

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. Dezember 2021

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	19.38	3.24%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	51.48	8.60%	10.0%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	50.01	8.36%	12.5%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	27.44	4.59%	2.5%	0%	5%	
Hypotheken Schweiz	0.51	0.09%	0.0%	0%	2%	
Total Festverzinsliche Anlagen	148.83	24.88%	26.0%	12%	58%	
Aktien Schweiz	99.66	16.66%	14.0%	9%	17%	
Aktien Ausland	99.54	16.64%	14.0%	9%	17%	
Aktien Emerging Markets	15.76	2.63%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	214.95	35.93%	31.0%	18%	39%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	43.63	7.29%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	108.86	18.19%				
Total Immobilien Schweiz	152.49	25.49%	28.0%	20%	30%	30%
Infrastruktur, hedged in CHF	5.08	0.85%	3.0%	0%	5%	10%
Microfinance, hedged in CHF	16.50	2.76%	3.0%	0%	4%	
Insurance linked Securities (ILS), hedged in CHF	16.13	2.70%	3.0%	0%	4%	
Private Equity, hedged in CHF	44.09	7.37%	6.0%	4%	8%	
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	0.20	0.03%	0.0%	0%	2%	
Total Alternative Anlagen	76.92	12.86%	12.0%	4%	18%	15%
Total	598.28	100.00%	100.0%			

Anmerkungen:

Anlageklassen mit währungsgesicherter Benchmark sind jederzeit zu 85 - 100% gegenüber CHF abzusichern.

Organisation der Vermögensverwaltung

Anlagesegmente	verwaltet durch	CHF Mio.	%
Liquidität, Obligationen, Aktien	Zürcher Kantonalbank	171.34	28.64%
	Vontobel Asset Management AG	183.71	30.71%
Hypotheken Schweiz	PROSPERITA	0.51	0.09%
	PROSPERITA	152.49	25.49%
Infrastruktur	Allianz Global Investors, Partners Group	5.08	0.85%
Microfinance	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	16.50	2.76%
Insurance linked Securities	PROSPERITA (Kollektivanlagen)	16.13	2.70%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	44.09	7.37%
Darlehen/Hypotheken an Arbeitgeber	PROSPERITA	0.20	0.03%
Cash (Zahlungsverkehr)	PROSPERITA	8.23	1.38%
Total		598.28	100.00%

Performance

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021 YTD	Q4 2021	7 Jahre p.a.
Nettoperformance	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	6.04%	10.09%	2.43%	4.93%

Anmerkungen:

Die Angaben zur Performance entsprechen den von der Depotbank ausgewiesenen Zahlen. Am Jahresende vorgenommene Anpassungen (Ersatz der budgetierten durch die tatsächlich erzielten Netto-Mieterträge, ALM-Studien etc.) sind nicht berücksichtigt.