

# Obligationen CHF Auslandschuldner **AVADIS**

Avadis Anlagestiftung

Daten per 31.10.2021

## 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.

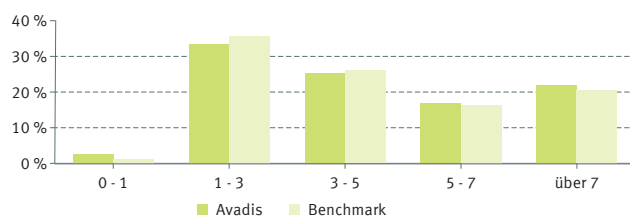
## Charakteristika

Bezeichnung	Obligationen CHF Auslandschuldner
Benchmark	SBI Foreign AAA - BBB
ISIN/Valor	CH0008211564 / 821156
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	01.06.1999
Erstmissionspreis in CHF	100'000
Rechnungsjahr	01.11.-31.10.
Letzte Ausschüttung	thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	wöchentlich
Ausgabespread in %	0.60
Rücknahmespread in %	0.00
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0.26
Vermögensverwalter	SYZ Asset Management AG
Kurspublikation	Bloomberg (AVAOCHA SW), Telekurs
Wert pro Anspruch in CHF	111'633,82
Anzahl Ansprüche	7'313,32
Vermögen in CHF	816'414'039,77
Anzahl Titel im Portfolio	343
Modified Duration	4,71

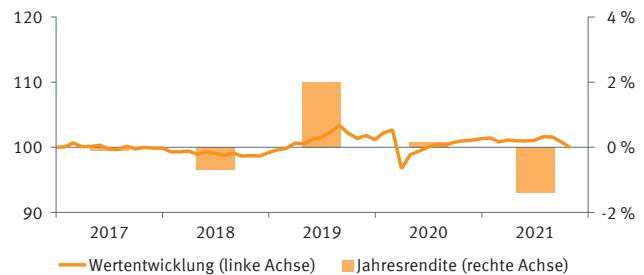
## Schuldnerkategorien



## Fälligkeit in Jahren



## Wertentwicklung



## Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	-0,88	-0,86
3 Monate	-1,67	-1,58
1 Jahr	-1,06	-0,73
5 Jahre (p.a.)	-0,13	0,11
10 Jahre (p.a.)	1,11	1,38
seit Beginn (p.a.)	1,80	2,31
2017	-0,12	0,21
2018	-0,70	-0,33
2019	2,01	2,13
2020	0,15	0,30
2021 (01.01-31.10)	-1,38	-1,15

## Risikokennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe in %	1,50	3,25	2,72
Volatilität Benchmark in %	1,52	3,25	2,72
Tracking Error p.a. in %	0,07	0,08	0,10
Alpha p.a. in %	-0,32	-0,24	-0,27
Beta	0,99	1,00	1,00
Sharpe Ratio	-0,17	0,20	0,61
Information Ratio	-4,98	-3,10	-2,72
Max. DrawDown in %	-1,67	-6,42	-6,42
Max. Erholungsdauer in Tagen	151	793	974

## Größte Positionen in %

2 7/8 Okb Feb30 25.02.2030	1,60
3 1/8 Eib Jun36 30.06.2036	1,30
1.45% Gaz Capital Mar23 06.03.2023	1,30
3/8 Apple Nov24 25.11.2024	1,00
1/2 Jp Morgan Dec23 04.12.2023	1,00

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