

Einführung

Das Vergleichsmodul der KGAST interaktiven Webseite erlaubt Performance und Risiko Eckdaten über mehr als 230 Anlagegruppen auf einer neutralen Basis zu vergleichen.

Die Anlagegruppen sind in 24 Anlagesegmente kategorisiert. Zeithorizonte wie Benchmarks sind frei wählbar und standardmässig stehen bis 180 monatliche Daten zur Verfügung.

Dieses Dokument stellt eine Einführung zu den wichtigsten Funktionalitäten der Webapplikation dar.

Kategorie erwählen

24 Anlagekategorien, die mehr als 230 Anlagegruppen umfassen, stehen zur Auswahl.

The screenshot shows a web interface with a dropdown menu on the left and a table of performance metrics on the right. The dropdown menu lists 24 asset categories, with 'Aktien Schweiz' highlighted. The table displays performance data for various funds, including MSCI World TR, UBS2 Global Equities, and ZÜR Aktien Nachhaltigkeit Global.

	Perf.	Vol.	MDD	SR	Korr.	R2	Alpha	Beta	TE	IR	A/I
Aktien Ausland											
Aktien Ausland: Emerging Markets											
Aktien Ausland: Europa											
Aktien Ausland: Japan											
Aktien Ausland: USA/Nordamerika											
Aktien Ausland: Welt											
Aktien Schweiz											
Aktien Schweiz: Small & Mid Caps											
Geldmarkt											
Geldmarkt											
Hedge Funds (mit Währungsabsicherung)											
Hedge Funds (mit Währungsabsicherung)											
Immobilien Ausland											
Immobilien Ausland											
Immobilien Schweiz											
Immobilien Schweiz: Gemischt											
Immobilien Schweiz: Geschäftliegenschaften											
Immobilien Schweiz: Wohnen											
Mischvermögen											
Mischvermögen: 10-19% Aktien											
Mischvermögen: 20-30% Aktien											
Mischvermögen: 31-40% Aktien											
Mischvermögen: 41-50% Aktien											
Obligationen in Fremdwährungen											
Obligationen in Fremdwährungen: Euro											
Obligationen in Fremdwährungen: US-Dollar											
Obligationen in Fremdwährungen: Welt											
Obligationen in Schweizer Franken											
Obligationen in Schweizer Franken: Ausland											
Obligationen in Schweizer Franken: Inland											
Private Equity											
Private Equity											
Wandelanleihen											
Wandelanleihen											
UBS2 Global Equities (ex CH)											
UBS2 Global Equities (ex CH) Passive											
ZÜR Aktien Nachhaltigkeit Global											
MSCI World TR											

Benchmark erwählen

Bis drei verschiedene Benchmarks pro Kategorie stehen zur Verfügung. Die Benchmark einiger Anlagegruppen stehen nicht zur Verfügung. Dies gilt insbesondere für die sogenannten Customized Benchmarks.

Deutsch | Français

VERGLEICH PRODUKTE

Obligationen in Fremdwährungen: Euro

- Citigroup EMU GBI TR
- ✓ JP Morgan EMU Aggregate
- Barclays Capital Euro Aggregate TR

01.05.1996 31.03.2011

Periode: 01.04.2010 - 31.03.2011 (12 Monate)

A.	Bezeichnung	Perf.	Vol.	MDD	SR	Korr.	R2	Alpha	Beta	TE	IR	A/I
▶	AVA Obligationen Euro	-10.7	12.6	-13.2	-0.9	1.0	1.0	-0.6	0.9	1.0	0.2	A
▶	BAL Obligationen Euro	-10.3	12.5	-13.3	-0.9	1.0	1.0	-0.3	0.9	2.0	0.3	A
▶	CSA Bonds EUR	-9.3	12.6	-13.0	-0.8	1.0	1.0	1.1	0.9	1.3	1.4	A
▶	IST Governo Euro Plus	-8.7	11.7	-12.6	-0.8	1.0	1.0	0.8	0.9	2.9	0.9	A
▶	SWC Obligationen Europa Top	-7.4	11.9	-12.2	-0.6	1.0	1.0	2.3	0.9	3.2	1.2	A
▶	UBS Obligationen EUR	-9.8	12.7	-13.1	-0.8	1.0	1.0	0.6	0.9	1.0	1.2	A
▶	ZÜR Obligationen Euro	-10.8	12.1	-13.0	-0.9	1.0	1.0	-1.1	0.9	1.8	0.1	A
	JP Morgan EMU Aggregate	-10.9	13.5	-13.5	-0.9							

Risikofreie Rendite: Libor 3M CHF

Powered by Fundo; Datenquelle: LIPPER

Zeitperiode erwählen

Der Schieberegler (Slider) erlaubt es, eine Analysenperiode festzulegen. Die Minimalperiode entspricht 12 Monaten. Standardmässig werden die letzten 12 monatlichen Renditen (1 Jahr) zur Verfügung gestellt. Jede mögliche Periode von 12 bis 180 Monaten kann eingestellt werden. Der Schieberegler kann entweder mit der Maus oder der Tastatur (dem linken bzw. rechten Pfeil) bedient werden.

Deutsch | Français

KIGAST Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

VERGLEICH PRODUKTE

Aktien Schweiz SPI® TR

01.10.2003 [36 M.] 30.09.2006 [36 M.]

01.05.1996 31.03.2011

Periode: 01.10.2003 - 30.09.2006 (36 Monate)

A.	Bezeichnung	Perf.	Vol.	MDD	SR	Korr.	R2	Alpha	Beta	TE	IR	A/I
▶ ALZ	Aktien Schweiz	20.7	9.0	-6.7	2.0	1.0	1.0	-1.1	1.0	0.5	-1.8	A
▶ AVA	Aktien Schweiz	21.4	9.0	-6.5	2.1	1.0	1.0	-0.5	1.0	0.2	-2.7	I
▶ AWi	Aktien Schweiz	20.4	9.0	-7.0	2.0	1.0	1.0	-1.3	1.0	0.9	-1.4	I
▶ BAL	Aktien Schweiz	21.6	9.2	-6.4	2.1	1.0	1.0	-0.7	1.0	0.9	-0.3	A
▶ CSA	Equity Switzerland	20.3	9.2	-7.5	1.9	1.0	1.0	-1.9	1.0	0.8	-1.6	A
▶ CSA	Swiss Index	20.3	9.0	-7.0	2.0	1.0	1.0	-1.4	1.0	0.9	-1.5	I
▶ HEL	Aktien Schweiz indexiert	21.3	9.3	-6.6	2.0	0.9	0.9	0.2	1.0	3.4	-0.1	I
▶ IST	Aktien Schweiz SMI Indexiert	20.0	8.9	-7.7	2.0	1.0	1.0	-1.4	1.0	1.3	-1.2	I
▶ SAR	Aktien Schweiz	20.5	9.4	-7.6	1.9	1.0	1.0	-2.0	1.0	0.8	-1.4	A
▶ SAR	Nachhaltig Aktien Schweiz	21.7	8.9	-5.9	2.1	1.0	1.0	0.2	1.0	1.5	-0.1	A
▶ SWC	Aktien Schweiz											
▶ SWL	Aktien Schweiz											
▶ UBS	Aktien Schweiz											
▶ UBS	Aktien Schweiz Indexiert											
▶ ZÜR	Aktien Schweiz											
	SPI® TR											

Powered by Fundo; Datenquelle: LIPPER

Felder der Tabelle

Zehn statistische Indikatoren stehen zur Verfügung und werden für die ausgewählte Periode dynamisch kalkuliert.

- Aktive/indexierte Anlagegruppe [A/I]
- Performance p.a. [Perf.]
- Maximum Drawdown [MDD]
- Volatilität p.a. [Vol.]
- Sharpe Ratio p.a. [SR]
- Korrelation [Korr.]
- R-Quadrat [R²]
- (Jensens) Alpha [Alpha]
- Beta [Beta]
- Tracking Error p.a. [TE]
- Information Ratio p.a. [IR]

Das Sortieren der Kolonnen ist mit Hilfe der Sortierikonen möglich.

Risikofreier Zinssatz: Libor CHF 3 months

Deutsch | Français

Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen / Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

VERGLEICH PRODUKTE

Aktien Schweiz | SPI® TR

01.05.1996 | 31.03.2011

Periode: 01.10.2003 - 30.09.2006 (36 Monate)

A.	Bezeichnung	Perf.	Vol.	MDD	SR	Korr.	R2	Alpha	Beta	TE	IR	A/I
▶ ALZ	Aktien Schweiz	20.7	9.0	Max. Drawdown	2.1	1.0	1.0	-1.1	1.0	0.5	-1.8	A
▶ AVA	Aktien Schweiz	21.4	9.0	-6.5	2.1	1.0	1.0	-0.5	1.0	0.2	-2.7	I
▶ AWi	Aktien Schweiz	20.4	9.0	-7.0	2.0	1.0	1.0	-1.3	1.0	0.9	-1.4	I
▶ BAL	Aktien Schweiz	21.6	9.2	-6.4	2.1	1.0	1.0	-0.7	1.0	0.9	-0.3	A
▶ CSA	Equity Switzerland	20.3	9.2	-7.5	1.9	1.0	1.0	-1.9	1.0	0.8	-1.6	A
▶ CSA	Swiss Index	20.3	9.0	-7.0	2.0	1.0	1.0	-1.4	1.0	0.9	-1.5	I
▶ HEL	Aktien Schweiz indexiert	21.3	9.3	-6.6	2.0	0.9	0.9	0.2	1.0	3.4	-0.1	I
▶ IST	Aktien Schweiz SMI Indexiert	20.0	8.9	-7.7	2.0	1.0	1.0	-1.4	1.0	1.3	-1.2	I
▶ SAR	Aktien Schweiz	20.5	9.4	-7.6	1.9	1.0	1.0	-2.0	1.0	0.8	-1.4	A
▶ SAR	Nachhaltig Aktien Schweiz	21.7	8.9	-5.9	2.1	1.0	1.0	0.2	1.0	1.5	-0.1	A
▶ SWC	Aktien Schweiz	20.4	9.2	-7.4	2.0	1.0	1.0	-1.7	1.0	0.8	-1.5	A
▶ SWL	Aktien Schweiz	19.9	8.2	-5.3	2.1	1.0	1.0	0.2	0.9	1.4	-1.2	A
▶ UBS	Aktien Schweiz	20.9	9.0	-7.3	2.0	1.0	1.0	-0.9	1.0	1.0	-0.8	A
▶ UBS	Aktien Schweiz Indexiert	20.4	9.0	-7.0	2.0	1.0	1.0	-1.2	1.0	0.9	-1.3	I
▶ ZÜR	Aktien Schweiz	21.1	9.2	-6.9	2.0	1.0	1.0	-1.0	1.0	1.3	-0.5	A
	SPI® TR	21.9	8.9	-6.2	2.1							

Risikofreie Rendite: Libor 3M CHF

Powered by FJ Fundo; Datenquelle: LIPPER

Ansichten

Nebst der Tabelle können drei weitere graphische Wiedergaben erzeugt werden.

Deutsch | Français

KGAST Konferenz der Geschäftsführer von Anlagestiftungen Conférence des Administrateurs de Fondations de Placement

VERGLEICH PRODUKTE

Aktien Schweiz SPI@ TR

01.05.1996 31.03.2011

Periode: 01.04.2010 - 31.03.2011 (12 Monate)

Tabelle Chart [Size] Chart [Detail] Chart [A/I] Print ?

A.	Bezeichnung	Perf.	Vol.
▶ ALZ	Aktien Schweiz	-0.0	8.7
▶ AVA	Aktien Schweiz	-4.2	9.2
▶ AWi	Aktien Schweiz	-5.0	8.7
▶ BAL	Aktien Schweiz	-2.7	8.9
▶ CSA	Equity Switzerland	-3.7	9.0
▶ CSA	Fund Selection Equity Switzerland	-0.0	9.3
▶ CSA	Swiss Index	-5.0	9.0
▶ HEL	Aktien Schweiz indexiert	-4.0	10.3
▶ IST	Aktien Schweiz SMI Indexiert	-5.2	8.9
▶ IST	Aktien Schweiz SPI Plus	-4.4	8.9
▶ IST2	Aktien Schweiz SPI Plus	-4.5	8.9
▶ SAR	Aktien Schweiz	-1.1	8.8
▶ SAR	Nachhaltig Aktien Schweiz	-1.4	8.5
▶ SWC	Aktien Schweiz	-3.6	9.3
▶ SWL	Aktien Schweiz	-2.9	9.2
▶ UBS	Aktien Schweiz	-4.4	9.2
▶ UBS	Aktien Schweiz Indexiert	-5.0	8.9
▶ ZÜR	Aktien Schweiz	-1.9	9.1
▶ ZÜR	Aktien Schweiz Index	-3.8	9.1
SPI@ TR		-3.6	9.1

SPI@ TR
01.04.2010-31.03.2011 | Performance p.a.: -3.6% | Volatilität p.a.: 9.1%

Zürich Aktien Schweiz [0.0, 1.7] 529.4 mio.

Relative Performance [Perf. Anlagegruppe p.a. - Perf. Benchmark p.a.]

Relative Volatilität [Vol. Anlagegruppe p.a. - Vol. Benchmark p.a.]

Powered by Ffundo; Datenquelle: LIPPER

Detailansicht

Beim Anklicken des kleinen schwarzen Dreiecks erscheinen weitere Informationen zur Anlagegruppe. Insbesondere kann ein Factsheet für die erwähnte Periode, bzw. Benchmark dynamisch generiert werden.

Deutsch | Français

Konferenz der Geschäftsführer
von Anlagestiftungen
Conférence des Administrateurs
de Fondations de Placement

VERGLEICH
PRODUKTE

Aktien Schweiz
↓
SPI® TR
↓

01.05.1996
31.03.2011

Periode: 01.04.2010 - 31.03.2011 (12 Monate)
Tabelle
Chart [Size]
Chart [Detail]
Chart [A/I]
Print
?

A.	Bezeichnung	Perf.	Vol.
▶ ALZ	Aktien Schweiz	-0.0	8.7
▶ AVA	Aktien Schweiz	-4.2	9.2
▶ AWi	Aktien Schweiz	-5.0	8.7
▶ BAL	Aktien Schweiz	-2.7	8.9
▶ CSA	Equity Switzerland	-3.7	9.0
▶ CSA	Fund Selection Equity Switzerland	-0.0	9.3
▶ CSA	Swiss Index	-5.0	9.0
▶ HEL	Aktien Schweiz indexiert	-4.0	10.3
▶ IST	Aktien Schweiz SMI Indexiert	-5.2	8.9
▶ IST	Aktien Schweiz SPI Plus	-4.4	8.9
▶ IST2	Aktien Schweiz SPI Plus	-4.5	8.9
▶ SAR	Aktien Schweiz	-1.1	8.8
▶ SAR	Nachhaltig Aktien Schweiz	-1.4	8.5
▶ SWC	Aktien Schweiz	-3.6	9.3
▶ SWL	Aktien Schweiz	-2.9	9.2
▶ UBS	Aktien Schweiz	-4.4	9.2
▶ UBS	Aktien Schweiz Indexiert	-5.0	8.9
▼ ZÜR	Aktien Schweiz	-1.9	9.1
	Valoren-Nr. 721 861 Benchmark der Anlagegruppe SPI® TR	Lancierung 1999 Mio. 529.4	
▶ ZÜR	Aktien Schweiz Index	-3.8	9.1

SPI® TR
01.04.2010-31.03.2011 | Performance p.a.: -3.6% | Volatilität p.a.: 9.1%

Factsheets

Das Factsheet kann dann als PDF-Dokument gespeichert werden. Unterschiedliche Zeitperioden und Benchmarks erlauben die Produktion von Varianten desselben Factsheets.

**MIXTA OPTIMA 25
JANUAR 2011**

Mixta Optima 25
CH0002772512
NIV: CHF 1'779.41

Manager: IST Investmentstiftung
Verwaltung: IST Investmentstiftung
Depositär: Lombard Odier Danier Hertsch & Cie
Vermögen: 530 Mio.
Leistung: 02.04.1993
Benchmark: Pictet BGI/GFP 25
IST Investmentstiftung für Personalvorsorge
Steinstrasse 21, Postfach, 8038 Zürich
044 455 37 00
www.istfund.ch

Monatsrenditen
2010-2011

Jahresende	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Juni	Juli	Aug	Sep	Ok	Nov	Dez
2010	1.14	0.28	0.87	1.03	0.31	-0.19	-1.21	-1.11	0.91	0.90	-1.00	-0.08
2011	0.60	0.38										

Kumulierte Performance
2010-2011, 31.01.2010=100

Vergleichsanalyse
01.01.2010 - 31.01.2011

Strategie	Max. Drawdown	Volatilität	Sharpe Ratio	Alpha	Beta	Corr. Alpha/Beta
Mixta Optima 25	-3.58%	0.22%	2.05%	1.27%	98.33%	+0.11%
Pictet BGI/GFP 25	-1.76%	0.19%	1.76%	1.07%	98.67%	-0.93%

**MIXTA OPTIMA 25
DEZEMBER 2010**

Mixta Optima 25
CH0002772512
NIV: CHF 1'774.37

Manager: IST Investmentstiftung
Verwaltung: IST Investmentstiftung
Depositär: Lombard Odier Danier Hertsch & Cie
Vermögen: 529 Mio.
Leistung: 02.04.1993
Benchmark: Pictet BGI/GFP 25
IST Investmentstiftung für Personalvorsorge
Steinstrasse 21, Postfach, 8038 Zürich
044 455 37 00
www.istfund.ch

Monatsrenditen
2009-2010

Jahresende	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Juni	Juli	Aug	Sep	Ok	Nov	Dez	
2009	3.79	0.71	-0.83	-0.44	-0.27	2.68	1.79	1.00	0.85	0.85	-0.28	1.48	0.08
2010	4.88	4.78	1.79	1.71	-0.43	-0.08	-0.81	-0.04	-0.04	0.31	0.48	0.17	0.88
2011	10.42	11.40	1.84	-0.04	0.94	0.03	2.13	1.33	1.53	-0.22	1.76	+1.12	1.00
2012	0.07	0.00	0.66	1.00	0.08	-0.70	-1.40	-0.22	1.37	1.67	1.46	0.88	0.31
2013	0.94	-0.48	1.25	-0.98	0.01	1.15	-0.08	-0.21	-0.92	0.36	0.06	0.90	-0.21
2014	-0.88	-0.05	-0.83	-0.02	0.00	0.21	-0.88	1.16	0.88	-0.83	-0.80	1.53	0.88
2015	13.14	11.73	0.11	-0.87	1.76	2.88	0.89	0.78	0.44	1.44	1.07	-0.37	0.82
2016	1.81	3.00	0.31	0.87	1.00	0.38	-0.18	-0.81	1.27	-0.11	0.91	0.90	-0.00

Kumulierte Performance
2009-2010, 31.12.2009=100

Vergleichsanalyse
01.12.2009 - 31.12.2010

Strategie	Max. Drawdown	Volatilität	Sharpe Ratio	Alpha	Beta	Corr. Alpha/Beta
Mixta Optima 25	-9.93%	0.22%	2.05%	3.44%	91.67%	-0.95%
Pictet BGI/GFP 25	-8.07%	0.22%	2.05%	3.34%	98.17%	-0.87%

- Zurück
- Vorwärts
- Neu laden
- Speichern unter...
- Drucken...
- Übersetzen in Deutsch
- Seitenquelle anzeigen
- Seiteninfo anzeigen
- Element überprüfen

Anhang (Abkürzungen)

AFI	AFIAA Anlagestiftung für Immobilienanlagen im Ausland
ALZ	Allianz Suisse Anlagestiftung
ASI	Assetimmo Immobilien Anlagestiftung
AVA	Avadis Anlagestiftung
AWi	AWi Anlagestiftung für Personalvorsorge
BAL	Bâloise Anlagestiftung für Personalvorsorge
CSA	Credit Suisse Anlagestiftung
CSA2	Credit Suisse Anlagestiftung 2. Säule
ECO	Ecoreal Schweizerische Immobilien Anlagestiftung
HEL	Helvetia Anlagestiftung
HIG	HIG Immobilien Anlage Stiftung
IMO	Anlagestiftung Imoka
IST	IST Investmentstiftung für Personalvorsorge
IST2	IST2 Investmentstiftung
PAT	Patrimonium Anlagestiftung
PEN	Anlagestiftung Pensimo
PRI	Prisma Anlagestiftung
REN	Renaissance KMU, Schweizerische Anlagestiftung
SAR	Sarasin Anlagestiftung
SWA	Swisscanto Anlagestiftung Avant
SWC	Swisscanto Anlagestiftung
SWL	Anlagestiftung Swiss Life
TES	Anlagestiftung Testina
TUR	Anlagestiftung Turidomus
UBS	Anlagestiftung der UBS für Personalvorsorge
UBS2	UBS Investment Foundation 2
ZÜR	Zürich Anlagestiftung