

Obligations Euro

Le groupe de placement investit en obligations ou titres de créance libellés en euros dont les débiteurs sont des collectivités de droit public ou des émetteurs de droit privé. Le groupe de placement est géré activement et s'oriente sur l'indice de référence Barclays EUR Treasury (Ex-Italy, Ex-Fitch). La pondération totale est limitée à cinq points de pourcentage au-dessus de la pondération de l'indice de référence. Les principes de répartition des risques entre régions géographiques et branches ainsi qu'un échelonnement approprié des échéances doivent être respectés.

Performance (brute, indexée)



Caractéristiques

Gestionnaire	DWS CH AG
ISIN	CH0007227074
Bloomberg	ZOBLUR SW
Référence	Barclays Euro Treasury CI (I27836)
Erstausgabe	mai 1999
Année fiscale	1.1. - 31.12.
Monnaie	CHF
Monnaies investies	EUR
Volume (NAV en mio.)	254,36
Valeur d'inventaire	1'154.18
Frais de gestion	0,35%
TER (NAV) ¹	0,37%
Frais de souscription	0,10%
Frais de rachat	0,00%
Fréquence d'émission	Quotidiennement
Nombre de positions	216
Positions hors BM	20,01%

Informations supplémentaires sur
www.zurichinvest.ch

Durées (en %)

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

Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	-3,07	-2,95
3 mois	-3,80	-3,71
Année en cours	0,22	0,31
1 an p.a.	-19,73	-19,54
5 ans p.a.	-5,68	-5,43
10 ans p.a.	-1,85	-1,67
Depuis lancement	16,29	19,55
Depuis lancement p.a.	0,64	0,75

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	10,84	10,93
5 ans p.a.	6,89	6,91
10 ans p.a.	7,33	7,31
Depuis lancement p.a.	6,94	7,09

¹ TER selon CAFP: 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.

Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0,02	0,04
Tracking Error p.a.	0,99	-
Ratio d'information	-0,12	-
Jensen's Alpha (en %)	-0,11	-
Perte maximale (en %)	-22,61	-24,91
Période de reprise*	34	41
Duration modifiée	7,17	7,36

* en mois

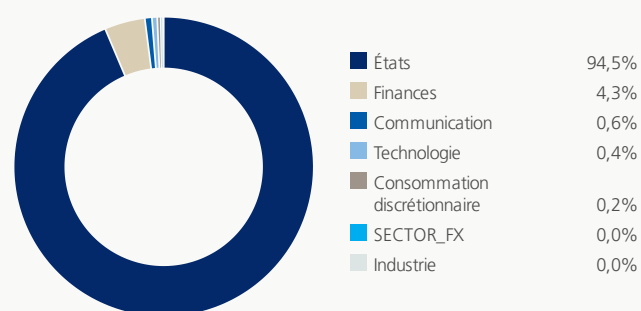
Ratings de crédit (en %)

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

Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis lancement p.a.
Sharpe Ratio	-1,80	-0,72	-0,18	0,02
Bêta	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	-	-	-
Ratio d'information	-0,39	-0,90	-0,49	-0,12
Jensen's Alpha (en %)	-0,36	-0,26	-0,18	-0,11

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

