

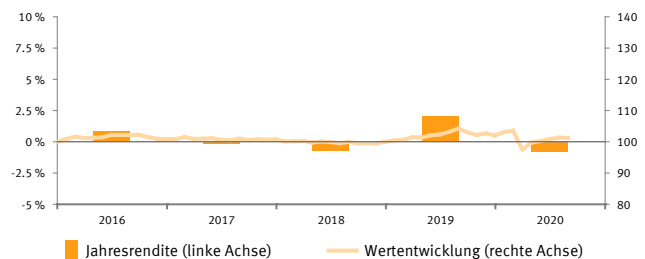
Obligationen CHF Auslandschuldner

Avadis Anlagestiftung | August 2020

Anlagestil

Die Anlagegruppe ist indexnah ausgerichtet. Sie investiert in auf Schweizer Franken lautende variable und festverzinsliche Forderungen von öffentlich-rechtlichen und privaten Schuldern mit Domizil im Ausland, die in der Benchmark enthalten sind oder deren Aufnahme in die Benchmark angekündigt wurde. Unterjährige Forderungen sind erlaubt. Sie gelten nicht als benchmarkfremd.

Wertentwicklung



Charakteristika

Bezeichnung	Obligationen CHF Auslandschuldner
Benchmark	SBI Foreign AAA - BBB
ISIN / Valor	CH0008211564 / 821156
Rechnungswährung	CHF
Erstemission	1.6.1999
Erstemissionspreis	CHF 100 000
Rechnungsjahr	1.11. - 31.10.
Letzte Ausschüttung	Thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	Wöchentlich
Ausgabespread in %	0,40
Rücknahmespread in %	0,00
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0,26
Vermögensverwalter	Bank Syz
Kurspublikation	Bloomberg (AVAOCHA SW), Telekurs

NAV pro Anspruch in CHF	112 111.66
Anzahl Ansprüche	7 206.8906
Vermögen in CHF	807 976 469
Anzahl Titel im Portfolio	321
Modified Duration	4,80

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	7.97	7.97	7.97
Recovery	0,68	0,68	0,68

Grösste Positionen in %

Oest Kontrollbank AG	2,00
European Investment Bank	1,40
Credit Suisse Group	1,40
Russian Federation	1,30
JPMorgan Chase & Co	1,00

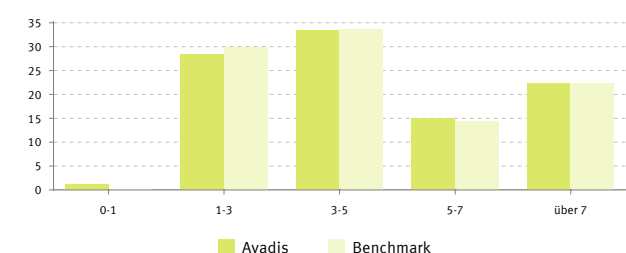
Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	-0,12	-0,12
3 Monate	0,95	0,99
1 Jahr	-2,90	-2,84
5 Jahre (p.a.)	0,21	0,44
10 Jahre (p.a.)	1,28	1,58
seit Beginn (p.a.)	1,92	2,44
2016	0,85	1,09
2017	-0,12	0,21
2018	-0,70	-0,33
2019	2,01	2,13
2020 (01.01-31.08)	-0,81	-0,80

Schuldnerkategorien in %



Fälligkeit in %



Daten per 31.08.20

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.