

## Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. Dezember 2022

### Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

|  | CHF Mio.      | %              | Strategie     | Min. | Max | BVV2 Max. |
|--|---------------|----------------|---------------|------|-----|-----------|
| Liquidität                                       | 16.80         | 2.84%          | 1.0%          | 0%   | 10% |           |
| Obligationen CHF                                 | 48.70         | 8.25%          | 10.0%         | 5%   | 25% |           |
| Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF       | 55.26         | 9.36%          | 12.5%         | 7%   | 27% |           |
| Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF     | 23.15         | 3.92%          | 2.5%          | 0%   | 5%  |           |
| Hypotheken Schweiz                               | 0.50          | 0.08%          | 0.0%          | 0%   | 2%  |           |
| Total Festverzinsliche Anlagen                   | 127.60        | 21.61%         | 25.0%         | 12%  | 58% |           |
| Aktien Schweiz                                   | 83.93         | 14.21%         | 14.0%         | 9%   | 17% |           |
| Aktien Ausland                                   | 83.07         | 14.07%         | 14.0%         | 9%   | 17% |           |
| Aktien Emerging Markets                          | 18.46         | 3.13%          | 3.0%          | 0%   | 5%  |           |
| Total Aktien                                     | 185.46        | 31.41%         | 31.0%         | 18%  | 39% | 50%       |
| Nicht kotierte Anlagen Schweiz                   | 4.72          | 0.80%          | 2.0%          | 0%   | 4%  | 5%        |
| Immobilien Schweiz, direkte Anlagen              | 53.82         | 9.12%          |               |      |     |           |
| Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen            | 115.94        | 19.63%         |               |      |     |           |
| Total Immobilien Schweiz                         | 169.77        | 28.75%         | 27.0%         | 20%  | 30% | 30%       |
| Infrastruktur, hedged in CHF                     | 9.45          | 1.60%          | 2.0%          | 0%   | 4%  | 10%       |
| Microfinance, hedged in CHF                      | 16.57         | 2.81%          | 3.0%          | 0%   | 4%  |           |
| Insurance linked Securities (ILS), hedged in CHF | 15.82         | 2.68%          | 3.0%          | 0%   | 4%  |           |
| Private Equity, hedged in CHF                    | 44.12         | 7.47%          | 6.0%          | 4%   | 10% |           |
| Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber               | 0.20          | 0.03%          | 0.0%          | 0%   | 2%  |           |
| Total Alternative Anlagen                        | 76.70         | 12.99%         | 12.0%         | 4%   | 15% | 15%       |
| <b>Total</b>                                     | <b>590.51</b> | <b>100.00%</b> | <b>100.0%</b> |      |     |           |

#### Anmerkungen:

Anlageklassen mit währungsgesicherter Benchmark sind jederzeit zu 85 - 100% gegenüber CHF abzusichern.

### Organisation der Vermögensverwaltung

| Anlagesegmente                     | verwaltet durch                          | CHF Mio.      | %              |
|------------------------------------|--|---------------|----------------|
| Liquidität, Obligationen, Aktien   | Zürcher Kantonalbank                     | 156.35        | 26.48%         |
|                                    | Vontobel Asset Management AG             | 161.11        | 27.28%         |
| Hypotheken Schweiz                 | PROSPERITA                               | 0.50          | 0.08%          |
| Immobilien Schweiz                 | PROSPERITA                               | 169.77        | 28.75%         |
| Nicht kotierte Anlagen Schweiz     | Renaissance                              | 4.72          | 0.80%          |
| Infrastruktur                      | Allianz Global Investors, Partners Group | 9.45          | 1.60%          |
| Microfinance                       | PROSPERITA (Kollektivanlagen)            | 16.57         | 2.81%          |
| Insurance linked Securities        | PROSPERITA (Kollektivanlagen)            | 15.82         | 2.68%          |
| Private Equity                     | Partners Group, Schroder Adveq           | 44.12         | 7.47%          |
| Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber | PROSPERITA                               | 0.20          | 0.03%          |
| Cash (Zahlungsverkehr)             | PROSPERITA                               | 11.91         | 2.02%          |
| <b>Total</b>                       |  | <b>590.51</b> | <b>100.00%</b> |

### Performance

|                  | 2016  | 2017  | 2018   | 2019   | 2020  | 2021   | 2022 YTD      | Q4 2022      | 7 Jahre p.a. |
|------------------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|---------------|--------------|--------------|
| Nettoperformance | 1.89% | 7.64% | -4.08% | 12.44% | 6.04% | 10.09% | <b>-9.21%</b> | <b>2.60%</b> | <b>3.27%</b> |

#### Anmerkungen:

Die Angaben zur Performance entsprechen den von der Depotbank ausgewiesenen Zahlen.