Zürich Anlagestiftung
Angaben per 31.03.2025

Senior Loans Global

Die Anlagegruppe ist breit diversifiziert durch Investitionen in europäische und US-amerikanische Senior Loans von mindestens 75 Schuldnern. Die maximale Allokation an einen einzelnen Schuldner beträgt drei Prozent.

Monatsrendite (brutto, indiziert)

Eckdaten

Asset Manager	Guggenheim Partners Investment Management LLC
ISIN	CH0231674877
Bloomberg	ZASRLUH SW
Benchmark	Morningstar Gl Lev Loan 70/30 CHF (SPLGLLF)
Erstausgabe	Januar 2014
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	Übrige
Vermögen (NAV in Mio.)	281,37
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'539.05
Verwaltungsgebühr	0,65%
TER (NAV)[1]	0,73%
Ausgabespread	0,55%
Rücknahmespread	0,20%
Ausgabefrequenz	Monatlich
Anzahl Positionen	449
Off-BM Positionen	8,43%

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.

Asset Allocation (in %)

	Zurich
Senior Secured Loans	95,91
Liquidität	2,73
High Yield Bonds	0,35
Second Lien Loans	0,14
Übrige	0,87

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1,92	-1,22
3 Monate	-1,44	-0,45
Laufjahr	-1,44	-0,45
1 Jahr p.a.	4,15	5,28
5 Jahre p.a.	6,27	6,98
10 Jahre p.a.	3,46	3,85
Seit Ausgabe	52,57	52,52
Seit Ausgabe p.a.	3,86	3,85

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	6,88	5,75
5 Jahre p.a.	7,76	7,35
10 Jahre p.a.	8,17	8,05
Seit Ausgabe p.a.	8,32	8,29

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,49	0,50
Tracking Error p.a.	1,71	-
Information Ratio	0,00	-
Jensen's Alpha (in %)	0,08	-
Maximalverlust (in %)	-15,12	-16,39
Erholungsdauer*	18	12
Modified Duration	0,16	0,13
Years to Maturity	4,68	-

* in Monaten

Länder (in %)

	Zurich
Deutschland	2,75
Frankreich	4,03
Kanada	2,64
Luxemburg	3,76
Niederlande	3,42
UK	4,20
USA	74,70
Übrige	4,52

Grösste Positionen (in %)

	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

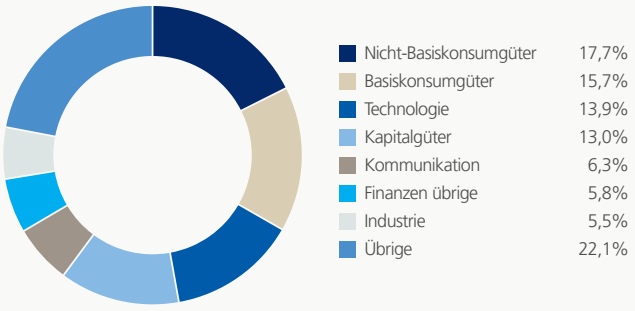
Kredit-Ratings (in %)

	Zurich
BBB	2,09
BB	18,53
B	66,73
CCC	7,67
CC	0,59
D	0,25
LIQ	3,85
Not Rated	0,29

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	0,43	0,78	0,46	0,49
Beta	1,18	1,03	0,99	0,98
Tracking Error p.a.	1,50	1,76	1,70	1,71
Tracking Error Ex Ante	1,74	-	-	-
Information Ratio	-0,76	-0,40	-0,23	0,00
Jensen's Alpha (in %)	-1,88	-0,90	-0,36	0,08

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®