

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

31. März 2020

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	9.52	2.18%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	33.23	7.62%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	51.12	11.73%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	20.46	4.69%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	14.70	3.37%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	58.97	13.53%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	52.34	12.01%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	16.50	3.79%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	127.81	29.32%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	41.94	9.62%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	63.67	14.61%				
Total Immobilien Schweiz	105.61	24.23%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	19.87	4.56%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	125.48	28.78%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	23.21	5.32%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	30.40	6.97%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	53.61	12.30%	11.5%	0%	15%	15%
Total	435.93	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.	%
Obligationen, Aktien, Immobilien Welt	Zürcher Kantonalbank	137.20	31.47%
	Vontobel Asset Management AG	137.13	31.46%
Immobilien Schweiz	Prosperita	105.61	24.23%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	23.21	5.32%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	30.40	6.97%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	2.38	0.55%
		435.93	100.00%

Performance

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020 YTD	I. Qu. 2020	7 J. p.a.
Nettoperformance	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	-7.85%	-7.85%	3.22%

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.