

Swiss Franc Bonds Optimized

vormals Obligationen Schweiz

31.07.2020



Anlagepolitik

Das Anlagegefäss "Swiss Franc Bonds Optimized" investiert in auf CHF denominateden Obligationen weltweit mit Investment Grade Rating (zum Zeitpunkt der Kaufentscheidung) mit bestmöglicher Marktliquidität. Bei der Auswahl der Schuldner halten wir uns an den Grundsatz einer optimierten Risikoverteilung für das Portfolio. Die Laufzeitenallokation des Portfolios resultiert aus einer Optimierung des Rollertrags, wobei sich die Zusammensetzung und die durchschnittliche Laufzeit des Portfolios grundsätzlich an der Benchmark orientieren.

Portfoliomanagement

Julian Wiedmer
Senior Portfoliomanager
"Swiss Franc Bonds Optimized"



Performance- und Risikokennzahlen

Performance (p.a.)	Anlagegruppe (inkl. Kosten)	Benchmark (exkl. Kosten)
Laufendes Jahr (YTD)	0.12%	0.38%
Letzte 12 Monate	-1.53%	-1.11%
Letzte 3 Jahre	1.20%	1.53%
Letzte 5 Jahre	0.76%	1.08%
Letzte 10 Jahre	1.82%	2.17%
Risikokennzahlen (Basis letzte 3 Jahre)		
Rendite auf Verfall	-0.04%	-0.12%
Duration (modified)	7.41	7.66
Tracking error	0.52%	
Aktuelle Bewertung (in CHF)		
Ausgabekurs pro Anteil	1'513.27	



¹ Per 17.05.2019 erfolgte die Absorption der Anlagegruppe BAP Obligationen Ausland CHF durch die Anlagegruppe BAP Obligationen Schweiz. Bei der verbleibenden Anlagegruppe Obligationen Schweiz erfolgte zugleich eine Neuaufrichtung der Anlagestrategie inklusive einer Namensänderung zu Swiss Franc Bonds Optimized.

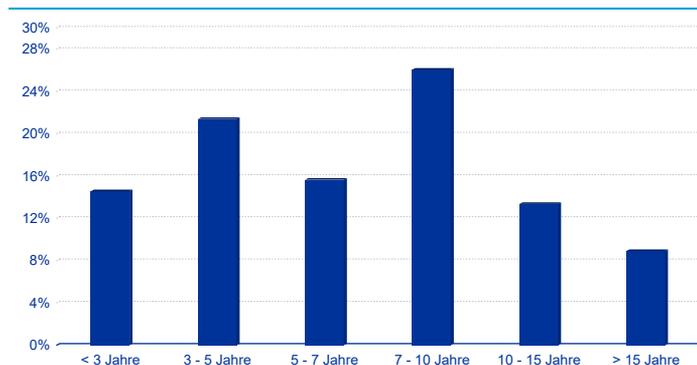
Benchmark

Swiss Bond Index Total AAA-BBB

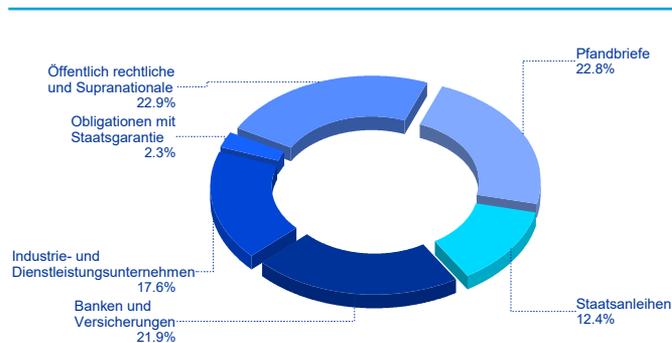
Ratingstruktur

AAA	47.2%
AA	18.1%
A	19.9%
BBB	13.0%
BB	0.6%
not rated	1.1%

Laufzeitenstruktur



Schuldnerstruktur



Die 10 grössten Positionen in %

Swiss Confederation Government Bond, 0.00%, 22/06/29	CHF	2.2%
Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 06/01/49	CHF	1.2%
Bank of Nova Scotia/The, 0.30%, 03/04/28	CHF	1.1%
Swiss Confederation Government Bond, 2.25%, 22/06/31	CHF	1.1%
Province of New Brunswick Canada, 0.13%, 06/12/32	CHF	1.1%
Bank of Montreal, 0.04%, 07/04/26	CHF	1.1%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute, 1.88%, 15/09/31	CHF	1.0%
Swiss Confederation Government Bond, 1.25%, 27/06/37	CHF	0.9%
Luzerner Kantonalbank AG, 0.00%, 07/08/28	CHF	0.9%
Walliser Kantonalbank, 0.00%, 14/02/29	CHF	0.8%

Weitere Informationen zur Anlagegruppe

Anlagevermögen:	CHF 346'888'637
Vermögensverwalter:	Baloise Asset Management AG
Revisionsstelle:	Ernst & Young AG, Basel
Domizil:	Schweiz
Lancierung: ²	01.11.1995
Depotbank:	Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Anzahl Ansprüche:	229'232	Internet:	www.baloise-anlagestiftung.ch
Ertragsverwendung:	thesaurierend	E-Mail:	anlagestiftung@baloise.ch
Valoren-Nummer:	835654	Tel:	+41 58 285 80 72
erwartete TER 2020:	0.22% p.a.	Kurspublikationen:	Telekurs, KGAS, NZZ, Bloomberg: BAPOBLS SW
Zeichnungsschluss:	täglich, 12:00 Uhr		

² Hinweis Lancierung: Per 17.05.2019 erfolgte die Absorption der Anlagegruppe BAP Obligationen Ausland CHF durch die Anlagegruppe BAP Obligationen Schweiz. Bei der verbleibenden Anlagegruppe Obligationen Schweiz erfolgte zugleich eine Neuaufrichtung der Anlagestrategie inklusive einer Namensänderung zu Swiss Franc Bonds Optimized.

Swiss Franc Bonds Optimized

vormals Obligationen Schweiz

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 «Pure Responsible», d.h. es wird bei 100% der Anlagen die Einhaltung der RI Policy gewährleistet. Bei Fonds, welche als «Classic Responsible» deklariert sind, wird die Einhaltung der RI Policy nur teilweise gewährleistet, weil darin Dritt-, passive oder White Label Produkte enthalten sind.

Responsible Investment Strategien

Ausschluss	✓
ESG-Integration	✓
Ausübung der Stimmrechte	
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

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 Stiftung 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.

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 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 Bond Index Total AAA-BBB 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.»

www.baloise-anlagestiftung.ch

Wir freuen uns, Sie zu beraten:
Bâloise-Anlagestiftung
für Personalvorsorge
Aeschengraben 21, Postfach
CH-4002 Basel

Kontakt:
Robert Antonietti
Geschäftsführer
Tel. +41 58 285 86 94
Robert.Antonietti@baloise.com