

## Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

30. Juni 2020

### Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	11.29	2.39%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	37.21	7.86%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	53.69	11.34%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	21.20	4.48%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	15.37	3.25%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	65.04	13.74%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	58.63	12.39%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	18.66	3.94%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	142.33	30.07%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	41.94	8.86%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	71.84	15.18%				
Total Immobilien Schweiz	113.78	24.04%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	23.02	4.86%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	136.80	28.90%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	23.57	4.98%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	31.84	6.73%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	55.41	11.71%	11.5%	0%	15%	15%
<b>Total</b>	<b>473.30</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.0%</b>			

#### 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	148.13	31.30%
	Vontobel Asset Management AG	152.78	32.28%
Immobilien Schweiz	Prosperita	113.78	24.04%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	23.57	4.98%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	31.84	6.73%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	3.20	0.68%
		<b>473.30</b>	100.00%

### Performance

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020 YTD	II. Qu. 2020	7 J. p.a.
Nettoperformance	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	<b>-0.02%</b>	<b>6.41%</b>	<b>4.31%</b>

#### 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.