

## Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. März 2018

### Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	11.41	3.19%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	35.36	9.88%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	55.63	15.54%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	8.04	2.25%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	17.24	4.82%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	48.09	13.44%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	53.12	14.84%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	6.63	1.85%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	107.84	30.13%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	32.14	8.98%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	44.67	12.48%				
Total Immobilien Schweiz	72.41	21.46%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	14.15	3.95%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	90.96	25.41%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	6.31	1.76%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	25.14	7.02%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	31.45	8.79%	11.5%	0%	15%	15%
	357.93	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	122.00
	Vontobel Asset Management AG	125.63
Immobilien Schweiz	Prosperita	72.41
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	6.31
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita	25.14
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	6.44
		357.93

### Performance

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	I. Qu. 2018	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.99%	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-1.92%	-1.92%	4.02%

#### 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.