

# BVG-Mix Dynamic Allocation 0-40

Tranche I

29.05.2020



## 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).

## Performance- und Risikokennzahlen

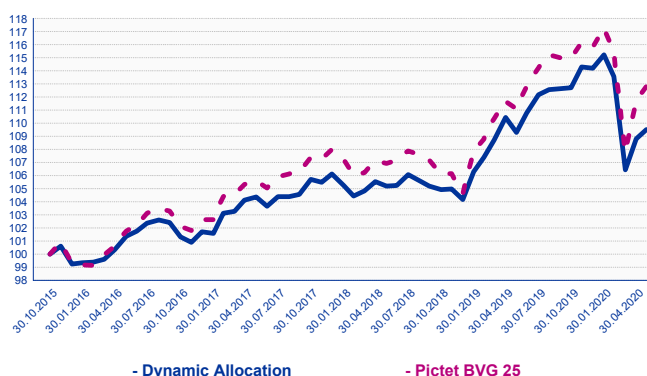
Performance*	Dynamic Allocation 0-40 (inkl. Kosten)	Index Pictet BVG 25 (exkl. Kosten)
Laufendes Jahr (YTD)	-4.11%	-2.58%
Letzter Monat	0.65%	1.03%
Letzte 12 Monate	0.20%	1.57%
Letzte 3 Jahre	1.61%	2.21%
Seit Lancierung	9.51%	12.81%
<b>Risikokennzahlen</b>		
Volatilität	7.74%	13.48%

## Aktuelle Bewertung

Ausgabekurs pro Anteil (NAV)	CHF	1'095.06
Vermögen Tranche I:	CHF	21'360'510
Sicherheitsniveau pro Anteil:	CHF	993.54

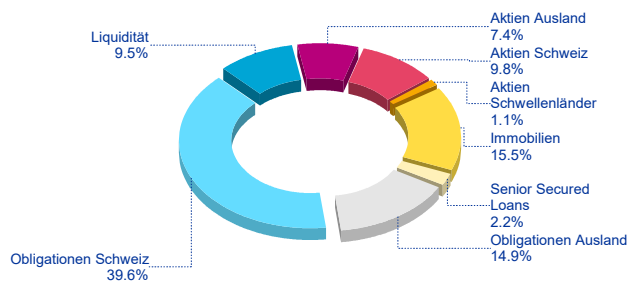
## Portfoliomanagement

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



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

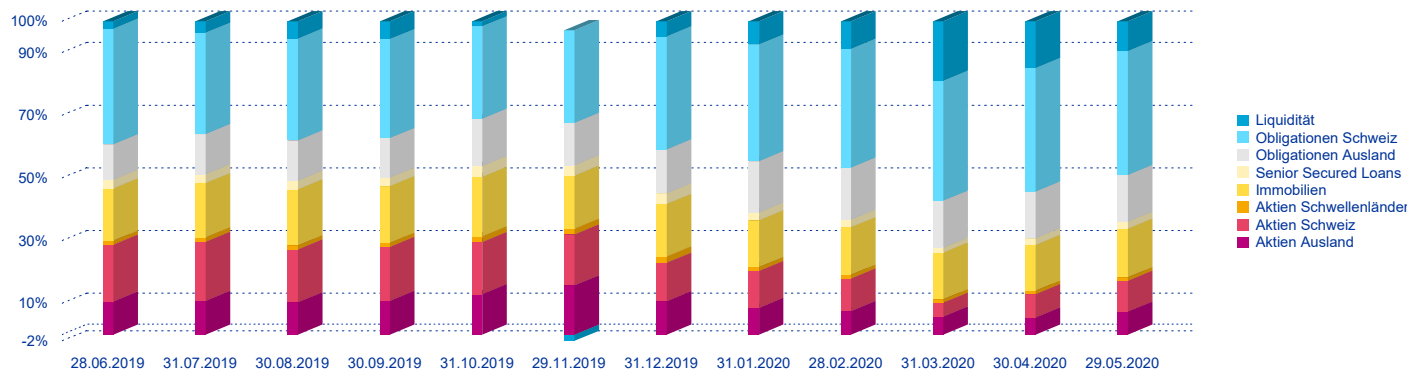
## Aufteilung nach Anlagekategorien



## Die 10 grössten Positionen

Nestle SA	2.7%
CSIF CH I Real Estate Switzerland Blue	2.5%
Roche Holding AG	2.2%
Credit Suisse AG/London, 0.00%, 14/06/21	2.2%
Invesco Zodiac Funds - Invesco US Senior Loan Fund	2.2%
Novartis AG	1.9%
Akara Swiss Diversity Property Fund PK	1.9%
CSA Real Estate Switzerland Pooled Investments	1.6%
CSIF CH World ex CH Index	1.4%
Pictet - Emerging Local Currency Debt	1.3%

## Entwicklung der Vermögensaufteilung



## Weitere Informationen zur Anlagegruppe

Vermögen Tranche I:	CHF 21'360'510
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:	19'506
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

29.05.2020



## 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%.