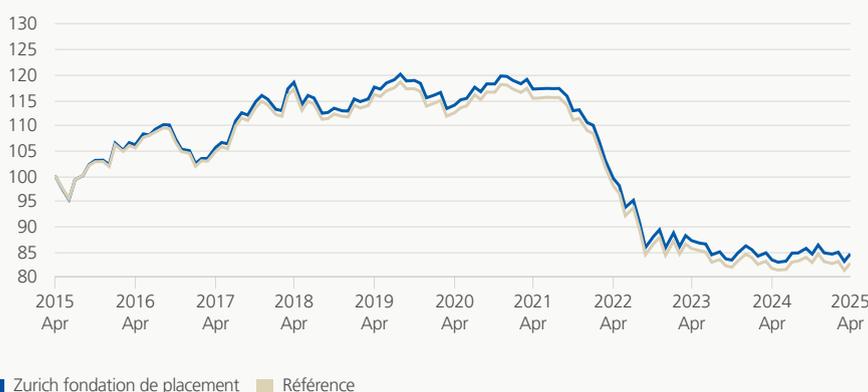


Obligations Euro (CHF hedged)

Le groupe de placement investit dans des obligations ou des titres de créance libellés en euros émis par des débiteurs publics et privés. Les créances ne peuvent pas dépasser de plus de cinq points de pourcentage le poids de la référence. Les principes de répartition géographique et sectorielle des risques et d'échelonnement temporel adéquat des échéances doivent être respectés. Le risque de change est couvert contre le franc suisse.

Performance (brute, indexée)



Caractéristiques

| | |
|------------------------|--|
| Gestionnaire | DWS CH AG |
| ISIN | CH0007227074 |
| Bloomberg | ZOBLEUR SW |
| Référence | Barclays Euro Treasury CI CHF H (H27836CH) |
| Date de lancement | mai 1999 |
| Année fiscale | 1.1. - 31.12. |
| Monnaie | CHF |
| Monnaies investies | Hedged en CHF |
| Volume (NAV en mio.) | 173,30 |
| Valeur d'inventaire | 1'126.28 |
| Frais de gestion | 0,34% |
| TER (NAV) ¹ | 0,37% |
| Frais de souscription | 0,10% |
| Frais de rachat | 0,00% |
| Fréquence d'émission | Quotidiennement |
| Nombre de positions | 210 |
| Positions hors BM | 16,85% |

Informations supplémentaires sur www.zurichinvest.ch

¹ TER selon CAPP: 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.

Durées (en %)

| Durée | Zurich |
|------------|--------|
| >10 ans | 24,89 |
| 7 - 10 ans | 14,68 |
| 5 - 7 ans | 11,54 |
| 3 - 5 ans | 20,97 |
| 1 - 3 ans | 23,33 |
| <1 an | 4,59 |

Performance (nette en %, en CHF)

| | Zurich | Référence |
|-----------------------|--------|-----------|
| 1 mois | 1,73 | 1,70 |
| 3 mois | -0,04 | 0,06 |
| Année en cours | -0,35 | -0,42 |
| 1 an p.a. | 1,07 | 1,25 |
| 5 ans p.a. | -6,12 | -5,97 |
| 10 ans p.a. | -2,08 | -1,89 |
| Depuis lancement | 13,48 | 16,93 |
| Depuis lancement p.a. | 0,49 | 0,61 |

Risque (en %)

| | Zurich | Référence |
|-----------------------|--------|-----------|
| 1 an p.a. | 4,94 | 4,75 |
| 5 ans p.a. | 6,64 | 6,61 |
| 10 ans p.a. | 6,43 | 6,36 |
| Depuis lancement p.a. | 6,79 | 6,92 |

Données de risques depuis lancement

| | Zurich | Référence |
|-----------------------|--------|-----------|
| Sharpe Ratio | -0,01 | 0,01 |
| Tracking Error p.a. | 0,95 | - |
| Ratio d'information | -0,12 | - |
| Jensen's Alpha (en %) | -0,12 | - |
| Perte maximale (en %) | -22,61 | -24,91 |
| Période de reprise* | 34 | 41 |
| Duration modifiée | 6,74 | 7,32 |

* en mois

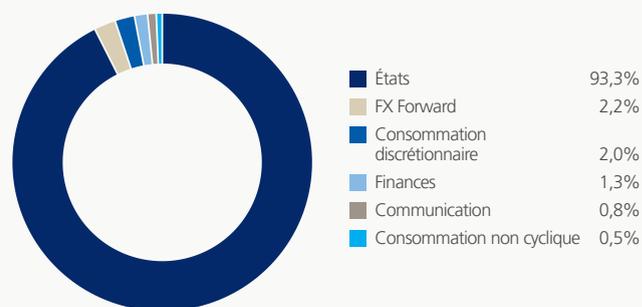
Ratings de crédit (en %)

| | Zurich |
|-----------|--------|
| AAA | 23,74 |
| AA | 46,52 |
| A | 16,21 |
| BBB | 11,72 |
| LIQ | 1,00 |
| Not Rated | 0,81 |

Données de risques

| | 1 an p.a. | 5 ans p.a. | 10 ans p.a. | Depuis lancement p.a. |
|------------------------|-----------|------------|-------------|-----------------------|
| Sharpe Ratio | 0,00 | -0,96 | -0,28 | -0,01 |
| Bêta | 1,04 | 1,00 | 1,01 | 0,97 |
| Tracking Error p.a. | 0,46 | 0,35 | 0,41 | 0,95 |
| Tracking Error Ex Ante | 0,17 | - | - | - |
| Ratio d'information | -0,38 | -0,45 | -0,47 | -0,12 |
| Jensen's Alpha (en %) | -0,18 | -0,14 | -0,18 | -0,12 |

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