

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

31. Dezember 2020

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	11.53	2.22%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	41.53	8.01%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	57.25	11.04%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	23.54	4.54%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	17.18	3.31%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	69.63	13.43%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	67.20	12.96%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	20.72	4.00%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	157.55	30.39%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	78.32	15.11%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	41.94	8.09%				
Total Immobilien Schweiz	120.26	23.19%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	25.87	4.99%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	146.13	28.18%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	29.18	5.63%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	34.59	6.67%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	63.77	12.30%	11.5%	0%	15%	15%
Total	518.48	100.00%	100.0%			

Anmerkungen:

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

Übrige Alternative Anlagen: Mikrofinanz, Insurance Linked Securities, Senior Secured Loans

Organisation der Vermögensverwaltung

Anlagesegmente	verwaltet durch	CHF Mio.	%
Obligationen, Aktien, Immobilien Welt	Zürcher Kantonalbank	160.86	31.03%
	Vontobel Asset Management AG	168.36	32.47%
Immobilien Schweiz	Prosperita	120.26	23.19%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	29.18	5.63%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	34.59	6.67%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	5.23	1.01%
		518.48	100.00%

Performance

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020 YTD	VI. Qu. 2020	7 J. p.a.
Nettoperformance	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	6.04%	5.30%	4.88%

Anmerkungen:

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

Am Jahresende vorgenommene Anpassungen (Auf- bzw. Abwertungen des Immobilienbestandes, Ersatz der budgetierten durch die tatsächlich erzielten Netto-Mieterträge) sind nicht berücksichtigt.