



Factsheet Mischvermögen Dynamisch

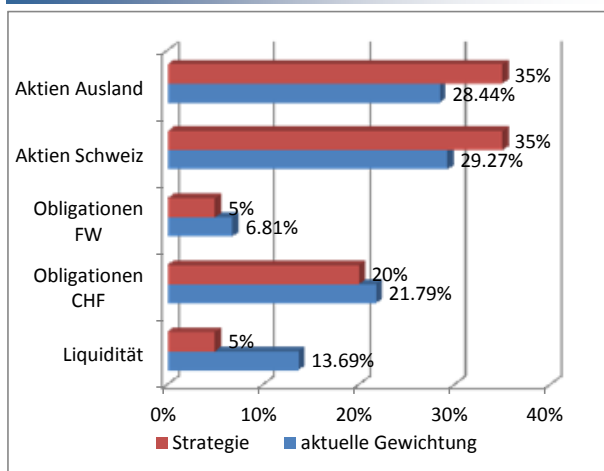
31. Dezember 2015

Anlagestrategie

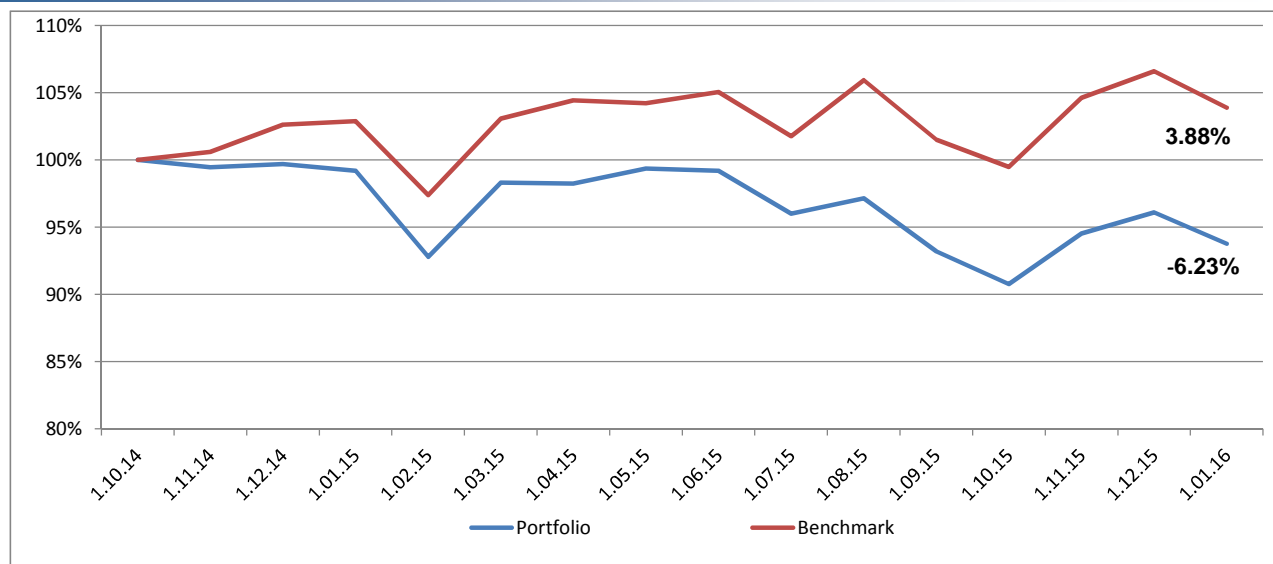
Das Anlageziel der Anlagegruppe ist die Erzielung eines angemessenen Ertrags in CHF unter Nutzung der Möglichkeiten der internationalen Diversifikation. Die Anlagegruppe investiert weltweit in fest- und variabelverzinsliche Werte und Aktien. Dabei wird der Anteil an Aktienanlagen zwischen 25% und 85% des Nettovermögens betragen. Der nicht abgesicherte Teil des Fremdwährungsengagements darf 57.5% des Nettovermögens nicht überschreiten.

Fremdwährungen	40.68%
USD	22.56%
AUD	4.52%
EUR	4.19%
CAD	2.64%
Rest	6.77%

Portfoliostruktur per 31.12.2015



Performance Chart (1.10.2014 - 31.12.2015)



Performance Übersicht

	Portfolio	Benchmark
2014 (1.10.-31.12.14)	-0.80%	2.88%
2015	-5.47%	0.97%

Risikoanalyse

Volatilität Anlagegruppe	3.03%
Volatilität Benchmark	3.19%
Tracking Error	0.96%
Information Ratio	-0.72
Sharpe Ratio	-0.11
Beta-Faktor	0.91
Jensen Alpha	-0.65%
Maximum Drawdown	9.22%
Modified Duration	6.04

TER OAK

	Portfolio
2014 (1.10.-31.12.14)	0.74%
2015	0.42%

Ihre Ansprechpartner

Vermögensverwaltung

Unigamma AG
Tellstrasse 55
5001 Aarau

Depotbank

UBS Switzerland AG
Baarerstrasse 14a
Postfach
6301 Zug

Beratung / Administration

BeVeSa GmbH, Christoph Eck
Postfach 667, 6343 Rotkreuz
+41 (0) 41 798 11 75
anlagestiftung@unigamma.ch
www.unigamma-anlagestiftung.ch