mio.)	1 546,96
Valeur d'inventaire	1'487,51
Frais de gestion	0,30%
TER (NAV) ¹	0,31%
Frais de souscription	0,40%
Frais de rachat	0,00%
Fréquence d'émission	Quotidiennement
Nombre de positions	994
Positions hors BM	3,98%

Informations supplémentaires sur www.zurichinvest.ch

Durées (en %)

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

Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	-1,60	-1,57
3 mois	-2,01	-2,11
Année en cours	0,89	0,89
1 an p.a.	-9,31	-9,13
5 ans p.a.	-2,03	-1,79
10 ans p.a.	-0,24	-0,09
Depuis lancement	49,42	60,49
Depuis lancement p.a.	1,71	2,01

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	8,30	8,15
5 ans p.a.	5,60	5,43
10 ans p.a.	4,60	4,48
Depuis lancement p.a.	3,78	3,84

¹ TER selon CAF: 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	0,32	0,39
Tracking Error p.a.	0,46	-
Ratio d'information	-0,67	-
Jensen's Alpha (en %)	-0,27	-
Perte maximale (en %)	-4,85	-6,29
Période de reprise*	7	9
Duration modifiée	7,44	7,41

* en mois

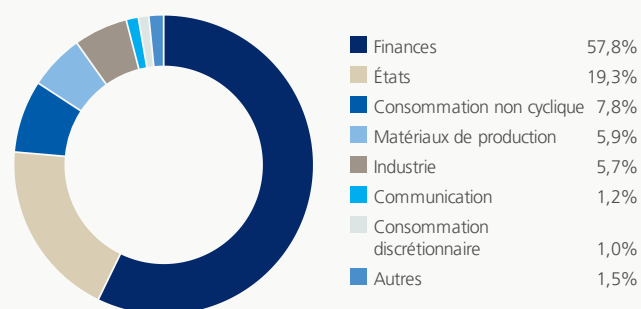
Ratings de crédit (en %)

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

Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis lancement p.a.
Sharpe Ratio	-1,10	-0,24	0,07	0,32
Bêta	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	-	-	-
Ratio d'information	-0,37	-0,61	-0,41	-0,67
Jensen's Alpha (en %)	-0,03	-0,22	-0,16	-0,27

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

