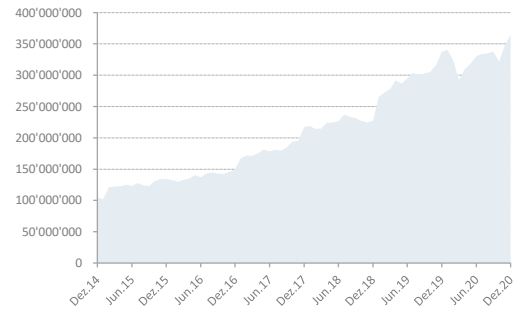


# 31.12.2020 | BEVO Vorsorgestiftung

## Wertentwicklung Gesamtvermögen

Marktwert in Schweizer Franken

	laufendes Jahr 1.1.2020 - 31.12.2020	historisch ab 31.12.2014
Ausgangswert:	<b>337'610'925</b>	<b>105'047'739</b>
Kapitaleinlagen:	110'243'594	530'601'497
Kapitalrückzug:	<b>-82'785'500</b>	<b>-343'362'027</b>
Wertveränderung:	<b>-37'914</b>	<b>72'743'896</b>
Endwert:	<b>365'031'105</b>	<b>365'031'105</b>



## Deckungsgradschätzer

Deckungsgrad per 31.12.2019:	<b>118.3%</b>
Rendite seit Jahresanfang	-0.4%
Sollrendite pro rata	-4.0%
Geschätzter Deckungsgrad per 31.12.2020	<b>113.3%</b>

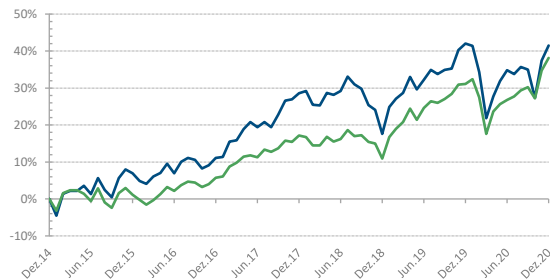
(4% p.a. = technischer Zinssatz 3% p.a. + 1% p.a.)

## Performance Gesamtvermögen

— BEVO — Benchmark

	BEVO	Benchmark	relativ
seit Jahresbeginn:	<b>-0.37%</b>	5.34%	<b>-5.71%</b>
letzter Monat:	<b>2.97%</b>	2.49%	0.48%
letzte 3 Monate	<b>4.83%</b>	6.10%	<b>-1.27%</b>
letztes Jahr:	<b>20.81%</b>	18.21%	2.60%
seit 31.12.2018:	<b>20.37%</b>	24.52%	<b>-4.15%</b>

(seit letzter Performance-Fee-Abrechnung)

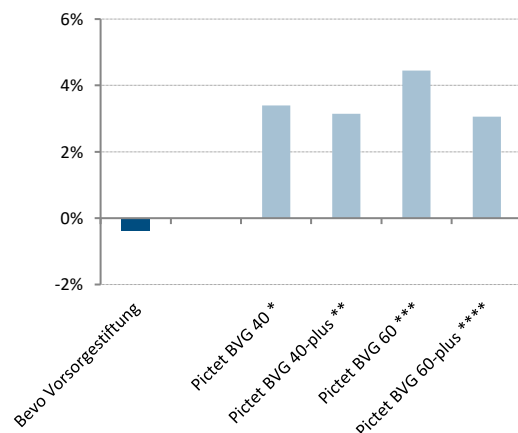


## BVG-Universum

Performance in CHF seit Jahresbeginn

Index	Performance YTD
<b>Bevo Vorsorgestiftung</b>	<b>-0.37%</b>
Pictet BVG 40 *	3.39%
Pictet BVG 40-plus **	3.15%
Pictet BVG 60 ***	4.45%
Pictet BVG 60-plus ****	3.06%

- \* Aktien 40%; keine Immobilien und Alternative Anlagen
- \*\* Aktien 30%; Immobilien 10%, Alternative Anlagen 10%
- \*\*\* Aktien 60%; keine Immobilien und Alternative Anlagen
- \*\*\*\* Aktien 45%; Immobilien 10%, Alternative Anlagen 15%



# 31.12.2020 | BEVO Vorsorgestiftung

## Anlagestruktur Gesamtvermögen und Bandbreiten

Anlagekategorie	Strategie	BEVO	Bandbreiten	Status	WHG	Index	Performance YTD	
							Index	BEVO
Liquidität	5.0%	4.9%	0 - 25%	OK	CHF+FW	Citigroup CHF 3 M	-0.77%	n.a.
Obligationen CHF	19.0%	11.9%	0 - 30%	OK	CHF	SBI AAA-BBB TR	0.90%	0.69%
Obligationen FW <sup>1</sup>	8.0%	5.8%	0 - 12%	OK	FW	Citigroup WGBI custom	1.84%	1.90%
Aktien Schweiz/FL	18.0%	28.7%	15 - 30%	OK	CHF	SPI TR	3.82%	-3.51%
Aktien Ausland	23.0%	25.5%	10 - 30%	OK	FW	MSCI World Dev. NR	5.80%	-3.64%
Aktien Emerging Mkts.	3.0%	3.47%	0 - 5%	OK	FW	MSCI EM NR	7.99%	23.94%
Private Equity	4.0%	0.8%	0 - 5%	OK	CHF	LPX 50 Index	0.96%	-38.97%
Hedge Fonds	0.0%	0.0%	0 - 5%	OK	FW	BEVO Benchmark	5.34%	n.a.
Immobilien Schweiz	20.0%	18.9%	5 - 30%	OK	CHF	SXI Immofonds TR	10.81%	8.21%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>	<b>100.0%</b>					<b>5.34%</b>	<b>-0.37%</b>

<sup>1</sup> Performancemessung inkl. Fremdwährungsabsicherung

## Begrenzung Gesamtkategorien

Bezeichnung	Strategie	BEVO	Bandbreiten	Status	Einzelbegrenzungen   Details
Auslandschuldner	27.0%	17.7%	15 - 42%	OK	Max. Durationabweichung +/- 30% Index
Fremdwährungen <sup>2</sup>	34.0%	35.4%	15 - 47%	OK	Ohne Begründung Max. 40% gemäss BPVV
Aktien inkl. Private Equity	48.0%	58.4%	25 - 60%	OK	Max. 3% der Börsenkapitalisierung
Aktien und Immobilien	68.0%	77.3%	30 - 80%	OK	Max. Fremdfinanzierung 60%
Alternative Anlagen	4.0%	0.8%	0 - 5%	OK	gemäss BPVV Art. 25 k)

<sup>2</sup> Aktien-Anlagefonds mit Referenzwährung CHF ohne Look-Through zu 100% den Fremdwährungen zugeordnet

