

Factsheet Vermögensanlagen Pool 1

31. Dezember 2018

Stand der Vermögensanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	12.47	3.39%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	36.66	9.97%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	55.74	15.15%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	8.17	2.22%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	14.14	3.84%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	46.21	12.56%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	51.82	14.09%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	6.15	1.67%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	104.18	28.32%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.05	10.07%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	42.91	11.66%				
Total Immobilien Schweiz	79.96	21.74%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	17.14	4.66%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	97.10	26.40%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	13.66	3.71%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	25.74	7.00%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	39.40	10.71%	11.5%	0%	15%	15%
Total	367.86	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	118.72 122.61
Immobilien Schweiz	Prosperita	79.96
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	13.66
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	25.74
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	7.17
		367.86

Performance

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	IV. Qu. 2018	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.99%	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	-3.43%	4.19%

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.