

# Obligationen Euro

Die Anlagegruppe investiert in auf Euro lautenden Obligationen oder Schuldverschreibungen von öffentlich-rechtlichen sowie privatrechtlichen Schuldnern. Die Anlagegruppe wird aktiv verwaltet und richtet sich auf die Benchmark Barclays EUR Treasury (ex Italy, ex Fitch) aus. Forderungen dürfen maximal fünf Prozentpunkte über der Benchmark Gewichtung liegen. Es sind die Grundsätze der geografischen und branchenmässigen Risikoverteilung und einer angemessenen zeitlichen Staffelung der Fälligkeiten zu beachten.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



## Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG
ISIN	CH0007227074
Bloomberg	ZOBLEUR SW
Benchmark	Barclays Euro Treasury CI (I27836)
Erstausgabe	Mai 1999
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	EUR
Vermögen (NAV in Mio.)	254,36
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'154,18
Verwaltungsgebühr	0,35%
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,37%
Ausgabekommission	0,10%
Rücknahmekommission	0,00%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	216
Off-BM Positionen	20,01%

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

## Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	28,15
7 - 10 Jahre	13,62
5 - 7 Jahre	14,18
3 - 5 Jahre	20,00
1 - 3 Jahre	22,27
<1 Jahr	1,77

## Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-3,07	-2,95
3 Monate	-3,80	-3,71
Laufjahr	0,22	0,31
1 Jahr p.a.	-19,73	-19,54
5 Jahre p.a.	-5,68	-5,43
10 Jahre p.a.	-1,85	-1,67
Seit Ausgabe	16,29	19,55
Seit Ausgabe p.a.	0,64	0,75

## Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	10,84	10,93
5 Jahre p.a.	6,89	6,91
10 Jahre p.a.	7,33	7,31
Seit Ausgabe p.a.	6,94	7,09

<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

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,02	0,04
Tracking Error p.a.	0,99	-
Information Ratio	-0,12	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,11	-
Maximalverlust (in %)	-22,61	-24,91
Erholungsdauer*	34	41
Modified Duration	7,17	7,36

\* in Monaten

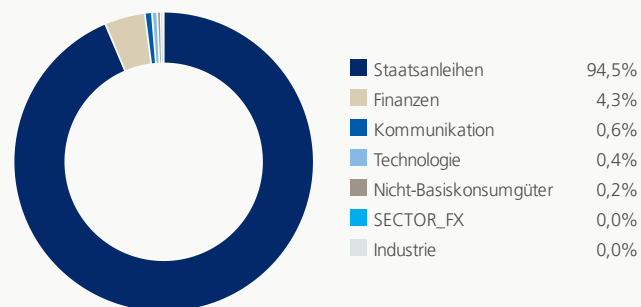
## Kredit-Ratings (in %)

	Zurich
AAA	28,73
AA	44,55
A	11,89
BBB	12,92
LIQ	1,52
Not Rated	0,39

## Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-1,80	-0,72	-0,18	0,02
Beta	0,99	1,00	1,00	0,97
Tracking Error p.a.	0,48	0,27	0,38	0,99
Tracking Error Ex Ante	0,20	-	-	-
Information Ratio	-0,39	-0,90	-0,49	-0,12
Jensen's Alpha (in %)	-0,36	-0,26	-0,18	-0,11

## 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