

BVG-Mix Plus 30.

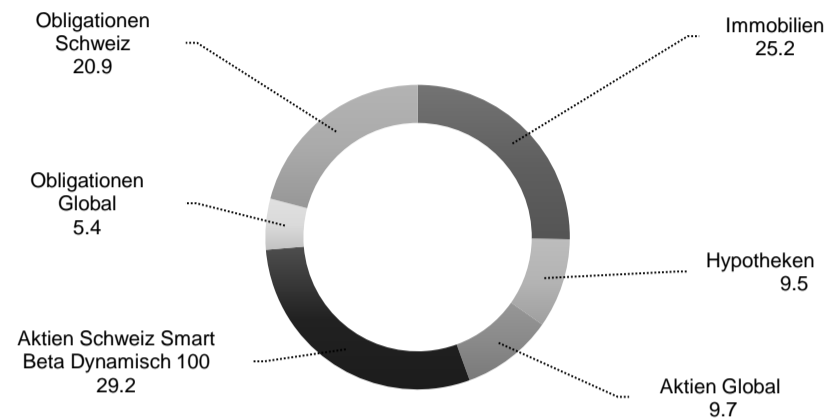
Renditeorientiert.

30.09.2019

Charakteristika

Gründungsjahr	2013
Valoren-Nr.	3539998 (ISIN: CH0035399986)
Bloomberg	BVGMP30 SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Core-Satellite
Strategische Asset Allocation	- 24% Obligationen Schweiz - 5% Obligationen Global - 26% Aktien Schweiz Smart Beta Dynamisch 100 - 9% Aktien Global - 26% Immobilien - 10% Hypotheken

Anlageklassenstruktur per 30.09.2019 (in %)



Performance per 30.09.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	0.74	0.20	0.54	
3 Monate	1.49	1.88	-0.39	
YTD	10.85	10.95	-0.11	
Letzte 12 Monate	5.69	8.04	-2.35	
3 Jahre ¹	4.40	5.65	-1.25	
5 Jahre ¹	4.37	4.83	-0.47	
10 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
15 Jahre ¹	N.a.	N.a.	N.a.	
Seit Lancierung ¹	4.37	5.26	-0.90	

¹ annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	205.66	68.07
Anzahl Ansprüche		166 129	60 953
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 233.09	1 103.25
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	4.86	13.57
Inventarwert ²	(in CHF)	1 237.95	1 116.82
TER 2018 (inkl. MWST)	(in %)	0.86	

² pro Anspruch

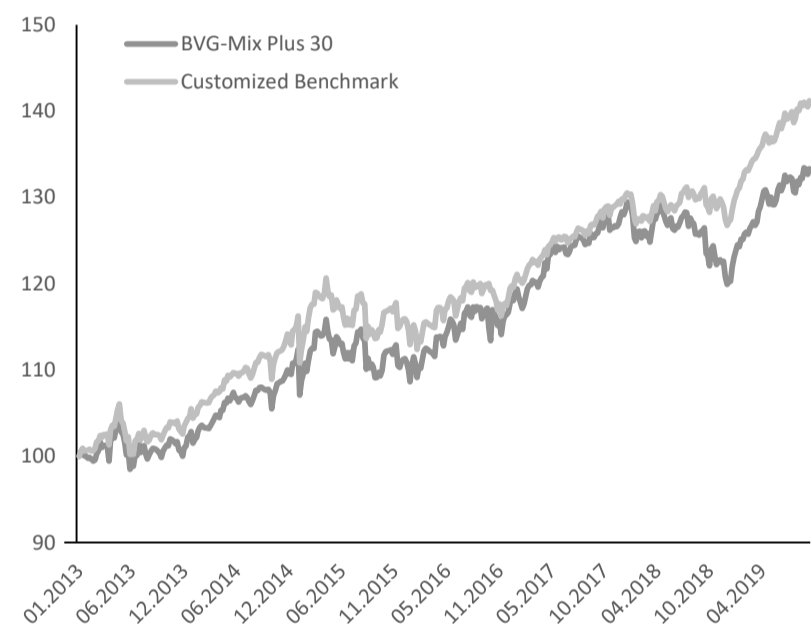
Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	6.02	4.62	4.69
Tracking Error	(in %)	2.25	1.98	1.83
Beta		1.12	1.12	0.98
Sharpe Ratio		0.89	0.88	0.85
Information Ratio		-1.04	-0.63	-0.26
Jensen-Alpha		-0.03	-0.02	0.00
Max. Drawdown		-4.65	-6.26	-6.26
Recovery Period	(in Tagen)	90	120	120
Modified Duration ⁴	(in %)	7.50		

³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2019

Wertentwicklung seit Lancierung



Zeichnung und Rücknahme

Zeichnungen und Rücknahmen, die bis Dienstag 11:00 Uhr bei der Helvetia Anlagestiftung eintreffen, werden mit den Schlusskursen vom folgenden Mittwoch abgerechnet.

Gebühren

Erwerb	0.00%
Rücknahme	0.50%