

Staatsanleihen Fremdwährungen AAA-AA hedged Indexiert

AVADIS

Avadis Anlagestiftung | August 2020

Anlagestil

Die Anlagegruppe ist indexnah ausgerichtet. Sie investiert in auf fremde Währungen lautende variable und festverzinsliche Forderungen ausländischen Staaten, die in der Benchmark enthalten sind oder deren Aufnahme in die Benchmark angekündigt wurde. Unterjährige Anlagen sind erlaubt. Sie gelten nicht als benchmarkfremd. Die Indexierung erfolgt nach der Methode des Stratified Samplings. Der maximale Tracking Error über einen Zeitraum von drei Jahren darf 0.5% nicht überschreiten.

Charakteristika

Bezeichnung	Staatsanleihen Fremdwährungen AA
Benchmark	BB Barcl Global Gov AAA-AA Capped
ISIN / Valor	CH0240423613 / 24042361
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	12.8.2014
Erstmissionspreis	CHF 100 000
Rechnungsjahr	01.11. - 31.10.
Letzte Ausschüttung	Thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	Wöchentlich
Ausgabespread in %	0,11
Rücknahmespread in %	0,00
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0,39
Vermögensverwalter	Amundi
Kurspublikation	Bloomberg(AVAOFHA SW), Telekurs
NAV pro Anspruch in CHF	109 715.45
Anzahl Ansprüche	5 281.7497
Vermögen in CHF	579 489 545
Anzahl Titel im Portfolio	312
Modified Duration	8,70

Risikozahlen

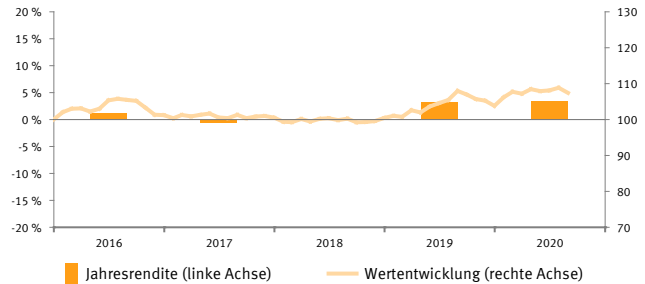
	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe p.a. in %	n.a.	n.a.	n.a.
Volatilität Benchmark p.a. in %	n.a.	n.a.	n.a.
Tracking Error p.a. in %	n.a.	n.a.	n.a.
Alpha p.a. in %	n.a.	n.a.	n.a.
Beta	n.a.	n.a.	n.a.
Sharpe Ratio	n.a.	n.a.	n.a.
Information Ratio	n.a.	n.a.	n.a.
Max. Drawdown	5.02	6.75	n.a.
Recovery	1,05	0,90	n.a.

Das Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken. Der Inhalt des Dokuments ist sorgfältig zusammengestellt. Dennoch kann Avadis keine Gewähr für Inhalt und Vollständigkeit dieses Dokumentes übernehmen. Die historischen Renditeangaben geben keine Garantie für zukünftige Ergebnisse. Die Ausgabe- und Rücknahmespreads können vorübergehend und ohne Vorankündigung angepasst werden, wenn dies ausserordentliche Marktumstände erfordern. Es kann bei den Anlagegruppen der Avadis unter anderem zu Überschneidungen der Emittenten kommen. Als Anleger sind nur die in der Schweiz domizilierten, steuerbefreiten Vorsorgeeinrichtungen zugelassen.

Avadis Anlagestiftung

Zollstrasse 42 | Postfach 1077 | 8005 Zürich | T 058 585 33 55 | F 058 585 61 74 | info@avadis.ch | www.avadis.ch

Wertentwicklung



Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	-1,31	-1,32
3 Monate	-0,46	-0,37
1 Jahr	-0,51	-0,15
5 Jahre (p.a.)	1,39	1,89
10 Jahre (p.a.)	n.a.	n.a.
seit Beginn (p.a.)	1,54	1,98
2016	1,23	2,31
2017	-0,68	-0,62
2018	-0,07	0,17
2019	3,33	3,77
2020 (01.01-31.08)	3,47	3,80

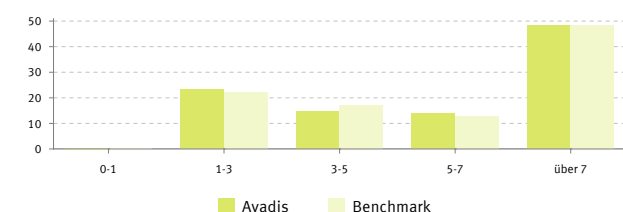
Schuldnerkategorien in %



Länderaufteilung in %



Fälligkeit in %



Daten per 31.08.20