

Obl. Unternehm. Euro (hedged)

Die Anlagegruppe investiert vorzugsweise in auf Euro lautende festverzinsliche Wertpapiere in- und ausländischer Emittenten im Investment Grade Bereich. Das Fremdwährungsrisiko ist in der Regel gegen CHF abgesichert.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG, HSBC Global Asset Management (France)
ISIN	CH0017561389
Bloomberg	ZACRMBD SW
Benchmark	ICE BofA ML CI (H419)
Erstausgabe	Januar 2004
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	Abgesichert in CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	1 148,03
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'339.59
Verwaltungsgebühr	0,40%
TER (NAV) ¹	0,42%
Ausgabekommission	0,35%
Rücknahmekommission	0,05%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	639
Off-BM Positionen	13,31%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	13,35
7 - 10 Jahre	13,66
5 - 7 Jahre	21,44
3 - 5 Jahre	28,40
1 - 3 Jahre	19,57
<1 Jahr	3,58

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1,46	-1,32
3 Monate	-1,14	-1,10
Laufjahr	0,95	0,63
1 Jahr p.a.	-10,81	-11,06
5 Jahre p.a.	-2,09	-2,04
10 Jahre p.a.	0,29	0,33
Seit Ausgabe	35,22	48,09
Seit Ausgabe p.a.	1,59	2,08

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	9,66	9,07
5 Jahre p.a.	6,31	5,62
10 Jahre p.a.	4,98	4,43
Seit Ausgabe p.a.	4,47	3,91

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 Erstaussgabe

	Zürich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,32	0,49
Tracking Error p.a.	1,31	-
Information Ratio	-0,37	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,67	-
Maximalverlust (in %)	-12,00	-6,64
Erholungsdauer*	9	8
Modified Duration	4,48	4,47

* in Monaten

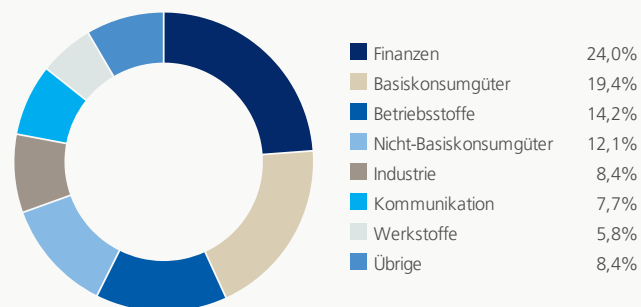
Kredit-Ratings (in %)

	Zürich
AAA	0,57
AA	3,50
A	18,36
BBB	74,07
BB	3,41
LIQ	0,10

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-1,10	-0,22	0,17	0,32
Beta	1,06	1,11	1,11	1,10
Tracking Error p.a.	1,07	1,08	0,91	1,31
Tracking Error Ex Ante	0,65	-	-	-
Information Ratio	0,24	-0,05	-0,05	-0,37
Jensen's Alpha (in %)	0,91	0,10	-0,15	-0,67

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