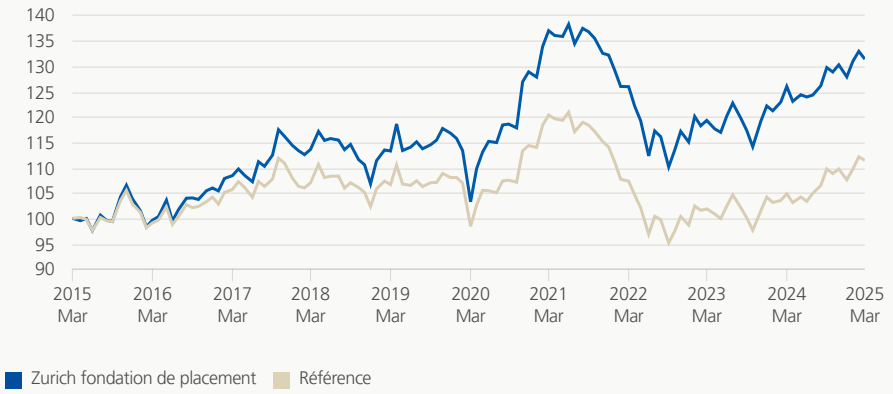
Obligations convertibles globales (CHF Hedged)

Le groupe de placement privilégie les investissements en options convertibles et à options ou titres de créance dont les débiteurs sont des émetteurs nationaux ou étrangers. La qualité de notation moyenne minimale du portefeuille doit au moins correspondre au segment Investment Grade de l'une des agences réputées. Le risque de change est couvert contre le CHF.

Performance (brute, indexée)



Caractéristiques

Gestionnaire	Advent Capital Management LLC
ISIN	CH0025219228
Bloomberg	ZAAWAGL SW
Référence	Indice personnalisé
Date de lancement	avril 2006
Année fiscale	1.1. - 31.12.
Monnaie	CHF
Monnaies investies	Hedged en CHF
Volume (NAV en mio.)	476,82
Valeur d'inventaire	1'327.46
Frais de gestion	0,50%
TER (NAV)[1]	0,52%
Frais de souscription	0,40%
Frais de rachat	0,05%
Fréquence d'émission	Quotidiennement
Nombre de positions	105
Positions hors BM	15,79%

Informations supplémentaires sur www.zurichinvest.ch

[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.

Ratings de crédit (en %)

	Zurich
A	22,76
BBB	55,61
BB	13,63
B	0,00
CCC	0,55
LIQ	5,24
Not Rated	2,22

Performance (nette en &, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	-1,19	-0,62
3 mois	2,61	3,55
Année en cours	2,61	3,55
1 an p.a.	3,75	6,27
5 ans p.a.	4,41	2,51
10 ans p.a.	2,15	1,09
Depuis lancement	34,16	28,35
Depuis lancement p.a.	1,57	1,33

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	5,69	5,66
5 ans p.a.	9,14	7,91
10 ans p.a.	8,79	7,65
Depuis lancement p.a.	10,34	9,49

Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0,13	0,12
Tracking Error p.a.	2,53	-
Ratio d'information	0,09	-
Jensen's Alpha (en %)	0,17	-
Perte maximale (en %)	-32,98	-33,37
Période de reprise*	74	65
Duration modifiée	3,84	2,71

* en mois

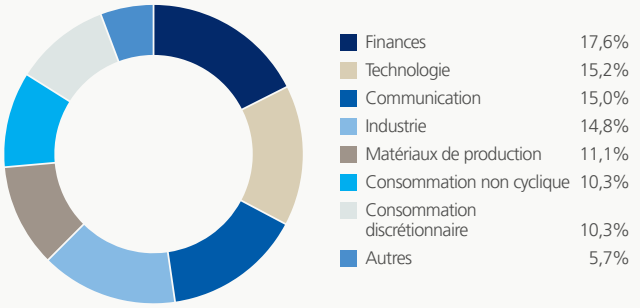
Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis lancement p.a.
Sharpe Ratio	0,45	0,46	0,28	0,13
Bêta	0,95	1,13	1,12	1,06
Tracking Error p.a.	1,81	2,20	2,14	2,53
Tracking Error Ex Ante	1,83	-	-	-
Ratio d'information	-1,39	0,86	0,50	0,09
Jensen's Alpha (en %)	-2,29	1,61	0,90	0,17

Principales positions (en %)

	Zurich
Uber technologies inc	4,50
Akamai technologies inc	4,11
Nextera energy capital	3,32
Schneider electric se	3,25
Alibaba group holding	3,09

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®