

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. Dezember 2023

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	17.13	2.37%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	61.95	8.58%	10.0%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	86.11	11.93%	12.5%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	23.34	3.23%	2.5%	0%	5%	
Hypotheken Schweiz	0.50	0.07%	0.0%	0%	2%	
Total Festverzinsliche Anlagen	171.90	23.82%	25.0%	12%	58%	
Aktien Schweiz	108.66	15.06%	14.0%	9%	17%	
Aktien Ausland	105.13	14.57%	14.0%	9%	17%	
Aktien Emerging Markets	19.42	2.69%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	233.21	32.31%	31.0%	18%	39%	50%
Nicht kotierte Anlagen Schweiz	8.06	1.12%	2.0%	0%	4%	5%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	68.96	9.56%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	125.84	17.44%				
Total Immobilien Schweiz	194.80	26.99%	27.0%	20%	30%	30%
Infrastruktur, hedged in CHF	14.38	1.99%	2.0%	0%	4%	10%
Microfinance, hedged in CHF	17.56	2.43%	3.0%	0%	4%	
Insurance linked Securities (ILS), hedged in CHF	17.72	2.46%	3.0%	0%	4%	
Private Equity, hedged in CHF	46.65	6.46%	6.0%	4%	10%	
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	0.29	0.04%	0.0%	0%	2%	
Total Alternative Anlagen	82.22	11.39%	12.0%	4%	15%	15%
Total	721.70	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	199.55	27.65%
	Vontobel Asset Management AG	212.83	29.49%
Hypotheken Schweiz	PROSPERITA	0.50	0.07%
Immobilien Schweiz	PROSPERITA	194.80	26.99%
Nicht kotierte Anlagen Schweiz	Renaissance	8.06	1.12%
Infrastruktur	Allianz Global Investors, Partners Group	14.38	1.99%
Microfinance	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	17.56	2.43%
Insurance linked Securities	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	17.72	2.46%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq	46.65	6.46%
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	PROSPERITA	0.29	0.04%
Cash (Zahlungsverkehr)	PROSPERITA	9.36	1.30%
Total		721.70	100.00%

Performance

	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023 YTD	Q4 2023	7 Jahre p.a.
Nettoperformance	7.64%	-4.08%	12.44%	6.04%	10.09%	-9.21%	5.19%	2.45%	3.74%

Anmerkungen:

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