

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

30. Juni 2018

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	7.89	2.17%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	37.13	10.22%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	53.96	14.86%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	8.31	2.29%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	16.47	4.53%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	50.54	13.91%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	54.87	15.11%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	7.10	1.95%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	112.51	30.97%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	32.14	8.85%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	42.34	11.66%				
Total Immobilien Schweiz	74.48	20.50%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	17.81	4.90%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	92.29	25.41%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	7.69	2.12%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	26.99	7.43%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	34.68	9.55%	11.5%	0%	15%	15%
	363.24	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 Vontobel Asset Management AG	124.74 128.31
Immobilien Schweiz	Prosperita	74.48
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	7.69
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita	26.99
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	1.03
		363.24

Performance

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	II. Qu. 2018	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.99%	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-1.69%	0.23%	4.27%

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.