

BVG-Mix Dynamic Allocation 0-40

Tranche I

31.07.2020



Anlagepolitik

Das Anlagegefäss BVG-Mix Dynamic Allocation investiert in erster Linie in Schweizer Obligationen, Schweizer Aktien und Immobilien. Dank der dynamischen Ausrichtung kann es flexibel auf Markttendenzen reagieren. Die Aktienquote variiert von 0 bis max. 40%. Jeweils zu Jahresbeginn startet das Gefäss mit einer Aktienquote von rund 20%. Daneben wird mit rund 20% in weitere, ebenfalls chancenreiche Anlagen investiert (z.B. Immobilienfonds). Ergänzend erfolgen zu rund 60% Investitionen in auf Kapitalerhalt ausgerichtete Anlagen mit vergleichsweise geringen Wertschwankungen (z.B. Schweizer Obligationen). Im Jahresverlauf werden in Zeiten sinkender Finanzmärkte die chancenreichen Anlagen mit höheren Wertschwankungen (z.B. Aktien) sukzessive abgebaut und dafür auf Kapitalerhalt ausgerichtete Anlagen schrittweise erhöht. Grössere Verluste auf dem Anlagevermögen sollen dadurch verhindert werden. In Zeiten längerfristig steigender Aktienmärkte werden im Jahresverlauf chancenreiche Anlagen gezielt erhöht mit dem Ziel, von Kurssteigerungen zu profitieren. Die Wahl der Anlagen erfolgt unter Einhaltung der Anlagerichtlinien der Verordnung über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVV2).

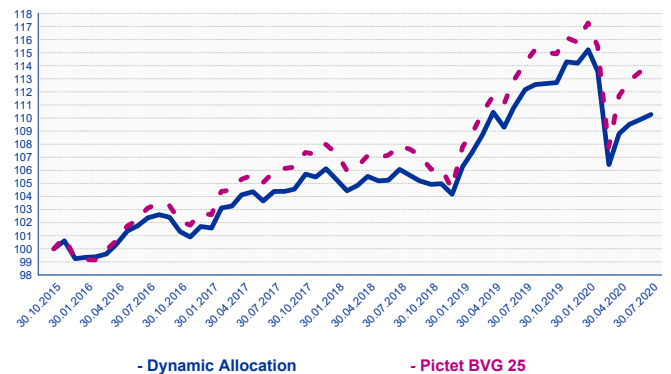
Portfoliomangement

Andreas Bertschi
Senior Portfoliomanager
"BVG-Mix Dynamic Allocation 0-40"



Performance- und Risikokennzahlen

| Performance* | Dynamic Allocation 0-40 (inkl. Kosten) | Index Pictet BVG 25 (exkl. Kosten) |
|-------------------------|---|---------------------------------------|
| Laufendes Jahr (YTD) | -3.45% | -1.12% |
| Letzter Monat | 0.35% | 0.85% |
| Letzte 12 Monate | -1.71% | 0.24% |
| Letzte 3 Jahre | 1.83% | 2.63% |
| Seit Lancierung | 10.26% | 14.50% |
| Risikokennzahlen | | |
| Volatilität | 3.14% | 5.14% |

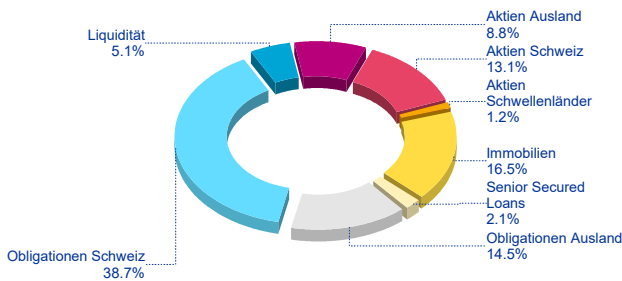


* Das Anlagegefäss BVG-Mix Dynamic Allocation verfügt über keinen Benchmark. Die Gegenüberstellung mit dem Index Pictet BVG 25 erfolgt im Rahmen eines einfachen Vergleiches.

Aktuelle Bewertung

| | | |
|-------------------------------|-----|------------|
| Ausgabekurs pro Anteil (NAV) | CHF | 1'102.64 |
| Vermögen Tranche I: | CHF | 21'093'630 |
| Sicherheitsniveau pro Anteil: | CHF | 993.54 |

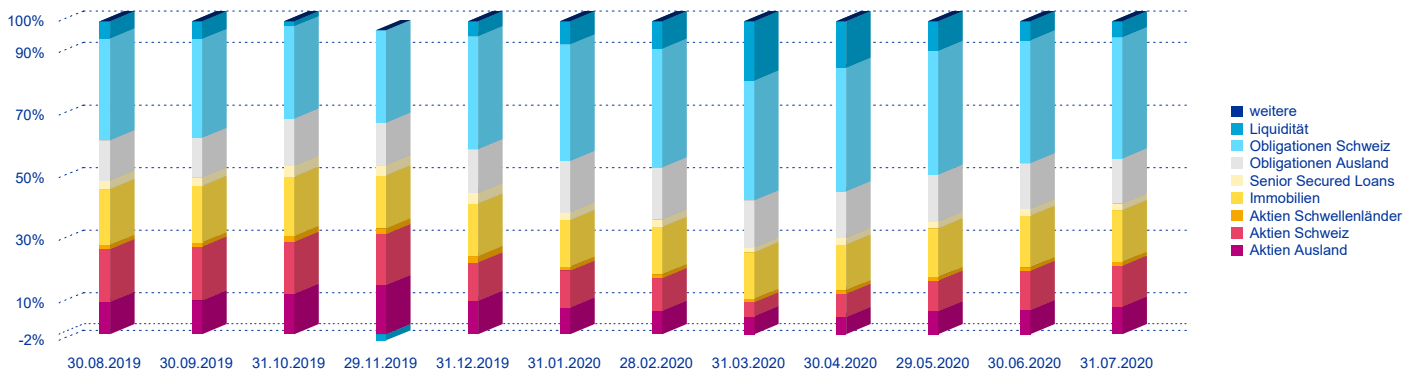
Aufteilung nach Anlagekategorien



Die 10 grössten Positionen

| | |
|--|------|
| Nestle SA | 3.8% |
| Roche Holding AG | 2.8% |
| CSIF CH I Real Estate Switzerland Blue | 2.8% |
| Novartis AG | 2.2% |
| CSA Real Estate Switzerland Pooled Investments | 2.2% |
| CSIF CH World ex CH Index | 2.2% |
| Invesco Zodiac Funds - Invesco US Senior Loan Fund | 2.1% |
| Credit Suisse AG/London, 0.00%, 14/06/21 | 2.0% |
| Akara Swiss Diversity Property Fund PK | 1.8% |
| Die Anlagegruppe Gewerbeimmobilien Schweiz DAGSIS | 1.3% |

Entwicklung der Vermögensaufteilung



Weitere Informationen zur Anlagegruppe

| | |
|---------------------|------------------------------------|
| Vermögen Tranche I: | CHF 21'093'630 |
| Vermögensverwalter: | Baloise Asset Management AG |
| Revisionsstelle: | Ernst & Young AG, Basel |
| Domizil: | Schweiz |
| Lancierung: | 30.10.2015 |
| Depotbank: | Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich |

Nehmen Sie Kontakt mit uns auf

| | |
|--------------------|---|
| Internet: | www.baloise-anlagestiftung.ch |
| E-Mail: | anlagestiftung@baloise.ch |
| Tel: | +41 58 285 80 72 |
| Kurspublikationen: | Telekurs, KGAST, NZZ Bloomberg: BAPMDYN SW |

| | |
|---------------------|-------------------|
| Anzahl Ansprüche: | 19'130 |
| Ertragsverwendung: | thesaurierend |
| Valoren-Nummer: | 28532591 |
| erwartete TER 2020: | 0.55% p.a. |
| Zeichnungsschluss: | täglich 12:00 Uhr |

BVG-Mix Dynamic Allocation 0-40

Tranche I

31.07.2020



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 | ✓ |
| Emitenten 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 Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken und stellt kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Anrechten von 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 Anteilen 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 Informationen wird keine Haftung übernommen. Der Anlegerkreis ist auf in der Schweiz domizilierte steuerbefreite Vorsorgeeinrichtungen der 2. Säule beschränkt. Anrechte an Anlagegruppen der Bâloise-Anlagestiftung für Personalvorsorge dürfen ausserhalb der Schweiz weder angeboten noch verkauft werden. Statuten und Reglement, Anlagerichtlinien, Gebührenreglement sowie Jahres- und Semesterberichte können kostenlos bei der Bâloise-Anlagestiftung für Personalvorsorge, Aeschengraben 21, CH-4002 Basel angefordert werden.

Begriffserklärung

NAV: Nettoinventarwert oder Wert des Anteils.

Sicherheitsniveau: Das Sicherheitsniveau stellt den Vermögenswert dar, den das Fondsvermögen der Anlagegruppe BVG-Mix Dynamic Allocation 0-40 nicht unterschreiten sollte. Ein Erreichen des Sicherheitsniveaus löst eine Umschichtung in risikoärmere Anlagen aus.

Volatilität: Schwankungsbreite z.B. eines Wertpapiers oder Fondskurses.

Vergleichsindex: BVG-konformer Vergleichsindex von Pictet mit einem Aktienanteil von 25%.