

Zürich Anlagestiftung

Obligationen Welt Index

Bewährte Basis für die erfolgreiche Vermögensanlage

Obligationen- und Geldmarktanlagen sind die Basis für die erfolgreiche Vermögensanlage in der beruflichen Vorsorge. Unsere professionell verwalteten Obligationenanlagen sind bezüglich Risiko und Rendite optimiert.

Ihre Vorteile auf einen Blick

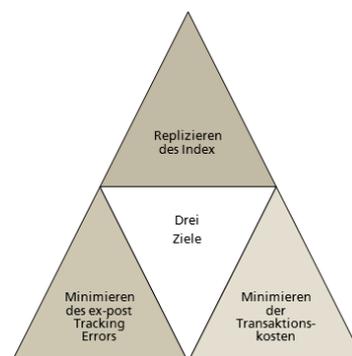
- Baustein zur flexiblen Umsetzung der Anlagestrategie einer Vorsorgeeinrichtung;
- Breit diversifizierte und transparente Anlagen;
- Unabhängiger Anlagemanagement-Prozess, der höchste Compliance-Ansprüche erfüllt;
- Attraktive Konditionen

Anlageuniversum

Die Anlagegruppe investiert vorzugsweise in festverzinsliche Wertpapiere, die Bestandteil des Citigroup World Government Bond (ex Switzerland) sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen. Die Anlagegruppe wird bestmöglich abgesichert.

Anlageprozess

Investmentphilosophie und Ziele



Risikokontrolle

- Optimale Indexreplizierung
- Proprietäre Indexierungs- und Risikosysteme
- Gegenparteiisiko entfällt, da effektive Obligationenkäufe getätigt werden und keine Ausleihung der Wertschriften erfolgt
- Unabhängige Überwachung und Überprüfung des Vermögensverwalters

Mehrwert

- Intelligenter Handel bei Indexänderungen
- Wertmaximierung in "corporate events"
- Minimierung der Transaktionskosten mittels optimaler Indexreplizierung

Manager

UBS AG, Global Asset Management

UBS Global Asset Management, ein Unternehmensbereich von UBS AG, ist einer der weltweit führenden Vermögensverwalter und bietet Anlagelösungen für Privatkunden, Finanzintermediäre und institutionelle Anleger auf der ganzen Welt. Mit rund 3500 Mitarbeitern in 25 Ländern ist UBS Global Asset Management ein globales Unternehmen, das diesen Namen wirklich verdient.

Obligationen Welt Index

Die Anlagegruppe «Obligationen Welt Index» investiert in festverzinsliche Wertpapiere, welche Bestandteil des Citigroup World Government Bond Index (ex Switzerland) sind. Mit der Replizierung der Benchmark soll die Performance, vor Abzug der Kosten, möglichst genau derjenigen des Vergleichsindex entsprechen (neue Benchmark per 24.02.2016).

Angaben per 31.10.2017

Wertentwicklung (brutto, indiziert)



Eckdaten

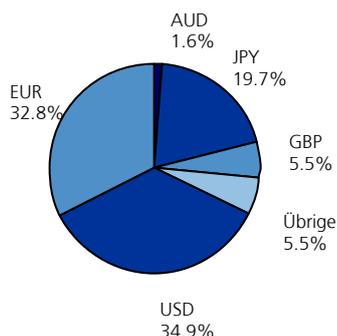
Asset Manager	UBS AG
ISIN	CH0007227322
Bloomberg Ticker	ZOBLUSD SW
Benchmark	Citigroup WGBI ex Switzerland
Ausgabe	01.2001
Geschäftsjahr	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Risikowährung	Abgesichert in CHF
Vermögen (in Mio.)	0.63
Inventarwert (NAV)	1'158.99
Verwaltungsgebühr	0.22%
TER (gemäss KGAST)	0.43%
Spread	0.10%
Ausgabe/Rücknahme	Täglich
Anzahl Schuldner	22
Off-BM Positionen	0.02%

Weitere Informationen unter www.zurichinvest.ch

Laufzeiten (in %)

	Zurich
>10 Jahre	30.09
7-10 Jahre	12.78
5-7 Jahre	13.40
3-5 Jahre	19.31
1-3 Jahre	24.25
<1 Jahr	0.17

Sektoren (in %)



Rendite (netto in %, in CHF)

	Zurich	Benchmark
1 Monat	0.25	0.26
3 Monate	0.16	0.23
Laufjahr	-0.17	-0.02
1 Jahr p.a.	-2.13	-1.94
5 Jahre p.a.	2.07	2.41
10 Jahre p.a.	1.76	2.04
Seit Ausgabe p.a.	0.78	1.20

Volatilität (in %)

	Zurich	Benchmark
1 Jahr p.a.	2.75	2.74
5 Jahre p.a.	7.06	7.02
10 Jahre p.a.	11.33	11.65
Seit Ausgabe p.a.	10.29	10.57

Risikokennzahlen seit Erstausgabe

	Zurich	Benchmark
Sharpe Ratio	0.01	0.05
Tracking Error p.a.	1.32	-
Information Ratio	-0.32	-
Jensen's Alpha (in %)	-0.40	-
Maximalverlust (in %)	38.01	39.82
Erholungsdauer*	41	51
Modified Duration	7.71	7.71

*) in Monaten

Rating (in %)

	Zurich
AAA	12.32
AA	52.39
A	21.16
BBB	13.25
BB	0.39

Risikokennzahlen für weitere Zeitperioden

	1 Jahr p.a.	5 Jahre p.a.	10 Jahre p.a.	Seit Ausgabe p.a.
Sharpe Ratio	-0.51	0.35	0.14	0.01
Tracking Error p.a.	0.16	0.41	0.79	1.32
Tracking Error Ex Ante	0.07	-	-	-
Information Ratio	-1.20	-0.83	-0.36	-0.32
Jensen's Alpha (in %)	-0.19	-0.35	-0.23	-0.40

Übersicht Nettoerenditen (in %)

	Jan	Feb	Mrz	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	YTD
2017	-0.96	0.71	-0.33	0.48	0.22	-0.50	0.05	0.78	-0.86	0.25			-0.17
2016	4.68	-2.21	0.26	-0.29	0.49	2.09	0.17	-0.56	-0.24	-1.53	-1.96	-0.01	0.70
2015	-4.61	1.05	3.14	-4.18	0.19	-1.93	4.03	0.43	2.03	0.52	3.88	-2.67	1.40
2014	3.56	-2.53	-0.08	0.28	2.58	-0.96	2.38	1.94	3.65	1.67	1.15	3.25	18.01
2013	-1.35	3.14	1.58	-0.88	1.28	-3.08	-1.88	-0.39	-2.05	0.66	-0.58	-2.75	-6.31
2012	-0.70	-2.31	-0.39	1.73	9.04	-2.96	4.60	-2.52	-1.40	-1.02	0.02	-1.70	1.76
2011	0.72	-1.19	-1.69	-3.81	-0.32	-1.64	-4.52	4.87	14.20	-4.65	4.20	3.64	8.64
2010	3.52	1.88	-2.41	3.35	8.50	-4.24	-1.94	-1.04	-3.71	0.43	0.49	-8.26	-4.40
2009	5.48	-0.11	-0.04	-1.78	-6.94	1.88	-0.39	-0.82	-0.99	-1.27	-0.56	0.25	-5.56
2008	-1.51	-2.95	-4.64	3.43	-1.11	-1.75	3.22	5.84	2.21	3.11	9.65	-8.90	5.36
2007	1.97	-0.55	-0.13	-0.68	0.62	-0.19	-0.27	1.80	-2.91	0.13	0.15	0.25	0.12

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.

² Spread: Abrechnung zu einem festen Ausgabeaufschlag bzw. Rücknahmeabschlag (Verwässerungsschutz der Fondsp performance)

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.