

Modified Duration (ModD), Sharpe Ratio (SR), Maximum Drawdown (MaxD) in %, Recovery Period (RP) in Monaten

Anlagegruppe	ModD	SR 1Y	SR 5Y	SR 10Y	SR seit Auflegung	MaxD 1Y	MaxD 5Y	MaxD 10Y	MaxD seit Auflegung	RP 1Y	RP 5Y	RP 10Y	RP seit Auflegung
Aktien													
Aktien Schweiz Quality & Dividend		0.27	0.57	0.22		-5.78	-12.58	-30.91		2	14	12	
Aktien Global		1.48			0.78	-3.00			-10.26	2			2
Obligationen													
Obligationen Ausland CHF	4.63	-0.40	0.16		0.14	-1.24	-2.64		-2.64	- *	- *		- *
Obligationen Schweiz	8.14	-0.31	0.29	-0.25		-2.00	-5.08	-5.08		- *	- *	- *	
Obligationen Euro	6.76	-0.05	0.08	-0.30		-6.96	-15.06	-22.35		- *	28	36	
Mischvermögen													
BVG-Mix 15 I	6.57	0.20	0.75	-0.07		-1.76	-2.27	-4.65		- *	5	4	
BVG-Mix 25 I	6.45	0.38	0.80	0.03		-1.99	-3.01	-8.62		5	2	5	
BVG-Mix 40 I	5.98	0.56	0.84	0.13		-2.27	-4.03	-14.25		5	2	6	
BVG-Mix 15 R	6.57	0.18	0.71	-0.10		-1.77	-2.32	-4.65		- *	5	4	
BVG-Mix 25 R	6.45	0.37	0.76	0.00		-2.00	-3.13	-8.62		- *	2	5	
BVG-Mix 40 R	5.98	0.56	0.80	0.10		-2.28	-4.14	-14.25		5	2	6	
BVG-Mix Dynamic Allocation I		0.55			1.11	-1.60			-1.68	- *			3
BVG-Mix Dynamic Allocation R		0.53			0.96	-1.61			-1.61	- *			- *
BVG-Mix Perspectiva Relax		0.65			0.54	-1.79			-5.10	5			17
BVG-Mix Perspectiva Pension					-0.57				-1.23				5

* Recovery-Period hält noch an

Benchmark

Anlagegruppe	Benchmark
Aktien	
Aktien Schweiz Quality & Dividend	Swiss Performance Index
Aktien Global	MSCI World ex CH net TR
Obligationen	
Obligationen Ausland CHF	Swiss Bond Index Foreign AAA-BBB
Obligationen Schweiz	Swiss Bond Index Domestic AAA-BBB
Obligationen Euro	Barclays Capital Euro Aggregate TR
Mischvermögen	
BVG-Mix 15 I	Customized
BVG-Mix 25 I	Customized
BVG-Mix 40 I	Customized
BVG-Mix 15 R	Customized
BVG-Mix 25 R	Customized
BVG-Mix 40 R	Customized
BVG-Mix Dynamic Allocation I	kein Benchmark
BVG-Mix Dynamic Allocation R	kein Benchmark
BVG-Mix Perspectiva Relax	kein Benchmark
BVG-Mix Perspectiva Pension	kein Benchmark