

# Senior Loans Global (CHF hedged)

Le groupe de placement est largement diversifié et investit dans les Senior Loans en Europe et aux USA. L'allocation maximale dans un emprunteur spécifique se situe à 3% et les investissements seront répartis entre 75 emprunteurs au minimum. De plus, le portefeuille est complètement couvert en Francs Suisses.

Performance (brute, indexée)



■ Zurich fondation de placement ■ Référence

## Caractéristiques

Gestionnaire	Guggenheim Partners Investment Management LLC
ISIN	CH0221374652
Bloomberg	ZASRLNH SW
Référence	Morningstar Gl Lev Loan 70/30 CHF H (SPLGLFCH)
Date de lancement	novembre 2013
Année fiscale	1.1. - 31.12.
Monnaie	CHF
Monnaies investies	Hedged en CHF
Volume (NAV en mio.)	1 093,85
Valeur d'inventaire	1'306.62
Frais de gestion	0,65%
TER (NAV) <sup>1</sup>	0,73%
Frais de souscription	0,55%
Frais de rachat	0,20%
Fréquence d'émission	Mensuelle
Nombre de positions	465
Positions hors BM	8,43%

Informations supplémentaires sur [www.zurichinvest.ch](http://www.zurichinvest.ch)

<sup>1</sup> 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.

## Allocation d'actifs (en %)

	Zurich
Senior Secured Loans	95,91
Compte courant	2,73
High Yield Bonds	0,35
Second Lien Loans	0,14
Autres	0,87

## Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	-0,93	-0,71
3 mois	-0,68	-0,22
Année en cours	-0,68	-0,22
1 an p.a.	1,61	3,19
5 ans p.a.	5,44	6,45
10 ans p.a.	2,15	2,61
Depuis lancement	30,66	34,54
Depuis lancement p.a.	2,39	2,65

## Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	1,55	1,31
5 ans p.a.	3,82	4,29
10 ans p.a.	4,97	5,59
Depuis lancement p.a.	4,71	5,27

## Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0,56	0,55
Tracking Error p.a.	1,00	-
Ratio d'information	-0,26	-
Jensen's Alpha (en %)	0,08	-
Perte maximale (en %)	-13,03	-14,38
Période de reprise*	9	8
Duration modifiée	0,16	0,13
Years to Maturity	4,68	-

\* en mois

## Pays (en %)

	Zurich
Allemagne	2,75
Canada	2,64
France	4,03
Luxembourg	3,76
Pays-Bas	3,42
UK	4,20
USA	74,70
Autres	4,52

## Principales positions (en %)

	Zurich
Liquidity	4,20
Arcline fm holdings llc	0,87
Boxer parent company inc.	0,78
Visma as	0,74
Safety-kleen europe limited	0,74

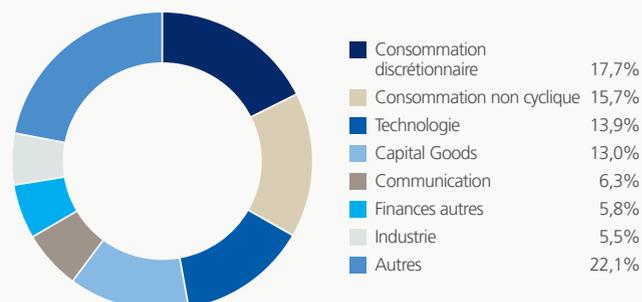
## Ratings de crédit (en %)

	Zurich
BBB	2,08
BB	18,46
B	66,47
CCC	7,64
CC	0,58
D	0,25
LIQ	4,23
Not Rated	0,29

## Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis lancement p.a.
Sharpe Ratio	0,28	1,37	0,49	0,56
Bêta	1,08	0,87	0,88	0,88
Tracking Error p.a.	0,63	1,08	1,02	1,00
Tracking Error Ex Ante	1,74	-	-	-
Ratio d'information	-2,50	-0,93	-0,45	-0,26
Jensen's Alpha (en %)	-1,74	-0,17	-0,11	0,08

## 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



**ZURICH**<sup>®</sup>