

FWI Obligations Domestiques CHF Redex

factsheet 08|20

Caractéristique

Devise	CHF
ISIN	CH0205340232
Numéro de valeur	20534023
Bloomberg-ID	AWIORDX
Intervalle d'évaluation	quotidienne
Emission/Rachat	hebdomadaire le jeudi jusqu'à 12h
Date de lancement	11.07.2013
Indice de référence	aucun
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 960.83
Fortune	CHF 20'128'591
Nombre de droits	20'949.23
Distribution	capitalisation

Tarif

TER KGAST 2019	0.35%*
----------------	--------

* 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 Aagau	2.13
Ville de Lausanne	1.70
CCL p. construction de logements	1.44

Répartition par rating

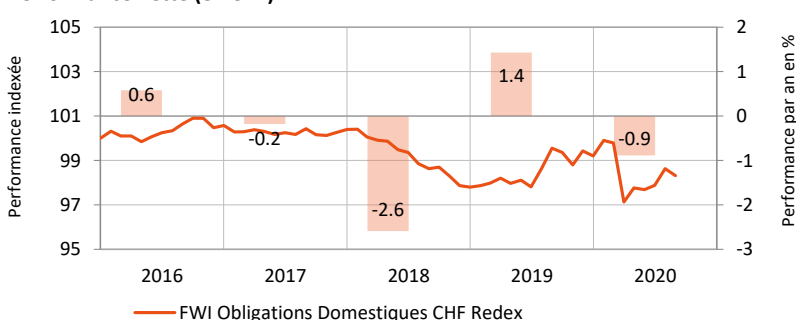


65.8% AAA
22.9% AA
8.2% A
3.1% BBB
0.0% <BBB

Politique de placement

Le groupe de placement FWI Obligations domestiques CHF Redex 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 de réaliser des revenus élevés et réguliers, tout en veillant à la sécurité du capital. Le groupe de placement Redex se caractérise en particulier par une limitation systématique de l'impact d'une hausse ou d'une baisse générale parallèle de la courbe des taux swap en francs suisses grâce à un overlay de dérivés sur taux d'intérêt. Dans ce cadre, les instruments financiers utilisés sont des dérivés négociés de gré à gré, ou «OTC». La durée cible est d'un an avec une fourchette de +/- 1,5 année. Le groupe de placement ne possède pas d'indice de référence. La catégorie de notation AAA-BBB constitue l'univers du Swiss Bond Index Domestic. Redex signifie Reduction of duration exposure (diminution de l'exposition au risque des fluctuations de taux).

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	-0.31	0.65	-0.88	-1.24	-0.70	-0.49	-0.56

Nombres statistique en %

	Portefeuille
Volatilité 1 an	3.24
Volatilité 3 ans	2.04
Tracking Error 1 Jahr	-
Tracking Error 3 Jahre	-
Value at Risk (niveau de confiance 95%)	1.51
Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)	-0.38
Corrélation 1 an	-
Duration	1.97
Durée résiduelle en années	2.46
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.