

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

30. September 2023

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	19.77	2.85%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	61.20	8.81%	10.0%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	76.66	11.03%	12.5%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	23.53	3.39%	2.5%	0%	5%	
Hypotheken Schweiz	0.50	0.07%	0.0%	0%	2%	
Total Festverzinsliche Anlagen	161.89	23.30%	25.0%	12%	58%	
Aktien Schweiz	99.61	14.34%	14.0%	9%	17%	
Aktien Ausland	100.68	14.49%	14.0%	9%	17%	
Aktien Emerging Markets	21.01	3.02%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	221.31	31.86%	31.0%	18%	39%	50%
Nicht kotierte Anlagen Schweiz	6.91	1.00%	2.0%	0%	4%	5%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	65.31	9.40%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	124.54	17.93%				
Total Immobilien Schweiz	189.85	27.33%	27.0%	20%	30%	30%
Infrastruktur, hedged in CHF	13.02	1.87%	2.0%	0%	4%	10%
Microfinance, hedged in CHF	17.48	2.52%	3.0%	0%	4%	
Insurance linked Securities (ILS), hedged in CHF	16.94	2.44%	3.0%	0%	4%	
Private Equity, hedged in CHF	47.34	6.81%	6.0%	4%	10%	
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	0.19	0.03%	0.0%	0%	2%	
Total Alternative Anlagen	81.95	11.80%	12.0%	4%	15%	15%
Total	694.70	100.00%	100.0%			

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	192.94	27.77%
	Vontobel Asset Management AG	199.16	28.67%
Hypotheken Schweiz	PROSPERITA	0.50	0.07%
Immobilien Schweiz	PROSPERITA	189.85	27.33%
Nicht kotierte Anlagen Schweiz	Renaissance	6.91	1.00%
Infrastruktur	Allianz Global Investors, Partners Group	13.02	1.87%
Microfinance	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	17.48	2.52%
Insurance linked Securities	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	16.94	2.44%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq	47.34	6.81%
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	PROSPERITA	0.19	0.03%
Cash (Zahlungsverkehr)	PROSPERITA	10.36	1.49%
Total		694.70	100.00%

Performance

	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023 YTD	Q3 2023	7 Jahre p.a.
Nettoperformance	7.64%	-4.08%	12.44%	6.04%	10.09%	-9.21%	2.71%	-0.92%	3.41%

Anmerkungen:

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