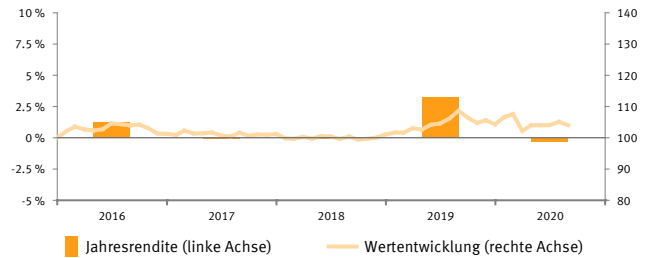


Anlagestil

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

Wertentwicklung



Charakteristika

Bezeichnung	Obligationen CHF Inlandschuldner
Benchmark	SBI Domestic AAA - BBB
ISIN / Valor	CH0009358794 / 935879
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	1.1.1995
Erstmissionspreis	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	Lombard Odier Asset Management, Bank Syz
Kurspublikation	Bloomberg (AVAOCHI SW), Telekurs
Wert pro Anspruch in CHF	137 182,70
Anzahl Ansprüche	8 572.3567
Vermögen in CHF	1 175 979 037
Anzahl Titel im Portfolio	643
Modified Duration	8,56

Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	-1,00	-1,01
3 Monate	0,02	0,01
1 Jahr	-4,22	-4,17
5 Jahre (p.a.)	0,74	0,92
10 Jahre (p.a.)	1,72	1,97
seit Beginn (p.a.)	3,32	3,58
2016	1,26	1,46
2017	-0,09	0,10
2018	-0,10	0,20
2019	3,24	3,37
2020 (01.01-31.08)	-0,30	-0,28

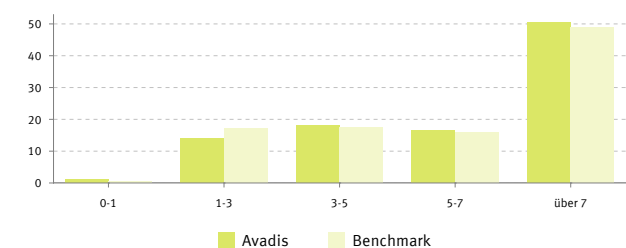
Schuldnerkategorien in %



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 in %	6,65	6,65	6,65
Recovery	1,23	1,23	1,23

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 domizilieren, steuerbefreiten Vorsorgeeinrichtungen zugelassen.