

Wandelanleihen Global (CHF Hedged)

Die Anlagegruppe investiert vorzugsweise in global diversifizierte Wandelanleihen. Die durchschnittliche Kreditqualität des Portefeuilles beträgt im Minimum Investment Grade. Nicht mehr als 10% der Anlagegruppe werden in Emissionen des gleichen Schuldners angelegt. Das Fremdwährungsrisiko ist gegen CHF abgesichert.

Monatsrendite (brutto, indiziert)



■ Zürich Anlagestiftung ■ Benchmark

Eckdaten

Asset Manager	Advent Capital Management LLC
ISIN	CH0025219228
Bloomberg	ZAAWAGL SW
Benchmark	Customized Index
Erstausgabe	April 2006
Fiskaljahr	1.1. - 31.12.
Währung	CHF
Risikowährung	Abgesichert in CHF
Vermögen (NAV in Mio.)	376,54
Inventarwert (NAV/Anteil)	1'207.20
Verwaltungsgebühr	0,50%
TER (NAV) ¹	0,51%
Ausgabekommission	0,50%
Rücknahmekommission	0,00%
Ausgabefrequenz	Täglich
Anzahl Positionen	134
Off-BM Positionen	15,18%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Kredit-Ratings (in %)

	Zurich
AA	0,61
A	21,30
BBB	54,43
BB	9,10
B	2,67
LIQ	1,82
N.A.	6,04
Not Rated	4,03

Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	-1,57	-0,84
3 Monate	0,80	1,20
Laufjahr	2,68	2,95
1 Jahr p.a.	-6,62	-5,68
5 Jahre p.a.	0,41	-0,85
10 Jahre p.a.	2,47	1,33
Seit Ausgabe	22,01	17,02
Seit Ausgabe p.a.	1,19	0,94

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	12,20	10,63
5 Jahre p.a.	10,23	8,63
10 Jahre p.a.	9,15	7,96
Seit Ausgabe p.a.	10,70	9,81

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.

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zürich	Benchmark
Sharpe Ratio	0,10	0,09
Tracking Error p.a.	2,60	-
Information Ratio	0,10	-
Jensen's Alpha (in %)	0,20	-
Maximalverlust (in %)	-32,98	-33,37
Erholungsdauer*	74	65
Modified Duration	3,61	3,23

* in Monaten

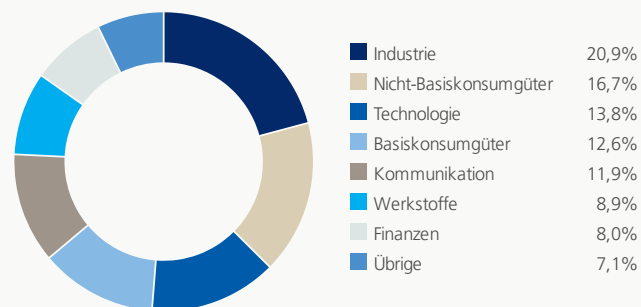
Grösste Positionen (in %)

	Zürich
Safran sa	4,88
Nippon steel corp	4,33
Southwest airlines co	3,97
Veolia environnement sa	3,30
Sika ag	3,25

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0,53	0,11	0,33	0,10
Beta	1,14	1,16	1,12	1,06
Tracking Error p.a.	1,81	2,47	2,17	2,60
Tracking Error Ex Ante	0,90	-	-	-
Information Ratio	-0,51	0,51	0,53	0,10
Jensen's Alpha (in %)	-0,14	1,29	0,90	0,20

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