

FWI Obligations Domestiques CHF

factsheet 08|20

Caractéristique

| | |
|-------------------------|-------------------------------------|
| Devise | CHF |
| ISIN | CH0009004539 |
| Numéro de valeur | 900453 |
| Bloomberg-ID | AWIOBSW |
| Intervalle d'évaluation | quotidienne |
| Emission/Rachat | quotidienne jusqu'à 12h |
| Date de lancement | 01.11.1999 |
| Indice de référence | SBI Domestic AAA-BBB Total Return |
| Gestion | AXA Investment Managers, Schweiz AG |
| Banque de dépôt | Bank Julius Bär & Co. AG |
| Auditeur | PricewaterhouseCoopers AG |

Données de référence

| | |
|----------------------|----------------|
| NAV (par 31.08.2020) | CHF 1'172.89 |
| Fortune | CHF 78'029'060 |
| Nombre de droits | 66'527.40 |
| Distribution | capitalisation |

Tarif

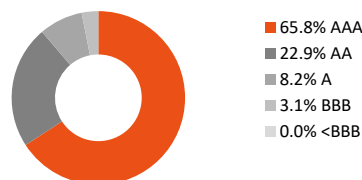
| | |
|----------------|--------|
| TER KGAST 2019 | 0.25%* |
|----------------|--------|

* Frais de base, détails voir dans le règlement tarifaire de la FWI

10 principaux positions

| | en % |
|---|-------|
| Bq de lettres gage suisses de crédit hypo. | 21.61 |
| Confédération suisse | 19.38 |
| Centrale de lettres gage des bq cant. suisses | 13.53 |
| Canton de Genève | 2.81 |
| Canton de Zurich | 2.65 |
| Ville de Zurich | 2.17 |
| Banque Cantonale de Zurich | 2.16 |
| Banque cantonal de Aargau | 2.13 |
| Ville de Lausanne | 1.70 |
| CCL p. construction de logements | 1.44 |

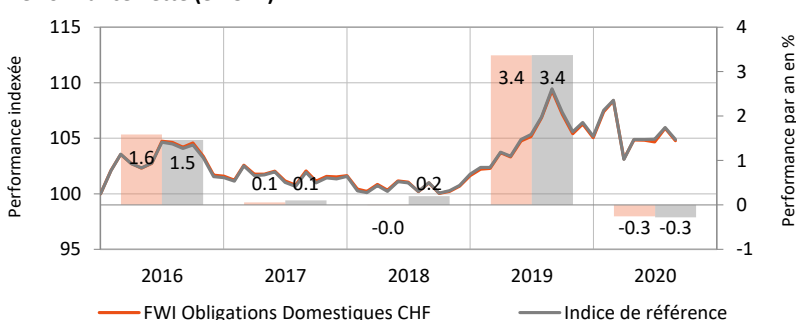
Répartition par rating



Politique de placement

Le groupe de placement FWI Obligations domestiques CHF investit dans des titres à revenu fixe en francs suisses (y compris emprunts convertibles et à options), émis par des collectivités de droit public ou des sociétés privées en Suisse ou à l'étranger. L'objectif du groupe de placement est de réaliser des revenus élevés et réguliers, tout en veillant à la sécurité du capital. Les placements sont sélectionnés de façon active par référence au SBI Dom. AAA-BBB TR. L'accent est mis tout particulièrement sur une solvabilité bonne à très bonne du débiteur. Une gestion active de la durée et de la courbe de rendement assortie d'une sélection des secteurs et des titres viennent compléter le profil de placement, offrant ainsi à l'investisseur un instrument pondéré pour la composante obligataire de ses placements.

Performance nette (en CHF)



Performance

| en % | 1 mois | 3 mois | YTD | 1 an | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | création p.a. |
|---------------------|--------|--------|-------|-------|------------|------------|---------------|
| Portefeuille | -1.06 | -0.03 | -0.26 | -4.13 | 0.88 | 0.88 | 2.93 |
| Indice de référence | -1.01 | 0.01 | -0.28 | -4.17 | 0.96 | 0.92 | 3.02 |

Nombres statistique en %

| | Portefeuille | Indice de référence |
|---|--------------|---------------------|
| Volatilité 1 an | 6.92 | 6.97 |
| Volatilité 3 ans | 4.60 | 4.63 |
| Tracking Error 1 Jahr | 0.30 | |
| Tracking Error 3 Jahre | 0.22 | |
| Value at Risk (niveau de confiance 95%) | 3.22 | |
| Sharpe Ratio (1 an/ base 0%) | -0.59 | -0.60 |
| Corrélation 1 an | 1.00 | 1.00 |
| Duration | 8.65 | 8.47 |
| Durée résiduelle en années | 9.13 | |
| Yield to Maturity | -0.14 | |

Répartition par rating/durée résiduelle en années

| en % | AAA | AA | A | BBB | <BBB | Total |
|--------------|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|---------------|
| 0-1 an | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.59 | 0.00 | 0.59 |
| 1-3 ans | 7.58 | 3.76 | 2.58 | 1.43 | 0.00 | 15.35 |
| 3-5 ans | 6.81 | 5.74 | 2.66 | 0.09 | 0.00 | 15.30 |
| 5-7 ans | 11.26 | 2.75 | 1.07 | 0.68 | 0.00 | 15.76 |
| 7-10 ans | 15.58 | 3.78 | 1.13 | 0.31 | 0.00 | 20.80 |
| 10+ ans | 24.60 | 6.88 | 0.72 | 0.00 | 0.00 | 32.20 |
| Total | 65.83 | 22.91 | 8.16 | 3.10 | 0.00 | 100.00 |

Informations générales: la vente de parts du groupe de placement repose sur les documents d'émission déterminants dans leur version en vigueur, en association avec le dernier rapport annuel ou, s'il est disponible, le dernier rapport semestriel du groupe de placement. Clause de non-responsabilité: le présent document a été établi par 1741 Fund Solutions AG (ci-après: «1741»). 1741 n'accorde aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité en cas de perte ou de dommages de quelque nature que ce soit, découlant directement ou indirectement de l'utilisation du présent document ou des informations qu'il contient. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de sa rédaction et peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Sauf mention contraire, l'ensemble des chiffres n'a pas été vérifié. Finalité informative uniquement: le présent document vise uniquement à informer son destinataire et ne constitue ni un conseil en placement, ni une offre ou une recommandation d'acheter des instruments financiers. Il ne dispense pas le destinataire de procéder à sa propre évaluation. Groupe cible: le présent document et les informations qu'il contient s'adressent exclusivement aux caisses de pension suisses. Par conséquent, ni le présent document, ni des copies de celui-ci ne peuvent être envoyés ou emportés aux États-Unis ou remis à des ressortissants américains, conformément à la Regulation S du US Securities Act de 1933. Restriction d'utilisation: ce document s'adresse expressément aux personnes dont la nationalité, le domicile ou d'autres motifs leur permettent d'accéder à de telles informations en vertu des lois en vigueur. En cas de doute, nous vous recommandons de contacter un point de vente ou un établissement bancaire local. Performance: chaque placement comporte des risques et en particulier des risques de fluctuations de la valeur et du rendement. Les placements sont volatils et un investissement peut également entraîner la perte totale des capitaux investis et d'éventuels rendements. De plus, les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais prélevés lors des émissions et/ou rachats. En outre, il est impossible de garantir que la performance de l'indice de référence sera atteinte, voire dépassée. Une évolution positive de la valeur par le passé ou l'indication d'une telle évolution ne saurait garantir l'évolution positive de la valeur à l'avenir. Les investissements dans des devises étrangères peuvent pâtir de fluctuations monétaires. Il existe également un risque que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Distribution en Suisse: en Suisse, ce groupe de placement ne peut être distribué qu'aux caisses de pension.