

# Staatsanleihen Fremdwährungen AAA-AA hedged Indexiert

AVADIS

Avadis Anlagestiftung

Daten per 31.10.2021

## 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.

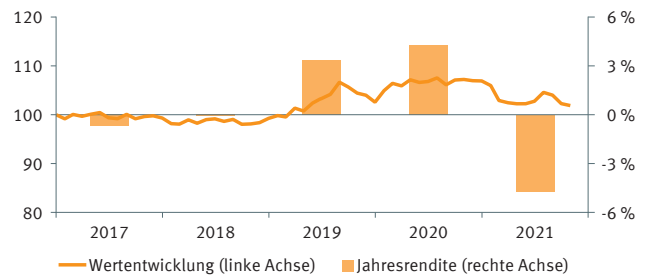
## Charakteristika

Bezeichnung	Staatsanleihen Fremdwährungen AAA-AA hedged Indexiert
Benchmark	Bloomberg Barclays Global Gov AAA-AA Capped ex CH hCHF
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 %	0.11
Rücknahmespread in %	0.01
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0.28
Vermögensverwalter	Amundi Asset Management
Kurspublikation	Bloomberg (AVAFHA SW), Telekurs
Wert pro Anspruch in CHF	105'320,47
Anzahl Ansprüche	5'306,49
Vermögen in CHF	558'881'535,84
Anzahl Titel im Portfolio	403
Modified Duration	8,70

## Risikokennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe in %	3,89	3,52	n.a.
Volatilität Benchmark in %	3,90	3,67	n.a.
Tracking Error p.a. in %	0,10	0,37	n.a.
Alpha p.a. in %	-0,17	-0,33	n.a.
Beta	1,00	0,95	n.a.
Sharpe Ratio	-1,07	0,22	n.a.
Information Ratio	-1,64	-0,89	n.a.
Max. DrawDown in %	-4,99	-5,27	n.a.
Max. Erholungsdauer in Tagen	366	912	n.a.

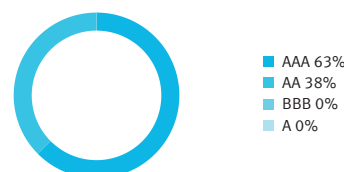
## Wertentwicklung



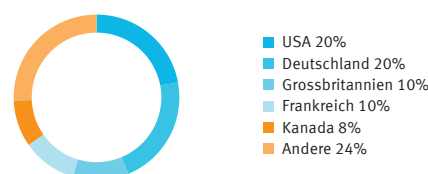
## Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	-0,39	-0,40
3 Monate	-2,58	-2,60
1 Jahr	-4,99	-4,82
5 Jahre (p.a.)	-0,03	0,29
10 Jahre (p.a.)	n.a.	n.a.
seit Beginn (p.a.)	0,72	1,12
2017	-0,68	-0,62
2018	-0,07	0,17
2019	3,33	3,77
2020	4,24	4,64
2021 (01.01-31.10)	-4,72	-4,59

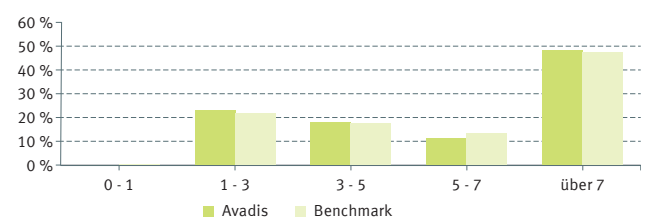
## Schuldnerkategorien



## 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 1077 | 8005 Zürich | +41 58 585 33 55 | info@avadis.ch | www.avadis.ch

Für Marketingzwecke