

Emprunts d'État monnaies étrangères hedged indexées

AVADIS

Avadis Fondation d'investissement

Données au 30.4.2024

Style de gestion

Le groupe de placement investit par le biais de fonds cibles dans des titres de créance à revenu variable et fixe en monnaies étrangères d'États étrangers, compris dans l'indice de référence ou dont l'admission dans l'indice est annoncée. Les placements à un an au plus sont permis. Ils sont considérés comme titres entrant dans la composition de l'indice. Aucun investissement n'est effectué dans des États figurant sur la liste d'exclusions recommandées de l'ASIR. Le groupe de placement est aligné sur l'indice. Les risques de change sont couverts.

Caractéristiques

Désignation	Emprunts d'État monnaies étrangères hedged indexées
Indice de référence	FTSE WGBI ex Schweiz hedged in CHF
ISIN/Valeur	CH0017351195 / 1735119
Monnaie de compte	CHF
Première émission	01.12.2003
Prix de la première émission en CHF	100'000
Exercice comptable	01.11 - 31.10
Dernière distribution	Capitalisation
Édition/Reprise	hebdomadaire
Commission de souscription en %	0.09
Commission de rachat en %	0.02
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. en %	0.27
Gérants de fortune	Amundi Asset Management
Publication des cours	Bloomberg (AVA0BFH SW)
Valeur d'inventaire par part en CHF	87'113,55
Nombre de parts	3'993,26
Fortune en CHF	347'867'414,80
Nombre de titres dans le portefeuille	1'241
Modified Duration	6,96

Données du risque

	1 an	5 ans	10 ans
Volatilité Groupe de placement en %	5,47	5,14	4,23
Volatilité Indice de référence en %	5,46	5,14	4,21
Tracking Error p.a. en %	0,27	0,27	0,25
Alpha p.a. en %	-1,50	-0,46	-0,41
Beta	1,00	1,00	1,00
Sharpe Ratio	-1,06	-0,60	-0,17
Information Ratio	-5,48	-1,67	-1,64
Max. drawdown en %	-6,01	-22,41	-22,41
Max. recovery time en jours	367	1'370	1'370

Evolution de la valeur



Performance en %

	Avadis	Indice de référence
1 mois	-2,06	-2,01
3 mois	-2,89	-2,64
1 an	-4,34	-3,64
5 ans (p.a.)	-3,31	-2,85
10 ans (p.a.)	-1,13	-0,72
Depuis le début (p.a.)	0,73	1,18
2020	4,01	4,47
2021	-3,67	-3,37
2022	-15,61	-15,22
2023	1,27	1,89
2024 (01.01-30.04)	-3,51	-3,28

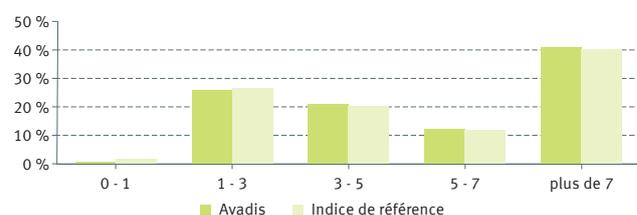
Catégories de débiteurs



Répartition par pays



Echéance en années



Les informations contenues dans cette fiche ne constituent pas une offre et sont fournies uniquement à des fins de marketing et d'information. Toute responsabilité ou garantie quant à l'exactitude et l'exhaustivité du contenu est rejetée. Les placements doivent être exécutés uniquement après lecture des directives de placement, du prospectus, des conditions de souscription, ainsi que conformément à la stratégie de placement de la caisse de pension. Les mandats du client sont exécutés et transmis sans conseil ni recommandation de la part d'Avadis – transactions dites «execution-only». Avadis ne procède à aucune vérification du caractère approprié ou de l'adéquation. Les documents mentionnés peuvent être obtenus gratuitement auprès d'Avadis Fondation d'investissement.

Avadis Fondation d'investissement

c/o Avadis Prévoyance SA | Zollstrasse 42 | Case postale | 8031 Zürich | T +41 58 585 33 55 | info@avadis.ch | www.avadis.ch

A des fins de marketing