

Staatsanleihen Fremdwährungen hedged Indexiert

AVADIS

Avadis Anlagestiftung

Daten per 31.3.2024

Anlagestil

Die Anlagegruppe investiert über Zielfonds in auf fremde Währungen lautende variable und festverzinsliche Forderungen von ausländischen staatlichen Schuldern, die in der Benchmark enthalten sind oder deren Aufnahme in der Benchmark angekündigt wurde. Unterjährige Anlagen sind erlaubt. Sie gelten nicht als benchmarkfremd. Es werden keine Investitionen in Staaten auf der Empfehlungsliste zum Ausschluss des SVVK-ASIR getätigt. Die Anlagegruppe ist indexnah ausgerichtet. Fremdwährungsrisiken werden abgesichert.

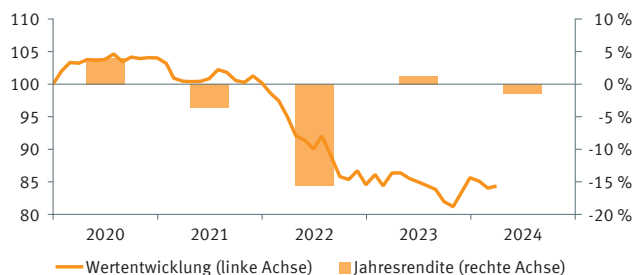
Charakteristika

	Staatsanleihen Fremdwährungen hedged Indexiert
Bezeichnung	Staatsanleihen Fremdwährungen hedged Indexiert
Benchmark	FTSE WGBI ex Schweiz hedged in CHF
ISIN/Valor	CH0017351195 / 1735119
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	01.12.2003
Erstmissionspreis in CHF	100'000
Rechnungsjahr	01.11 - 31.10
Letzte Ausschüttung	thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	wöchentlich
Ausgabespread in %	0.09
Rücknahmespread in %	0.02
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0.27
Vermögensverwalter	Amundi Asset Management
Kurspublikation	Bloomberg (AVAOBFH SW)
Wert pro Anspruch in CHF	88'941,37
Anzahl Ansprüche	3'955,13
Vermögen in CHF	351'774'402,71
Anzahl Titel im Portfolio	1'160
Modified Duration	7,40

Risikokennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe in %	5,16	5,08	4,19
Volatilität Benchmark in %	5,13	5,07	4,17
Tracking Error p.a. in %	0,29	0,27	0,25
Alpha p.a. in %	-0,68	-0,45	-0,41
Beta	1,00	1,00	1,00
Sharpe Ratio	-0,73	-0,55	-0,11
Information Ratio	-2,33	-1,64	-1,65
Max. DrawDown in %	-6,01	-22,41	-22,41
Max. Erholungsdauer in Tagen	337	1'340	1'340

Wertentwicklung



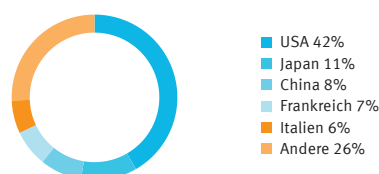
Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	0,38	0,44
3 Monate	-1,49	-1,30
1 Jahr	-2,32	-1,64
5 Jahre (p.a.)	-3,00	-2,55
10 Jahre (p.a.)	-0,87	-0,47
Seit Beginn (p.a.)	0,83	1,29
2020	4,01	4,47
2021	-3,67	-3,37
2022	-15,61	-15,22
2023	1,27	1,89
2024 (01.01-31.03)	-1,49	-1,30

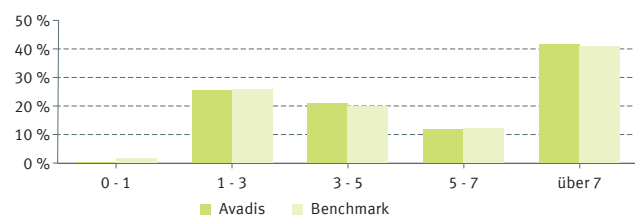
Schuldnerkategorien



Länderaufteilung



Fälligkeit in Jahren



Die auf diesem Faktenblatt enthaltenen Angaben gelten nicht als Angebot und dienen lediglich Marketing- und Informationszwecken. Für die Richtigkeit und Vollständigkeit des Inhalts wird keine Haftung oder Gewähr übernommen. Anlagen sollen erst nach Lektüre der Anlagerichtlinien, des Prospekts, der Zeichnungsbedingungen sowie in Abstimmung mit der Anlagestrategie der Pensionskasse getätigt werden. Die Ausführung und Übermittlung von Kundenaufträgen erfolgt ohne Beratung und Empfehlung durch Avadis, sog. «Execution-only»-Transaktionen. Avadis führt weder eine Angemessenheits- noch eine Eignungsprüfung durch. Die erwähnten Dokumente können bei der Avadis Anlagestiftung kostenlos bezogen werden.

Avadis Anlagestiftung

c/o Avadis Vorsorge AG | Zollstrasse 42 | Postfach | 8031 Zürich | T +41 58 585 33 55 | info@avadis.ch | www.avadis.ch

Für Marketingzwecke