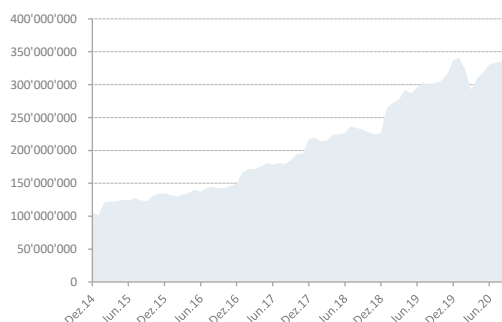


# 31.10.2020 | BEVO Vorsorgestiftung

## Wertentwicklung Gesamtvermögen

Marktwert in Schweizer Franken

	laufendes Jahr 1.1.2020 - 31.10.2020	historisch ab 31.12.2014
Ausgangswert:	<b>337'610'925</b>	<b>105'047'739</b>
Kapitaleinlagen:	95'040'579	515'398'482
Kapitalrückzug:	-75'163'100	-335'739'627
Wertveränderung:	<b>-35'799'970</b>	<b>36'981'841</b>
Endwert:	<b>321'688'434</b>	<b>321'688'434</b>



## Deckungsgradschätzer

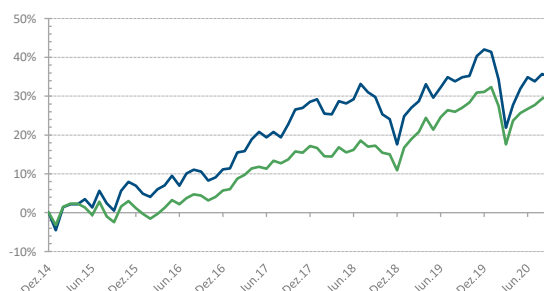
Deckungsgrad per 31.12.2019:	<b>118.3%</b>
Rendite seit Jahresanfang	-10.3%
Sollrendite pro rata	-3.3% (4% p.a. = technischer Zinssatz 3% p.a. + 1% p.a.)
Geschätzter Deckungsgrad per 31.10.2020	<b>102.7%</b>

## Performance Gesamtvermögen

— BEVO — Benchmark

	BEVO	Benchmark	relativ
seit Jahresbeginn:	<b>-10.30%</b>	-2.97%	-7.33%
letzter Monat:	<b>-5.62%</b>	-2.26%	-3.36%
letzte 3 Monate	<b>-4.77%</b>	-0.39%	-4.38%
letztes Jahr:	<b>20.81%</b>	18.21%	2.60%
seit 31.12.2018:	<b>8.37%</b>	14.70%	-6.33%

(seit letzter Performance-Fee-Abrechnung)

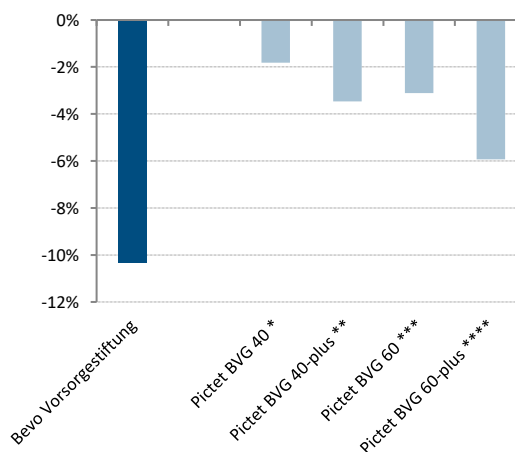


## BVG-Universum

Performance in CHF seit Jahresbeginn

Index	Performance YTD
<b>Bevo Vorsorgestiftung</b>	<b>-10.30%</b>
Pictet BVG 40 *	-1.81%
Pictet BVG 40-plus **	-3.46%
Pictet BVG 60 ***	-3.11%
Pictet BVG 60-plus ****	-5.92%

- \* 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%



## 31.10.2020 | BEVO Vorsorgestiftung

## Anlagestruktur Gesamtvermögen und Bandbreiten

Anlagekategorie	Strategie	BEVO	Bandbreiten	Status	WHG	Index	Performance YTD	
							Index	BEVO
Liquidität	5.0%	4.4%	0 - 25%	OK	CHF+FW	Citigroup CHF 3 M	-0.63%	n.a.
Obligationen CHF	19.0%	13.4%	0 - 30%	OK	CHF	SBI AAA-BBB TR	0.50%	-0.22%
Obligationen FW <sup>1</sup>	8.0%	6.6%	0 - 12%	OK	FW	Citigroup WGBI custom	1.57%	-1.04%
Aktien Schweiz/FL	18.0%	27.4%	15 - 30%	OK	CHF	SPI TR	-6.57%	-17.52%
Aktien Ausland	23.0%	24.7%	10 - 30%	OK	FW	MSCI World Dev. NR	-6.69%	-16.77%
Aktien Emerging Mkts.	3.0%	3.59%	0 - 5%	OK	FW	MSCI EM NR	-4.52%	12.91%
Private Equity	4.0%	0.8%	0 - 5%	OK	CHF	LPX 50 Index	-19.01%	-45.93%
Hedge Fonds	0.0%	0.0%	0 - 5%	OK	FW	BEVO Benchmark	-2.97%	n.a.
Immobilien Schweiz	20.0%	19.1%	5 - 30%	OK	CHF	SXI Immofonds TR	0.49%	-0.68%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>	<b>100.0%</b>					<b>-2.97%</b>	<b>-10.30%</b>

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

## Begrenzung Gesamtkategorien

Bezeichnung	Strategie	BEVO	Bandbreiten	Status	Einzelbegrenzungen   Details
Auslandschuldner	27.0%	20.0%	15 - 42%	OK	Max. Durationabweichung +/- 30% Index
Fremdwährungen <sup>2</sup>	34.0%	34.8%	15 - 47%	OK	Ohne Begründung Max. 40% gemäss BPVV
Aktien inkl. Private Equity	48.0%	56.5%	25 - 60%	OK	Max. 3% der Börsenkapitalisierung
Aktien und Immobilien	68.0%	75.6%	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

