

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

30. Juni 2019

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	18.98	4.55%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	37.29	8.95%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	52.80	12.67%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	17.23	4.13%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	13.78	3.31%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	57.06	13.69%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	57.47	13.79%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	14.82	3.56%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	129.35	31.03%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.05	8.89%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	45.44	10.90%				
Total Immobilien Schweiz	82.49	19.79%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	18.85	4.52%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	101.34	24.31%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	16.82	4.04%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	29.20	7.01%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	46.02	11.04%	11.5%	0%	15%	15%
Total	416.79	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	135.30	32.46%
	Vontobel Asset Management AG	140.65	33.75%
Immobilien Schweiz	Prosperita	82.49	19.79%
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	16.82	4.04%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	29.20	7.01%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	12.33	2.96%
		416.79	100.00%

Performance

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	II. Qu. 2019	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	7.90%	2.01%	4.83%

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.