# AWI Obligationen Inland CHF Redex

Factsheet **06|21**

**Übersicht**

| | |
|---|---|
| Währung | CHF |
| ISIN | CH0205340232 |
| Valor | 20534023 |
| Bloomberg-ID | AWIORDX |
| Bewertungsintervall | täglich |
| Ausgabe/ Rücknahme von Anteilen | jeweils am Donnerstag bis 12 Uhr |
| Lancierungsdatum | 11.07.2013 |
| Benchmark | keine |

| | |
|---|---|
| Asset Manager | AXA Investment Managers, Schweiz AG |
| Verwahrstelle | Bank Julius Bär & Co. AG |
| Wirtschaftsprüfer | PricewaterhouseCoopers AG |

**Eckdaten**

| | |
|---|---|
| NAV (per 30.06.2021) | CHF 961.35 |
| Vermögen | CHF 20'139'614 |
| Ansprüche | 20'949.23 |
| Ausschüttung | thesaurierend |

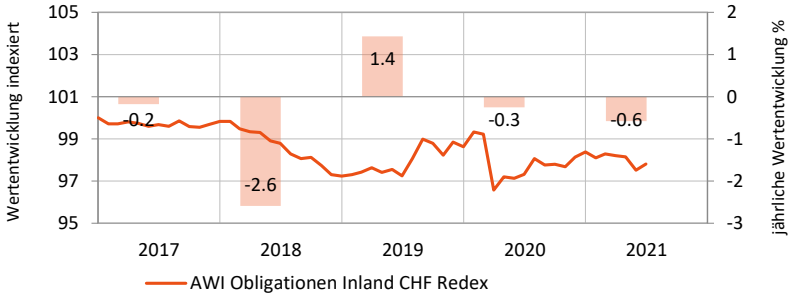
| **Die 10 grössten Schuldner** | **in %** |
|---|---|
| Schweizerische Eidgenossenschaft | 23.87 |
| Pfandbriefbank CH | 20.61 |
| Pfandbriefzentrale CH | 15.83 |
| Zürcher Kantonalbank | 2.23 |
| Kanton Genf | 1.88 |
| Basellandschaftliche Kantonalbank | 1.69 |
| Aargauische Kantonalbank | 1.59 |
| Luzerner Kantonalbank | 1.48 |
| Kanton Zürich | 1.44 |
| SGS | 1.30 |

| **Aufteilung nach Laufzeit** | **in %** |
|---|---|
| Liquide Mittel | 0.77 |
| 0-1 Jahr | 0.85 |
| 1-3 Jahre | 15.72 |
| 3-5 Jahre | 18.35 |
| 5-7 Jahre | 17.42 |
| 7-10 Jahre | 17.85 |
| 10-20 Jahre | 20.36 |
| +20 Jahre | 8.68 |
| **Total** | **100.00** |

**Anlagepolitik**

Die Anlagegruppe AWI Obligationen Inland CHF Redex investiert in auf Schweizer Franken lautende festverzinsliche Wertpapiere (einschliesslich Wandel- und Optionsanleihen), welche von inländischen öffentlich-rechtlichen Körperschaften oder privaten Gesellschaften ausgegeben werden. Im Speziellen zeichnet sich die Redex-Anlagegruppe dadurch aus, dass die Auswirkung eines parallelen generellen Anstiegs oder Absinkens der Schweizer Franken Swapzinskurve systematisch begrenzt wird. Dies wird mittels eines Zinsderivat-Overlays erwirkt. Dabei werden derivative Finanzinstrumente, welche Over-the-Counter «OTC» gehandelt werden, eingesetzt. Die Zielduration beträgt 1 Jahr mit einer Bandbreite von +/- 1.5 Jahren. Die Anlagegruppe hat keine Benchmark. Als Universum dient der Swiss Bond Index Domestic AAA-BBB. Redex steht für Reduction of duration exposure (Verringerung des Zinsänderungsrisikos).

**Wertentwicklung Netto (in CHF)**




| **Statistische Kennzahlen in %** | **Anlagegruppe** |
|---|---|
| Volatilität 1 Jahr | 1.27 |
| Volatilität 3 Jahre | 2.08 |
| Tracking Error 1 Jahr | - |
| Tracking Error 3 Jahre | - |
| Value at Risk (Konfidenzniveau 95%) | 0.59 |
| Sharpe Ratio (1 Jahr/ Basis 0%) | 0.40 |
| Korrelation 1 Jahr | - |
| Duration | 1.02 |
| Rendite auf Verfall | -0.18 |

**Rating Allokation**

| **Gebühren Gesamtanlagevermögen** | **TER KGAST 2020** |
|---|---|
| Kategorie A: < 20 (Mio. CHF) | 0.31% |
| Kategorie B: 20-100 (Mio. CHF) | 0.29% |
| Kategorie C: > 100 (Mio. CHF) | 0.26% |

| **Performance in %** | **1 Monat** | **3 Monate** | **YTD** | **1 Jahr** | **3 Jahre p.a.** | **5 Jahre p.a.** | **seit Auflage p.a.** |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Anlagegruppe (Kat. A) | 0.30 | -0.40 | -0.58 | 0.51 | -0.33 | -0.38 | -0.49 |
| Anlagegruppe (Kat. B) | 0.30 | -0.40 | -0.57 | 0.53 | -0.31 | -0.36 | -0.33 |
| Anlagegruppe (Kat. C) | 0.30 | -0.39 | -0.55 | 0.56 | -0.28 | -0.33 | -0.09 |

Allgemeines: Die Grundlage für den Kauf von Anteilen der Anlagegruppe sind die jeweils gültigen massgeblichen Emissionsdokumente, in Verbindung mit dem jeweils letzten Jahresbericht oder, sofern vorhanden, Halbjahresbericht der Anlagegruppe. Haftungsausschluss: Dieses Dokument wurde von der 1741 Fund Solutions AG (nachfolgend: «1741») erstellt. 1741 gibt jedoch keine Gewähr oder Garantie hinsichtlich dessen Inhalt und Vollständigkeit und lehnt jede Haftung für Verluste oder Schäden irgendwelcher Art, die direkt oder indirekt aus der Verwendung dieses Dokumentes oder der darin enthaltenen Informationen entstehen, ab. Die in diesem Dokument geäusserten Meinungen sind diejenigen der 1741 zum Zeitpunkt der Erstellung und können sich jederzeit und ohne Mitteilung ändern. Ist nichts Anderes vermerkt, sind alle Zahlen ungeprüft. Nur für Informationszwecke: Dieses Dokument dient ausschliesslich der Information des Empfängers und stellt keine Anlageberatung, kein Angebot und keine Empfehlung zum Erwerb von Finanzinstrumenten dar und entbindet den Empfänger nicht von seiner eigenen Beurteilung. Zielgruppe: Das vorliegende Dokument und die darin enthaltenen Informationen richten sich ausschliesslich an Schweizerische Pensionskassen. In der Folge dürfen weder das vorliegende Dokument noch Kopien davon in die Vereinigten Staaten versandt oder dahin mitgenommen werden oder an eine US Person gemäss Regulation S des US Securities Act von 1933 abgegeben werden. Verwendungsbeschränkung: Dieses Dokument richtet sich ausdrücklich nicht an Personen, deren Nationalität, Wohnsitz oder andere Eigenschaften Zugang zu solchen Informationen aufgrund geltender Gesetzgebung verbieten. Im Zweifel empfehlen wir Ihnen, Kontakt mit einer örtlichen Vertriebsstelle oder einem Kreditinstitut aufzunehmen. Performance: Mit jeder Anlage sind Risiken verbunden, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen. Kapitalanlagen sind volatil und eine Investition kann auch zum Totalverlust des eingesetzten Kapitals und etwaiger Erträge führen. Performance Angaben berücksichtigen zudem die bei der Ausgabe und/oder Rücknahme erhobenen Kommissionen und Kosten nicht. Es kann ausserdem nicht garantiert werden, dass die Performance des Vergleichsindex erreicht oder übertroffen wird. Eine positive Wertentwicklung in der Vergangenheit oder die Indikation einer solchen stellen keine Garantie für eine positive Wertentwicklung in der Zukunft dar. Investitionen in Fremdwährungen können Währungsschwankungen unterliegen. Es besteht zusätzlich das Risiko, dass die Fremdwährung gegenüber der Referenzwährung des Anlegers an Wert verliert. Vertrieb in der Schweiz: Diese Anlagegruppe darf in der Schweiz nur an Pensionskassen vertrieben werden.

**Anlagestiftung Winterthur AWI**, Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur, T +41 (0)52 202 02 30, F +41 (0)52 202 02 40, awi-anlagestiftung.ch