

BVG-Mix.

Gut diversifiziert.

30.09.2019

Charakteristika

Gründungsjahr	1993
Valoren-Nr.	1176860 (ISIN: CH0011768600)
Bloomberg	PATBVGM SW
Benchmark	Customised
Bewertung	Wöchentlich
Ausschüttungspolitik	Thesaurierend
Anlagestil	Indexiert
Strategische Asset Allocation	- 60% Obligationen Schweiz - 10% Obligationen Global - 15% Aktien Schweiz - 15% Aktien Global

Performance per 30.09.2019 (in %)

	Anlage- gruppe	Benchmark	Diff. zum Benchmark	KGAST Ranking
1 Monat	-0.27	-0.51	0.24	
3 Monate	2.03	2.24	-0.21	
YTD	9.85	10.87	-1.03	
Letzte 12 Monate	7.00	8.60	-1.60	
3 Jahre ¹	3.39	4.32	-0.92	
5 Jahre ¹	3.30	4.15	-0.86	
10 Jahre ¹	3.87	4.56	-0.69	
15 Jahre ¹	3.71	4.27	-0.56	
Seit Lancierung ¹	4.58	4.96	-0.38	

¹ annualisiert

Kennzahlen

		30.09.2019	31.12.2018
Nettovermögen	(in Mio. CHF)	17.34	14.85
Anzahl Ansprüche		15 709	14 779
Kapitalwert ²	(in CHF)	1 095.63	953.71
Laufender Ertrag ²	(in CHF)	8.16	51.15
Inventarwert ²	(in CHF)	1 103.79	1 004.86
TER 2018 (inkl. MWST)	(in %)	0.53	

² pro Anspruch

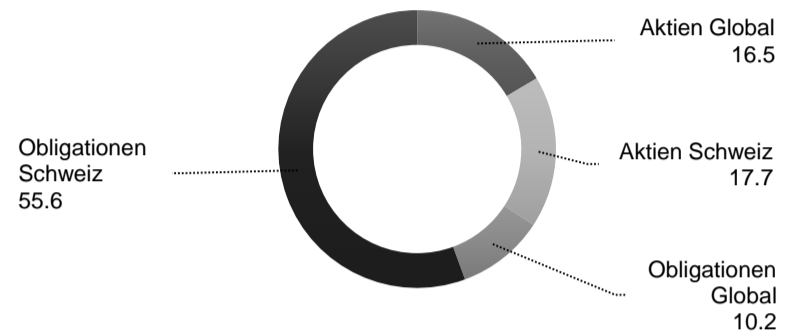
Risikokennzahlen per 30.09.2019 (in %)

		1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre
Volatilität ³	(in %)	4.52	3.61	4.06
Tracking Error	(in %)	0.93	0.59	0.50
Beta		0.90	0.96	0.99
Sharpe Ratio		2.22	1.78	1.55
Information Ratio		-1.72	-1.58	-1.73
Jensen-Alpha		0.00	-0.01	-0.01
Max. Drawdown		-2.59	-3.80	-12.50
Recovery Period	(in Tagen)	59	59	N.a.
Modified Duration ⁴	(in %)	7.55		

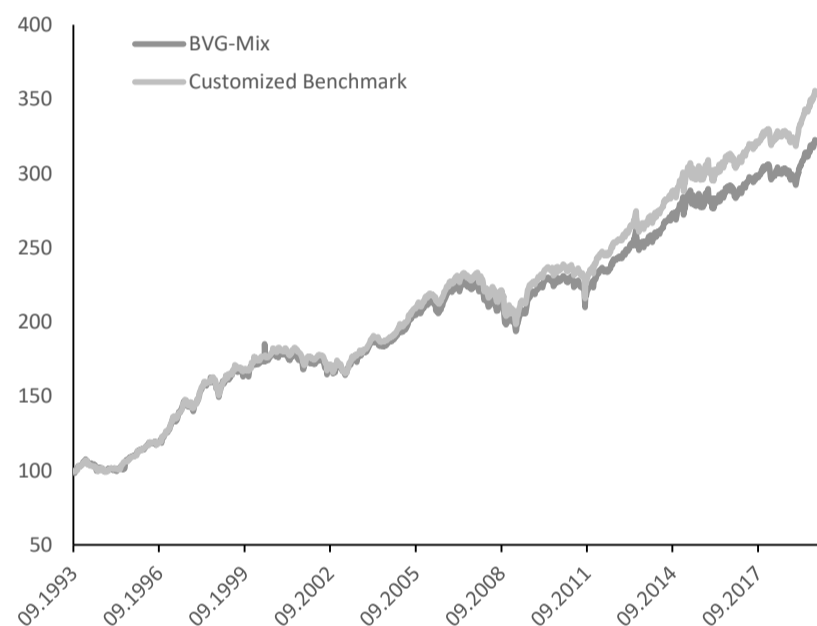
³ gemessen in Standardabweichung (Schwankungen der Renditen)

⁴ Duration berechnet auf festverzinsliche Anlagen per 30.06.2019

Anlageklassenstruktur per 30.09.2019 (in %)



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	0.25%