

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

30. September 2019

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	2.29	0.54%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	36.34	8.59%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	48.35	11.43%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	22.68	5.36%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	14.13	3.34%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	58.76	13.89%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	63.30	14.97%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	14.12	3.34%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	136.18	32.20%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.05	8.76%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	56.32	13.32%				
Total Immobilien Schweiz	93.37	22.08%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	22.21	5.25%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	115.58	27.33%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	18.10	4.28%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	29.31	6.93%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	47.41	11.21%	11.5%	0%	15%	15%
Total	422.96	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.	%
Wertschriftenanlagen, ohne Immobilien Schweiz	Zürcher Kantonalbank	138.18	32.67%
	Vontobel Asset Management AG	142.66	33.73%
Immobilien Schweiz	Prosperita	93.37	22.08%
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	18.10	4.28%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	29.31	6.93%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	1.34	0.32%
		422.96	100.00%

Performance

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019 YTD	III. Qu. 2019	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	9.70%	1.67%	4.66%

Anmerkungen:

Die Angaben zur Performance entsprechen den von der Depotbank ausgewiesenen Zahlen, nach Abzug der Kosten für die Vermögensverwaltung.

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