

# Obligationen CHF 15+

Die Anlagegruppe investiert überwiegend in Forderungspapiere und -rechte erstklassiger Emittenten in CHF und mit einer Restlaufzeit von mehr als 15 Jahren. Es dürfen nicht mehr als 10% der Anlagegruppe in Titeln des gleichen Schuldners angelegt werden. Die Schuldnerbegrenzung pro Staat mit einem Rating von mindestens AA beträgt 25%.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

## Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG
ISIN	CH0023842088
Bloomberg	ZAOBL15 SW
Benchmark	SBI AAA-A 15+ T (STA55T)
Erstausgabe	Januar 2006
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	787,51
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'275.85
Verwaltungsgebühr	0,30%
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,31%
Ausgabekommission	1,00%
Rücknahmekommission	0,00%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	128
Off-BM Positionen	1,24%

Weitere Informationen unter [www.zurichinvest.ch](http://www.zurichinvest.ch)

## Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	100,00

## Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-3,25	-3,19
3 Monate	-5,82	-5,77
Laufjahr	2,26	2,35
1 Jahr p.a.	-21,32	-20,89
5 Jahre p.a.	-3,80	-3,52
10 Jahre p.a.	-0,45	-0,17
Seit Ausgabe	29,44	36,94
Seit Ausgabe p.a.	1,52	1,86

## Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	19,73	19,82
5 Jahre p.a.	13,30	13,29
10 Jahre p.a.	11,13	11,16
Seit Ausgabe p.a.	10,22	10,42

<sup>1</sup> 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 Erstaussgabe

	Zürich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,14	0,17
Tracking Error p.a.	0,73	-
Information Ratio	-0,46	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,30	-
Maximalverlust (in %)	-13,64	-13,03
Erholungsdauer*	10	10
Modified Duration	19,43	19,42

\* in Monaten

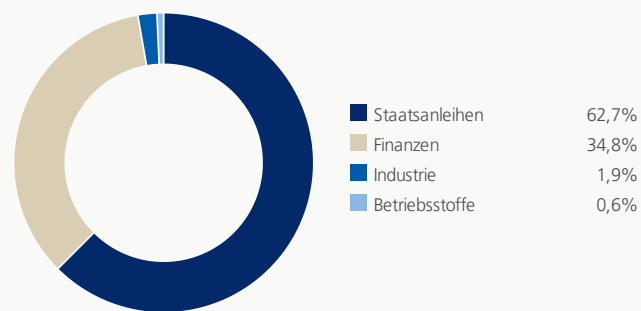
## Kredit-Ratings (in %)

	Zürich
AAA	76,61
AA	19,95
A	2,85
LIQ	0,59

## Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-1,07	-0,23	0,01	0,14
Beta	0,99	1,00	1,00	0,98
Tracking Error p.a.	0,32	0,22	0,24	0,73
Tracking Error Ex Ante	0,24	-	-	-
Information Ratio	-1,35	-1,26	-1,18	-0,46
Jensen's Alpha (in %)	-0,53	-0,28	-0,28	-0,30

## 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