FWI Global Obligations Government Hedged CHF

factsheet **09|20**

FWI Fondation de placement

Caractéristique

Devise	CHF
ISIN	CH0223423960
Numéro de valeur	22342396
Bloomberg-ID	AWIGLOH
Intervalle d'évaluation	quotidienne
Emission/Rachat	quotidienne jusqu'à 12h
Date de lancement	02.12.2019
Indice de référence	FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return, hedged CHF
Gestion	AXA Investment Managers S.A., Paris
Banque de dépôt	Bank Julius Bär & Co. AG
Auditeur	PricewaterhouseCoopers AG

Données de référence

NAV (par 30.09.2020)	CHF 1'031.35
Fortune	CHF 16'491'234
Nombre de droits	15'990.00
Distribution	capitalisation

Tarif

TER KGAST 2019	0.45%*

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

10 principaux positions	en %
États-Unis d'Amérique	29.43
Japon	17.08
Italien	11.07
France	5.63
Espagne	5.37
Royaume-Uni	5.31
Allemagne	5.01
Province de Colombie-Britannique Canada	3.29
KFW	3.21
Australie	2.08

Répartition par rating

- 16.6% AAA
- 47.0% AA
- 19.1% A
- 17.3% BBB
- 0.0% <BBB

Répartition par devise

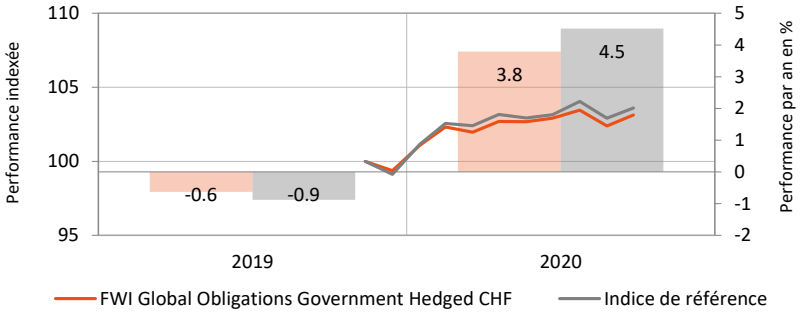
- 100.0% CHF
- 0.0% USD
- 0.0% EUR
- 0.0% Autres

Politique de placement

Le groupe de placement FWI Global Obligations Government se compose de titres à taux d'intérêt fixe (y compris obligations convertibles et obligations avec droit d'option) du monde entier, avec une pondération plus marquée de la zone dollar, des devises européennes et du Yen. Il est destiné aux investisseurs désireux de participer à la croissance d'un portefeuille obligataire mondialement diversifié. Les risques de change sont couverts à 75% au minimum.

Les obligations sont sélectionnées activement par rapport au FTSE World Government Bond Index ex CH Total Return, in CHF, avec un accent particulièrement prononcé, sur des débiteurs dont la solvabilité est d'une bonne jusqu'à très bonne qualité.

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	0.73	0.23	3.79	-	-	-	-
Indice de référence	0.68	0.43	4.52	-	-	-	-

Nombres statistique en %	Portefeuille	Indice de référence
Volatilité 1 an	-	-
Volatilité 3 ans	-	-
Tracking Error 1 Jahr	-	
Tracking Error 3 Jahre	-	
Value at Risk (niveau de confiance 95%)	-	
Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)	-	-
Corrélation 1 an	-	1.00
Duration	8.50	8.89
Durée résiduelle en années	9.89	
Yield to Maturity	0.32	

Répartition par rating/durée résiduelle en années

en %	AAA	AA	A	BBB	<BBB	Total
0-1 an	3.37	0.00	0.00	1.17	0.00	**4.54**
1-3 ans	3.48	0.80	3.98	1.44	0.00	**9.70**
3-5 ans	2.83	12.24	0.00	4.07	0.00	**19.14**
5-7 ans	1.32	6.56	0.21	0.84	0.00	**8.93**
7-10 ans	2.32	10.52	3.39	5.84	0.00	**22.07**
10+ ans	3.24	16.90	11.55	3.93	0.00	**35.62**
Total	**16.56**	**47.02**	**19.13**	**17.29**	**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.

Fondation de placement Winterthur FWI, Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur, T +41 (0)52 202 02 30, F +41 (0)52 202 02 40, fwi-fondation.ch