

Staatsanleihen Fremdwährungen AAA-AA hedged Indexiert

AVADIS

Avadis Anlagestiftung

Daten per 31.3.2024

Anlagestil

Die Anlagegruppe investiert über Zielfonds in Forderungen von ausländischen staatlichen Schuldern in fremden Währungen, die in der Benchmark enthalten sind oder deren Aufnahme in der Benchmark angekündigt wurde. Das minimale Kreditrating eines Titels im Portfolio ist AA- (S&P). 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.

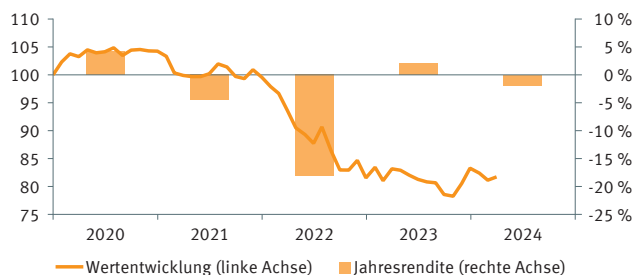
Charakteristika

Bezeichnung	Staatsanleihen Fremdwährungen AAA-AA hedged Indexiert
Benchmark	Bloomberg Global Government AAA-AA Capped ex CH hedged in CHF
ISIN/Valor	CH0240423613 / 24042361
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	12.08.2014
Erstmissionspreis in CHF	100'000
Rechnungsjahr	01.11 - 31.10
Letzte Ausschüttung	thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	wöchentlich
Ausgabespread in %	0.08
Rücknahmespread in %	0.02
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0.31
Vermögensverwalter	Amundi Asset Management
Kurspublikation	Bloomberg (AVAFHA SW)
Wert pro Anspruch in CHF	86'650,04
Anzahl Ansprüche	2'245,66
Vermögen in CHF	194'586'596,25
Anzahl Titel im Portfolio	672
Modified Duration	7,65

Risikokennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe in %	6,02	6,28	n.a.
Volatilität Benchmark in %	5,95	6,25	n.a.
Tracking Error p.a. in %	0,20	0,24	n.a.
Alpha p.a. in %	-0,40	-0,31	n.a.
Beta	1,01	1,00	n.a.
Sharpe Ratio	-0,53	-0,56	n.a.
Information Ratio	-2,01	-1,26	n.a.
Max. DrawDown in %	-5,90	-25,36	n.a.
Max. Erholungsdauer in Tagen	245	1'340	n.a.

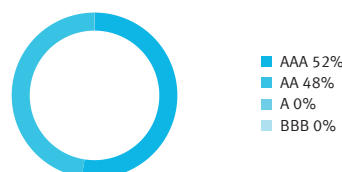
Wertentwicklung



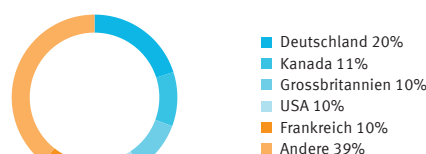
Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	0,73	0,77
3 Monate	-1,87	-1,80
1 Jahr	-1,74	-1,34
5 Jahre (p.a.)	-3,72	-3,42
10 Jahre (p.a.)	n.a.	n.a.
Seit Beginn (p.a.)	-1,47	-1,09
2020	4,24	4,64
2021	-4,49	-4,17
2022	-18,11	-17,78
2023	2,13	2,34
2024 (01.01-31.03)	-1,87	-1,80

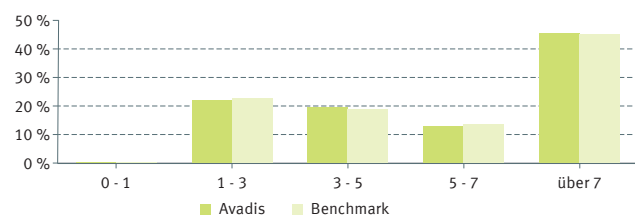
Schuldnerkategorien



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