

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. März 2019

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	17.22	4.25%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	38.33	9.46%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	52.74	13.02%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	16.74	4.13%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	14.26	3.52%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	52.43	12.95%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	52.09	12.86%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	16.76	4.14%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	121.28	29.94%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.05	9.15%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	44.54	11.00%				
Total Immobilien Schweiz	81.59	20.14%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	19.01	4.69%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	100.60	24.84%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	14.64	3.61%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	29.21	7.21%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	43.85	10.83%	11.5%	0%	15%	15%
Total	405.02	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	132.67	32.76%
	Vontobel Asset Management AG	137.47	33.94%
Immobilien Schweiz	Prosperita	81.59	20.14%
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	14.64	3.61%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	29.21	7.21%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	9.44	2.33%
		405.02	100.00%

Performance

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	I. Qu. 2019	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	5.77%	5.77%	4.54%

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.