

## Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

31. März 2021

### Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	23.61	4.34%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	46.20	8.49%	10.0%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	52.29	9.61%	12.5%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	22.84	4.20%	2.5%	0%	5%	
Aktien Schweiz	84.91	15.61%	14.0%	9%	17%	
Aktien Ausland	92.08	16.92%	14.0%	9%	17%	
Aktien Emerging Markets	20.09	3.69%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	197.08	36.22%	31.0%	18%	39%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	89.24	16.40%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	41.94	7.71%				
Total Immobilien Schweiz	131.18	24.11%	28.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	4.32	0.79%		ab 1.4.2021 nicht mehr in Anlagestrat.		
Total Immobilien	135.50	24.90%	28.0%	22%	37%	30%
Private Equity, hedged in CHF	32.94	6.05%	6.0%	4%	8%	
Private Infrastructure, hedged in CHF	1.05	0.19%	3.0%	0%	4%	10%
Insurance Linked Securities, hedged in CHF	18.00	3.31%	3.0%	0%	4%	
Microfinance, hedged in CHF	7.91	1.45%	3.0%	0%	4%	
Senior Secured Loans, hedged in CHF	6.68	1.23%		ab 1.4.2021 nicht mehr in Anlagestrat.		
Total Alternative Anlagen	66.58	12.24%	15.0%	4%	18%	15%
<b>Total</b>	<b>544.10</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.0%</b>			

#### 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	163.48	30.05%
	Vontobel Asset Management AG	175.12	32.19%
Immobilien	Prosperita	135.50	24.90%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	32.94	6.05%
Private Infrastructure	Allianz Global Investors, Partners Group	1.05	
Ins. Linked Sec. Microfinance, Senior Loans	Prosperita (Kollektivanlagen)	32.59	5.99%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	3.42	0.63%
		<b>544.10</b>	99.81%

### 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%	3.05%	3.05%	5.03%

#### 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) sind nicht berücksichtigt.