

# BVG-Mix 40 Plus

Tranche I

31.08.2020



## Anlagepolitik

Das Vorsorgeprodukt BVG-Mix 40 Plus investiert breit diversifiziert in die weltweiten Finanzmärkte. Im Vordergrund stehen allerdings Anlagen in Schweizer Aktien, Immobilien und Obligationen. Mit einer strategischen Aktienquote von 40% und einer taktischen Bandbreite von 25% - 50% ist das Produkt dynamisch ausgerichtet. Die Auswahl der Anlagen erfolgt unter Einhaltung der Anlagerichtlinien der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV2). Abhängig von der konjunkturellen Situation sowie der Einschätzung zum Zins-, Aktien- und Wechselkursumfeld werden innerhalb der Bandbreiten kontrollierte Abweichungen von der Anlagestrategie vorgenommen.

## Portfoliomanagement

**Daniel Kuenzi**  
Senior Portfoliomanager  
"BVG-Mix 40 Plus"



## Performance- und Risikokennzahlen

| Performance (p.a.)   | Anlagegruppe<br>(inkl. Kosten) | Benchmark<br>(exkl. Kosten) |
|----------------------|--------------------------------|-----------------------------|
| Laufendes Jahr (YTD) | -4.65%                         | -0.86%                      |
| Letzte 12 Monate     | -2.07%                         | 1.03%                       |
| Letzte 3 Jahre       | 2.18%                          | 4.34%                       |
| Letzte 5 Jahre       | 3.46%                          | 4.77%                       |
| Letzte 10 Jahre      | 4.10%                          | 5.20%                       |

### Risikokennzahlen (Basis letzte 3 Jahre)

|                                   |       |       |
|-----------------------------------|-------|-------|
| Durchschnittl. Volatilität (ann.) | 6.84% | 6.30% |
| Tracking error                    | 1.40% |       |

### Aktuelle Bewertung (in CHF)

Ausgabekurs pro Anteil 2'073.47

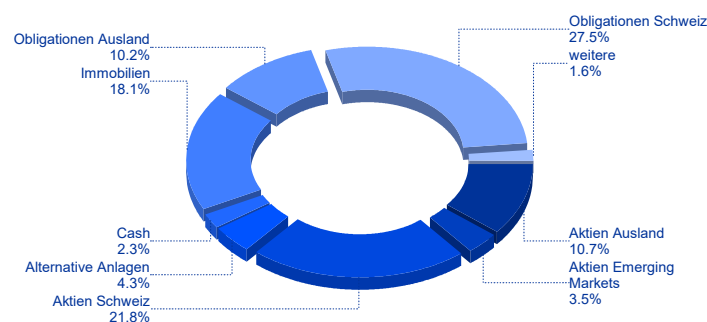


### Benchmark

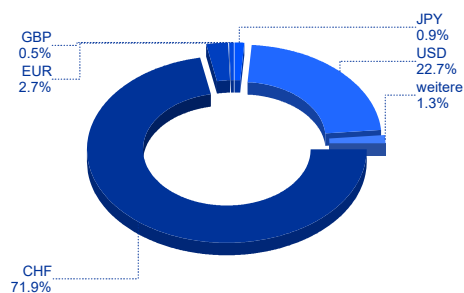
Die Benchmark der Anlagegruppe ist eine Customized Benchmark, bestehend aus

- 10% Citigroup World Gov Bond Index (USD)
- 25% Swiss Performance Index
- 12% MSCI World ex CH net TR
- 3% MSCI Daily TR Net Emerging Markets
- 3% SXI Real Estate Funds
- 3% SXI Real Estate Shares
- 38% Swiss Bond Index Total AAA-BBB
- 6% KGAST Immo-Index (1997=100)

## Aufteilung nach Anlagekategorien



## Aufteilung nach Währung



## Die 10 grössten Positionen in %

|  |                         |     |      |
|--|-------------------------|-----|------|
| iShares SMIM ETF CH                                | Aktien Schweiz          | CHF | 4.6% |
| Nestle SA  | Aktien Schweiz          | CHF | 4.6% |
| Roche Holding AG                                   | Aktien Schweiz          | CHF | 4.1% |
| iShares World ex-Euro Government Bond Index Fund   | Obligationen Ausland    | USD | 3.3% |
| Vanguard Emerging Markets Stock Index Fund/Ireland | Aktien Emerging Markets | USD | 3.2% |
| Novartis AG  | Aktien Schweiz          | CHF | 3.0% |
| SF Commercial Properties Fund                      | Immobilien              | CHF | 2.4% |
| Baloise Swiss Property Fund                        | Immobilien              | CHF | 2.3% |
| Swisscanto AST Immobilien Schweiz                  | Immobilien              | CHF | 1.8% |
| Baloise Senior Secured Loan Fund LUX-110U          | weitere                 | USD | 1.7% |

## Weitere Informationen zur Anlagegruppe

|                     |                                    |                     |                    |                    |   |
|---------------------|------------------------------------|---------------------|--------------------|--------------------|---|
| Anlagevermögen:     | CHF 16'972'507                     | Anzahl Ansprüche:   | 8'186              | Internet:          | www.baloise-anlagestiftung.ch               |
| Vermögensverwalter: | Baloise Asset Management AG        | Ertragsverwendung:  | thesaurierend      | E-Mail:            | anlagestiftung@baloise.ch                   |
| Revisionsstelle:    | Ernst & Young AG, Basel            | Valoren-Nummer:     | 835628             | Tel:               | +41 58 285 80 72                            |
| Domizil:            | Schweiz                            | erwartete TER 2020: | 0.65% p.a.         | Kurspublikationen: | Telekurs, KGAST, NZZ, Bloomberg: BAPBVM4 SW |
| Lancierung:         | 31.03.1997                         | Zeichnungsschluss:  | täglich, 12:00 Uhr |                    |   |
| Depotbank:          | Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich |                     |                    |                    |   |

## Nehmen Sie Kontakt mit uns auf

# BVG-Mix 40 Plus

Tranche I

31.08.2020



## Responsible Investment Policy

Der Fonds unterliegt der Responsible Investment (RI) Policy gemäss Vorgaben der Baloise Group. Die RI Policy kann unter folgendem Link abgerufen werden:

<https://www.baloise-asset-management.com/de/ch/ueber-uns/verantwortungsbewusstes-investieren.html>

Dieser Fonds ist «Classic Responsible», d.h. es wird nur teilweise die Einhaltung der Baloise RI Policy gewährleistet. Der Geltungsbereich der Baloise RI Policy umfasst keine Dritt-, passive oder White Label Produkte. Fonds, bei welchen wir die Einhaltung der Baloise RI Policy zu 100% gewährleisten können, werden als «Pure Responsible» bezeichnet.

### Responsible Investment Strategien

|                                  |   |
|----------------------------------|---|
| Ausschluss                       | ✓ |
| ESG-Integration                  | ✓ |
| Proxy Voting (bei den Zielfonds) | ✓ |
| Engagement (in Entwicklung)      |   |

### Ausschlusskriterien

|                                   |
|-----------------------------------|
| Produzenten kontroverser Waffen   |
| Liste gemäss SVVK-ASIR            |
| Emittenten mit Kohleumsatz > 30%  |
| ESG Rating < B (gemäss MSCI Inc.) |

### Portfolio

|   |
|---|
| ✓ |
| ✓ |
| ✓ |
| ✓ |

Signatory of:



## Wichtiger Rechtshinweis

Die Tranchen I und R dieser Anlagegruppe haften einander gegenüber für allfällige Verbindlichkeiten. Das vorliegende Werbedokument dient ausschliesslich Informationszwecken und stellt weder ein Angebot oder eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Ansprüchen an Anlagegruppen dar, noch ist es als Aufforderung anzusehen, ein Angebot zum Abschluss eines Vertrages über eine Wertpapierdienstleistung oder Nebenleistung abzugeben. Performancezahlen sind Vergangenheitswerte und geben keinen Hinweis auf zukünftige Wertentwicklungen. Die dargestellte Performance lässt allfällige bei Zeichnung und Rücknahme von Ansprüchen erhobene Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Kommissionen und Kosten wirken sich nachteilig auf die Performance aus. Mit jeder Anlage sind Risiken, insbesondere Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Trotz sorgfältigem Vorgehen können Daten unvollständig oder unkorrekt dargestellt sein. Für die Richtigkeit, Vollständigkeit oder Aktualität der in diesem Dokument enthaltenen Angaben sowie allfälligen Empfehlungen und Meinungen zur Marktentwicklung wird keine Haftung übernommen. Der Bâloise-Anlagestiftung für Personalvorsorge können sich Vorsorgeeinrichtungen sowie steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die nach ihrem Zweck der beruflichen Vorsorge dienen anschliessen; des Weiteren können sich Personen, die kollektive Anlagen der vorerwähnten Einrichtungen verwalten und von der Eidg. Finanzmarktaufsicht beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen, anschliessen. Ansprüche an Anlagegruppen der Bâloise-Anlagestiftung für Personalvorsorge dürfen ausserhalb der Schweiz weder angeboten noch verkauft werden. Statuten und Reglement, Anlagerichtlinien, Gebührenreglement sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos bei der Bâloise-Anlagestiftung für Personalvorsorge, Aeschengraben 21, CH-4002 Basel angefordert werden.

«Swiss Exchange AG» («SIX Swiss Exchange») ist die Quelle des Swiss Performance Index und der darin enthaltenen Daten. SIX Swiss Exchange war in keinerlei Form an der Erstellung der in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen beteiligt. SIX Swiss Exchange übernimmt keinerlei Gewährleistung und schliesst jegliche Haftung (sowohl aus fahrlässigem sowie aus anderem Verhalten) in Bezug auf die in dieser Berichterstattung enthaltenen Informationen - wie unter anderem für die Genauigkeit, Angemessenheit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Rechtzeitigkeit und Eignung für beliebige Zwecke - sowie hinsichtlich Fehlern, Auslassungen oder Unterbrechungen im Swiss Performance Index oder dessen Daten aus. Jegliche Verbreitung oder Weitergabe der von SIX Swiss Exchange stammenden Informationen ist untersagt.»