

Zurich fondation de placement

Obligations Monde Index

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

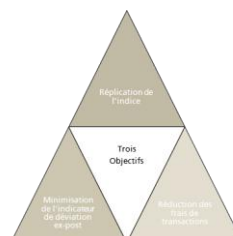
- **Module pour une mise en œuvre flexible de la stratégie de placement d'une caisse de pension;**
- **Placements largement diversifiés et transparents;**
- **Processus indépendant de gestion des investissements remplissant les critères de compliance les plus élevés;**
- **Conditions attrayantes**

Univers de placement

Le groupe de placement investit de préférence dans des titres à revenu fixe qui entrent dans la composition du Citigroup World Government Bond (ex Switzerland). Il réplique l'indice de référence, c'est-à-dire qu'il cherche à égaler dans la mesure du possible, avant déduction des frais, la performance de l'indice de référence. Le groupe de placement bénéficie de la meilleure couverture possible.

Processus de placement

Philosophie d'investissement et objectifs



Contrôle des risques

- Réplication optimale de l'indice
- Systèmes propriétaires d'indexation et de gestion du risque
- Pas de risque de contrepartie car achats effectifs d'obligations, pas d'emprunt de titres
- Surveillance et contrôle indépendants du gérant de fortune

Valeur ajoutée

- Commerce intelligent en cas de modifications des indices
- Maximisation de la valeur dans le cadre de hausses de la valeur
- Minimisation des frais de transactions par une réplication optimale de l'indice

Manager

UBS AG, Global Asset Management

UBS Global Asset Management, une division d'UBS SA, figure parmi les plus grands gérants de fortune du monde et propose des solutions de placement pour la clientèle privée, les intermédiaires financiers et les investisseurs institutionnels dans le monde entier. UBS Global Asset Management, qui emploie près de 3'500 personnes dans 25 pays, mérite vraiment le qualificatif d'entreprise multinationale.

Obligations Monde Index

Le groupe de placement «Indice obligataire mondial» investit dans des titres à revenu fixe qui entrent dans la composition du Citigroup World Government Bond Index (ex Switzerland). Il réplique l'indice de référence, c'est-à-dire qu'il cherche à égaler dans la mesure du possible, avant déduction des frais, la performance de l'indice de référence (nouvelle valeur de référence au 24 février 2016).

Données au 31.10.2017

Caractéristiques

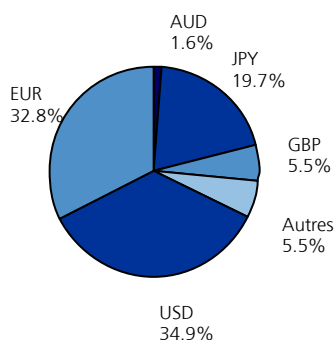
Manager	UBS AG
ISIN	CH0007227322
Bloomberg Ticker	ZOBLUSD SW
Référence	Citigroup WGBI ex Switzerland
Emission	01.2001
Exercice	1.1. - 31.12.
Currency	CHF
Monnaies investies	Hedged en CHF
Volume (en mio.)	0.63
Valeur d'inventaire	1,158.99
Frais de gestion	0.22%
TER (selon CAFI)	0.43%
Spread	0.10%
Achat / vente	Journalier
Nombre de débiteurs	22
Positions hors BM	0.02%

Informations supplémentaires sur www.zurich-fondation.ch

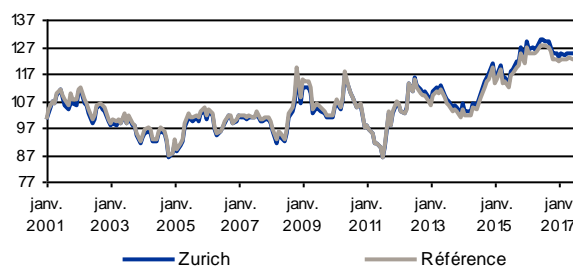
Durées (en %)

	Zurich
>10 Ans	30.09
7-10 Ans	12.78
5-7 Ans	13.40
3-5 Ans	19.31
1-3 Ans	24.25
<1 Année	0.17

Secteurs (en %)



Performance (brute, indexée)



Performance (nette en %, en CHF)

	Zurich	Référence
1 mois	0.25	0.26
3 mois	0.16	0.23
Année en cours	-0.17	-0.02
1 an p.a.	-2.13	-1.94
5 ans p.a.	2.07	2.41
10 ans p.a.	1.76	2.04
Depuis le lancement	0.78	1.20

Risque (en %)

	Zurich	Référence
1 an p.a.	2.75	2.74
5 ans p.a.	7.06	7.02
10 ans p.a.	11.33	11.65
Depuis le lancement	10.29	10.57

Données de risques depuis lancement

	Zurich	Référence
Sharpe Ratio	0.01	0.05
Tracking Error p.a.	1.32	-
Ratio d'information	-0.32	-
Jensen's Alpha (en %)	-0.40	-
Perte maximale (en %)	38.01	39.82
Période de reprise*	41	51
Duration modifiée	7.71	7.71

*) en mois

Rating (en %)

	Zurich
AAA	12.32
AA	52.39
A	21.16
BBB	13.25
BB	0.39

Données de risques

	1 an p.a.	5 ans p.a.	10 ans p.a.	Depuis le
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	-	-	-
Ratio d'information	-1.20	-0.83	-0.36	-0.32
Jensen's Alpha (en %)	-0.19	-0.35	-0.23	-0.40

Aperçu de rendements (nets en %, en CHF)

	Jan	Fév	Mar	Avr	Mai	Jui	Jui	Aoû	Sep	Oct	Nov	Déc	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 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.

² 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.