

Obligations CHF étranger

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, libellés en CHF de débiteurs privés ou de droit public domiciliés à l'étranger, compris dans l'indice de référence ou dont l'admission dans l'indice est annoncée. Les titres de créance à un an sont aussi admis comme titres entrant dans la composition de l'indice. Aucun investissement n'est effectué dans des titres figurant sur la liste d'exclusions recommandées de l'ASIR ni dans les armes interdites. Le groupe de placement est aligné sur l'indice.

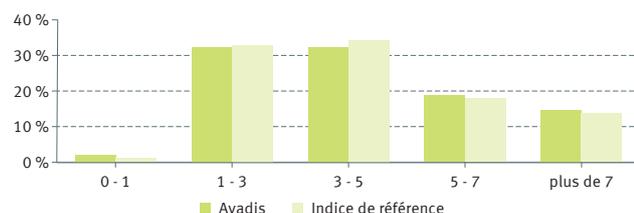
Caractéristiques

| | |
|---|--------------------------|
| Désignation | Obligations CHF étranger |
| Indice de référence | SBI Foreign AAA - BBB |
| ISIN/Valeur | CH0008211564 / 821156 |
| Monnaie de compte | CHF |
| Première émission | 01.06.1999 |
| 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 % | 0.50 |
| Commission de rachat en % | 0.00 |
| Total Expense Ratio (ex ante) p.a. en % | 0.26 |
| Gérants de fortune | SYZ Asset Management AG |
| Publication des cours | Bloomberg (AVAOCHA SW) |
| Valeur d'inventaire par part en CHF | 108'713,43 |
| Nombre de parts | 5'927,11 |
| Fortune en CHF | 644'356'186,55 |
| Nombre de titres dans le portefeuille | 328 |
| Modified Duration | 4,20 |

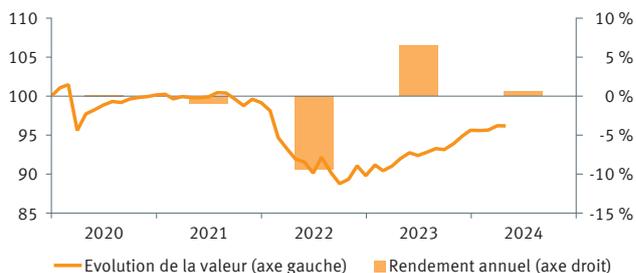
Catégories de débiteurs



Echéance en années



Evolution de la valeur



Performance en %

| | Avadis | Indice de référence |
|------------------------|--------|---------------------|
| 1 mois | -0,01 | 0,01 |
| 3 mois | 0,62 | 0,65 |
| 1 an | 4,55 | 4,59 |
| 5 ans (p.a.) | -0,65 | -0,75 |
| 10 ans (p.a.) | 0,16 | 0,24 |
| Depuis le début (p.a.) | 1,51 | 1,92 |
| 2020 | 0,15 | 0,30 |
| 2021 | -0,99 | -0,72 |
| 2022 | -9,44 | -9,38 |
| 2023 | 6,48 | 5,23 |
| 2024 (01.01-30.04) | 0,59 | 0,66 |

Données du risque

| | 1 an | 5 ans | 10 ans |
|-------------------------------------|-------|--------|--------|
| Volatilité Groupe de placement en % | 1,58 | 4,41 | 3,32 |
| Volatilité Indice de référence en % | 1,52 | 4,19 | 3,18 |
| Tracking Error p.a. en % | 0,12 | 0,58 | 0,42 |
| Alpha p.a. en % | 0,75 | 0,10 | -0,08 |
| Beta | 1,03 | 1,04 | 1,04 |
| Sharpe Ratio | 1,94 | -0,10 | 0,18 |
| Information Ratio | 6,30 | 0,18 | -0,19 |
| Max. drawdown en % | -0,37 | -13,10 | -13,10 |
| Max. recovery time en jours | 34 | 1'705 | 1'705 |

Positions principales en %

| | |
|-----------------------------------|------|
| 2.875% Okb Feb30 25.02.2030 | 1,56 |
| 2 1/2 Kfw Aug25 25.08.2025 | 1,04 |
| 1/4 New York Oct27 18.10.2027 | 0,91 |
| 1/8 NY LIFE SEP29 REGS 11.09.2029 | 0,84 |
| 3 1/8 Eib Jun36 30.06.2036 | 0,83 |

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