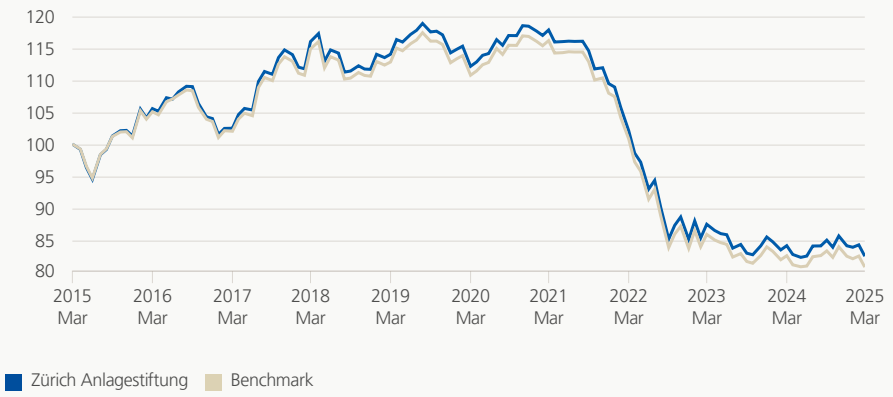
Obligationen Euro (CHF hedged)

Die Anlagegruppe investiert in auf Euro lautenden Obligationen oder Schuldverschreibungen von öffentlich-rechtlichen, sowie privatrechtlichen Schuldnern. 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. Das Währungsrisiko ist gegen Schweizer Franken abgesichert.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



Eckdaten

Asset Manager	DWS CH AG
ISIN	CH0007227074
Bloomberg	ZOBLEUR SW
Benchmark	Barclays Euro Treasury CI CHF H (H27836CH)
Erstausgabe	Mai 1999
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	Abgesichert in CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	205,04
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'107.15
Verwaltungsgebühr	0,34%
TER (NAV)[1]	0,37%
Ausgabespread	0,10%
Rücknahmespread	0,00%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	222
Off-BM Positionen	16,85%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

[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.

Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	27,10
7 - 10 Jahre	17,11
5 - 7 Jahre	13,30
3 - 5 Jahre	22,85
1 - 3 Jahre	20,54
<1 Jahr	-0,92

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-2,15	-2,11
3 Monate	-2,04	-2,09
Laufjahr	-2,04	-2,09
1 Jahr p.a.	-2,31	-2,18
5 Jahre p.a.	-6,34	-6,17
10 Jahre p.a.	-2,33	-2,13
Seit Ausgabe	11,55	14,97
Seit Ausgabe p.a.	0,42	0,54

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	4,89	4,74
5 Jahre p.a.	6,58	6,56
10 Jahre p.a.	6,40	6,34
Seit Ausgabe p.a.	6,79	6,92

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	-0,02	0,00
Tracking Error p.a.	0,96	-
Information Ratio	-0,12	-
Jensen's Alpha (in %)	-0,12	-
Maximalverlust (in %)	-22,61	-24,91
Erholungsdauer*	34	41
Modified Duration	7,10	7,17

* in Monaten

Kredit-Ratings (in %)

	Zurich
AAA	25,21
AA	47,27
A	15,83
BBB	10,24
LIQ	0,74
Not Rated	0,71

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0,71	-1,00	-0,32	-0,02
Beta	1,03	1,00	1,01	0,97
Tracking Error p.a.	0,46	0,35	0,41	0,96
Tracking Error Ex Ante	0,17	-	-	-
Information Ratio	-0,28	-0,47	-0,50	-0,12
Jensen's Alpha (in %)	-0,04	-0,16	-0,19	-0,12

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

ZURICH®