



Factsheet Mischvermögen Dynamisch

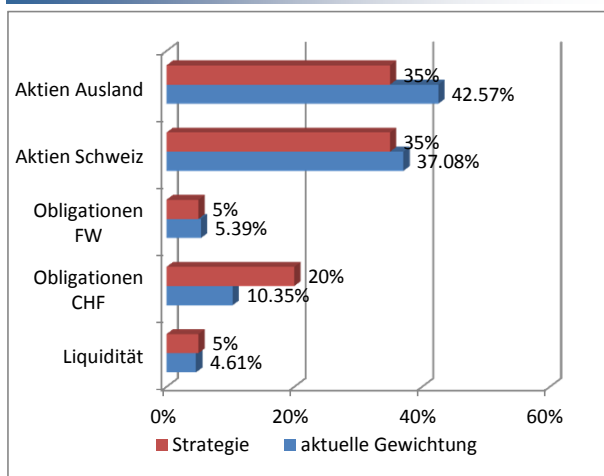
31. Dezember 2016

Anlagestrategie

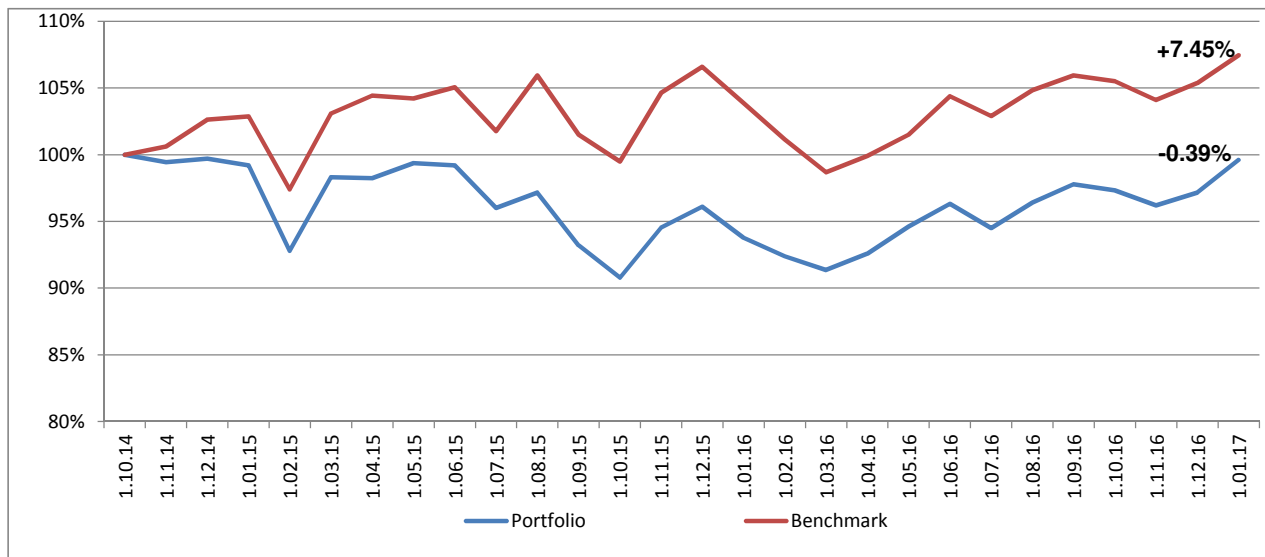
Das Anlageziel der Anlagegruppe ist die Erzielung eines angemessenen Ertrags in CHF unter Nutzung der Möglichkeiten der internationalen Diversifikation. Die Anlagegruppe investiert weltweit in fest- und variabelverzinsliche Werte und Aktien. Dabei wird der Anteil an Aktienanlagen zwischen 25% und 85%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

Fremdwährungen	48.00%
USD	25.26%
EUR	10.15%
DKK	3.14%
AUD	2.98%
Rest	6.47%

Portfoliostruktur per 31.12.2016



Performance Chart (1.10.2014 - 31.12.2016)



Performance Übersicht

	Portfolio	Benchmark
2014 (1.10.-31.12.14)	-0.80%	2.88%
2015	-5.47%	0.97%
2016	6.23%	3.44%

Risikoanalyse

Volatilität Anlagegruppe	2.52%
Volatilität Benchmark	2.66%
Tracking Error	0.94%
Tracking Error (ex ante)	1.75%
Information Ratio	-0.30
Sharpe Ratio	0.03
Beta-Faktor	0.89
Jensen Alpha	-0.24%
Maximum Drawdown	9.22%
Recovery Period	noch offen
Modified Duration	2.86

TER OAK

	Portfolio
2014 (1.10.-31.12.14)	0.74%
2015	0.42%
2016	0.42%

Ihre Ansprechpartner

Vermögensverwaltung (seit 1.1.2017)

Investas AG
Marktgasse 37
3001 Bern

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



Factsheet Mischvermögen Dynamisch

31. Dezember 2016

Strategische Asset Allocation

Benchmark

Liquidität CHF	5.00%
Obligationen CHF	20.00%
Obligationen FW	5.00%
Aktien CH	35.00%
Aktien Ausland	35.00%
	100.00%
Max. Fremdwährung nach Absicherung	57.50%
Max. Aktienanteil	85.00%

JPM Morgan Cash CHF 2M
SBI AAA-BBB Total Return CHF
JPM Global - All Mat gross USD
SPI Gross CHF
MSCI ACWI ex CH net USD

Ihre Ansprechpartner

Vermögensverwaltung (seit 1.1.2016)

Basellandschaftliche Kantonalbank
Rheinstrasse 7
4410 Liestal

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