

Obligationen CHF Auslandschuldner **AVADIS**

Avadis Anlagestiftung

Daten per 31.3.2024

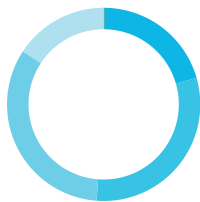
Anlagestil

Die Anlagegruppe investiert über Zielfonds 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 der Benchmark angekündigt wurde. Unterjährige Forderungen sind erlaubt. Sie gelten nicht als benchmarkfremd. Es werden keine Investitionen in Titel auf der Empfehlungsliste zum Ausschluss des SVVK-ASIR sowie geächtete Waffen getätigt. Die Anlagegruppe ist indexnah ausgerichtet.

Charakteristika

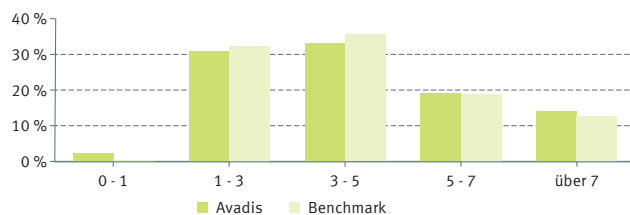
Bezeichnung	Obligationen CHF Auslandschuldner
Benchmark	SBI Foreign AAA - BBB
ISIN/Valor	CH0008211564 / 821156
Rechnungswährung	CHF
Erstmission	01.06.1999
Erstmissionspreis in CHF	100'000
Rechnungsjahr	01.11 - 31.10
Letzte Ausschüttung	thesaurierend
Ausgabe/Rücknahme	wöchentlich
Ausgabespread in %	0.50
Rücknahmespread in %	0.00
Total Expense Ratio (ex ante) p.a. in %	0.26
Vermögensverwalter	SYZ Asset Management AG
Kurspublikation	Bloomberg (AVAOCHA SW)
Wert pro Anspruch in CHF	108'725,80
Anzahl Ansprüche	5'906,10
Vermögen in CHF	642'144'930,34
Anzahl Titel im Portfolio	329
Modified Duration	4,30

Schuldnerkategorien

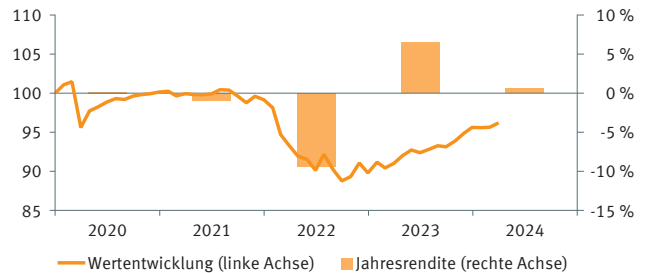


AAA	21%
AA	31%
A	33%
BBB	16%
BB	0%
B	0%

Fälligkeit in Jahren



Wertentwicklung



Performance in %

	Avadis	Benchmark
1 Monat	0,58	0,58
3 Monate	0,60	0,65
1 Jahr	5,69	5,42
5 Jahre (p.a.)	-0,66	-0,77
10 Jahre (p.a.)	0,21	0,29
Seit Beginn (p.a.)	1,52	1,93
2020	0,15	0,30
2021	-0,99	-0,72
2022	-9,44	-9,38
2023	6,48	5,23
2024 (01.01-31.03)	0,60	0,65

Risikokennzahlen

	1 Jahr	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität Anlagegruppe in %	1,66	4,41	3,32
Volatilität Benchmark in %	1,51	4,19	3,18
Tracking Error p.a. in %	0,29	0,58	0,42
Alpha p.a. in %	0,26	0,11	-0,08
Beta	1,08	1,04	1,04
Sharpe Ratio	2,52	-0,10	0,19
Information Ratio	0,89	0,19	-0,19
Max. DrawDown in %	-0,37	-13,10	-13,10
Max. Erholungsdauer in Tagen	34	1'675	1'675

Grösste Positionen in %

2.875% Okb Feb30 25.02.2030	1,60
2 1/2 Kfw Aug25 25.08.2025	1,00
1/4 New York Oct27 18.10.2027	0,90
3 1/8 Eib Jun36 30.06.2036	0,80
2.6175% SOC GEN FEB30 27.02.2030	0,80

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 | 8031 Zürich | T +41 58 585 33 55 | info@avadis.ch | www.avadis.ch

Für Marketingzwecke