

## Zurich fondation de placement

# Obligations Suisse SDC

Base éprouvée pour un placement de capitaux réussi

Les placements en obligations et sur le marché monétaire constituent les bases d'un placement réussi de la fortune en prévoyance professionnelle. Gérés de manière professionnelle, nos placements en obligations sont optimisés en termes de risque et de rendement.

### Vos avantages en un coup d'œil

- **Module pour une mise en œuvre flexible de la stratégie de placement d'une caisse de pension;**
- **Placements largement diversifiés et transparents;**
- **Processus indépendant de gestion des investissements remplissant les critères de compliance les plus élevés;**
- **Conditions attrayantes**

### Univers de placement

Le groupe de placement Obligations Suisse SDC investit de préférence dans des titres à taux d'intérêt fixe d'émetteurs suisses de premier ordre en francs suisses. Pas plus de 15% du groupe de placement peuvent être investis en titres du même emprunteur, à l'exception des créances envers la Confédération, les cantons, les banques ou les institutions d'assurances ayant leur siège statutaire en Suisse.

### Processus de placement

Deutsche Asset Management Suisse SA

La constitution du portefeuille se base sur une analyse Top-Down et une recherche Bottom-Up. Dans une perspective macroéconomique, des prévisions d'évolution des taux sont établies pour les différents scénarios de marché. Cette approche Top-Down permet au gérant de portefeuille de se positionner en conséquence sur le marché.

Swisscanto Asset Management SA



### Manager

Deutsche Asset Management Suisse SA

La société Deutsche Asset Management Suisse SA appartenant au Groupe Deutsche Bank est l'un des principaux gestionnaires de fortune pour les investisseurs institutionnels en Europe.

Swisscanto Asset Management SA

Swisscanto est une entreprise collective des Banques Cantonales Suisses pour les services de placement et de prévoyance. En tant que prestataire spécialisé, Swisscanto se concentre sur le développement et la distribution de produits de placement et de prévoyance de grande qualité destinés aux particuliers et aux institutionnels.

## Obligations Suisse SDC

Le groupe de placement «Obligations Suisse SDC» investit de préférence dans des titres à taux d'intérêt fixe d'émetteurs suisses de premier ordre en francs suisses. Pas plus de 15% du groupe de placement peuvent être investis en titres du même emprunteur, à l'exception des créances envers la Confédération, les cantons, les banques ou les institutions d'assurances ayant leur siège statutaire en Suisse.

Données au 31.10.2017

### Caractéristiques

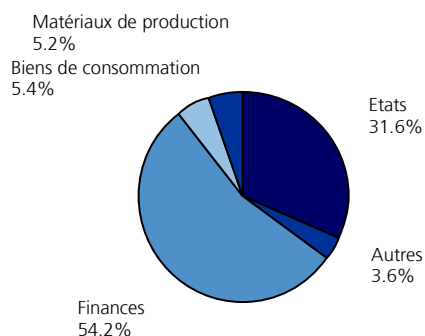
Manager	DEAMS, Swisscanto
ISIN	CH0231675825
Bloomberg Ticker	ZUOSSDC SW
Référence	-
Emission	06.2014
Exercice	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Monnaies investies	CHF
Volume (en mio.)	462.38
Valeur d'inventaire	1,027.48
Frais de gestion	0.40%
TER (selon CAFP)	0.41%
Spread	0.15%
Achat / vente	Journalier

Informations supplémentaires sur [www.zurich-fondation.ch](http://www.zurich-fondation.ch)

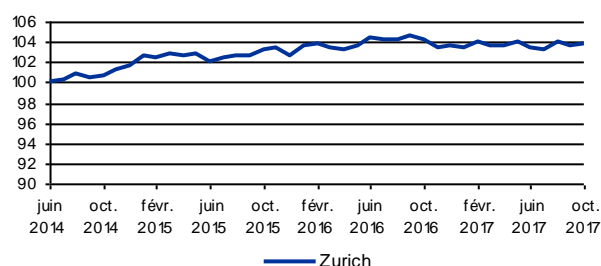
### Durées (en %)

	Zurich
>10 Ans	29.92
7-10 Ans	27.49
5-7 Ans	19.06
3-5 Ans	16.23
1-3 Ans	7.12
<1 Année	0.18

### Secteurs (en %)



### Performance (brute, indexée)



### Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	0.16	-
3 mois	0.36	-
Année en cours	-0.22	-
1 an p.a.	-0.86	-
5 ans p.a.	-	-
10 ans p.a.	-	-
Depuis le lancement	0.72	-

### Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	1.69	-
5 ans p.a.	-	-
10 ans p.a.	-	-
Depuis le lancement	1.61	-

### Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0.82	-
Tracking Error p.a.	0.51	-
Ratio d'information	-0.16	-
Jensen's Alpha (en %)	0.07	-
Perte maximale (en %)	1.64	-
Période de reprise*	3	-
Duration modifiée	4.22	-

\*) en mois

### Rating (en %)

	Zurich
AAA	55.88
AA	20.99
A	14.66
BBB	10.58
LIQ	-2.11

## Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis le
Sharpe Ratio	-0.07			0.82
Tracking Error p.a.				
Tracking Error Ex Ante				
Ratio d'information				
Jensen's Alpha (en %)				

## Aperçu de rendements (nets en %, en CHF)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jui	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	YTD
2017	-0.34	0.70	-0.54	0.04	0.28	-0.55	-0.16	0.68	-0.48	0.16			-0.22
2016	0.85	0.26	-0.39	-0.30	0.40	0.65	-0.14	-0.02	0.33	-0.39	-0.81	0.16	0.61
2015	0.87	-0.22	0.36	-0.23	0.20	-0.86	0.44	0.17	-0.14	0.53	0.29	-0.87	0.53
2014							0.20	0.51	-0.29	0.09	0.57	0.39	1.48

<sup>1</sup> 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.

<sup>2</sup> Spread: Commissions d'émission et de rachat payées au fonds (protection contre la dilution de la performance)

### Disclaimer

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 fondation de placement. Toute reproduction et/ou transmission même partielle du présent document requiert l'approbation écrite de Zurich Invest SA.