

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

30. September 2021

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	23.17	4.05%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	50.15	8.76%	10.0%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	59.68	10.42%	12.5%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	23.76	4.15%	2.5%	0%	5%	
Aktien Schweiz	92.71	16.19%	14.0%	9%	17%	
Aktien Ausland	93.25	16.29%	14.0%	9%	17%	
Aktien Emerging Markets	15.66	2.74%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	201.62	35.22%	31.0%	18%	39%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	102.99	17.99%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	42.44	7.41%				
Total Immobilien Schweiz	145.43	25.40%	28.0%	20%	30%	30%
Private Infrastructure, hedged in CHF	3.84	0.67%	3.0%	0%	4%	10%
Private Equity, hedged in CHF	40.32	7.04%	6.0%	4%	8%	
Insurance Linked Securities, hedged in CHF	16.60	2.90%	3.0%	0%	4%	
Microfinance, hedged in CHF	7.96	1.39%	3.0%	0%	4%	
Total Alternative Anlagen	68.72	12.00%	15.0%	4%	18%	15%
Total	572.53	100.00%	100.0%			

Anmerkungen:

Neue Anlagestrategie ab 1. April 2021

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	166.54	29.09%
	Vontobel Asset Management AG	178.77	31.22%
Immobilien Schweiz	Prosperita	145.43	25.40%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	40.32	7.04%
Private Infrastructure	Allianz Global Investors, Partners Group	3.84	0.67%
Insurance Linked Securities, Microfinance	Prosperita (Kollektivanlagen)	24.56	4.29%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	13.07	2.28%
		572.53	100.00%

Performance

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021 YTD	I. Qu. 2021	7 J. p.a.
Nettoperformance	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	6.04%	7.49%	0.03%	5.00%

Anmerkungen:

Die Angaben zur Performance entsprechen den von der Depotbank ausgewiesenen Zahlen.

Am Jahresende vorgenommene Anpassungen (Auf- bzw. Abwertungen des Immobilienbestandes, Ersatz der budgetierten durch die tatsächlich erzielten Netto-Mieterträge, ALM-Studien etc.) sind nicht berücksichtigt.