Monatliche Entwicklung Performance und Deckungsgrad

sammelstiftung vita

Periode	Deckungsgrad [1]	MWR [2]		TTWR [3]		Benchmark [4]	
		Periode	kumuliert	Periode	kumuliert	Periode	kumuliert
2010							
Juni	96.1%	-1.77%	0.48%	-1.75%	0.58%	-1.87%	0.05%
Mai	97.7%	-0.69%	2.29%	-0.65%	2.39%	-0.75%	2.07%
April	98.6%	0.87%	3.04%	0.72%	3.05%	0.64%	2.85%
März	98.1%	1.17%	2.12%	1.34%	2.32%	1.23%	2.19%
Februar	96.9%	1.20%	0.94%	1.20%	0.97%	1.15%	0.95%
Januar	96.4%	-0.26%	-0.26%	-0.23%	-0.23%	-0.20%	-0.20%
2009							
4. Quartal	96.6% [5]	1.48%	11.60%	1.64%	12.74%	1.88%	12.77%
3. Quartal	95.8%	5.71%	9.84%	6.00%	10.86%	6.09%	10.69%
2. Quartal	90.3%	4.75%	3.91%	5.13%	4.61%	5.65%	4.34%
1. Quartal	86.1%	-0.82%	-0.82%	-0.49%	-0.49%	-1.24%	-1.24%
2008	87.4% [5]	-11.38%	-11.38%	-11.13%	-11.13%	-11.55%	-11.55%
2007	101.3% [5]	0.24%	0.24%	0.50%	0.50%	0.38%	0.38%
2006	104.5% [5]	3.34%	3.34%	3.89%	3.89%	2.94%	2.94%
2005	105.6% [5]	7.46%	7.46%	8.60%	8.60%	7.20%	7.20%

[1] Die Deckungsgrade basieren auf Hochrechnungen und sind nicht revidiert. Es besteht keine Gewähr für Vollständigkeit und Richtigkeit.

[2] MWR = Money Weighted Rate of Return; Performance eines Portfolios unter Berücksichtigung des Zu- und Abflusses von Kapital über den Bewertungszeitraum.

[3] TTWR = True Time Weighted Rate of Return; Performance eines Portfolios unter Vernachlässigung des Zu- und Abflusses von Kapital über den Bewertungszeitraum (seit 1.1.2010 auf täglicher Basis berechnet).

[4] Benchmark = Strategische Gewichtung der den Anlagegruppen zugrunde liegenden Benchmarks.

[5] Durch die Kontrollstelle geprüfter Deckungsgrad.