

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

30. September 2018

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	8.08	2.16%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	37.78	10.12%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	55.39	14.84%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	8.36	2.24%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	15.60	4.18%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	50.15	13.43%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	54.36	14.56%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	6.43	1.72%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	110.94	29.71%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.29	9.99%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	43.09	11.54%				
Total Immobilien Schweiz	80.38	21.53%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	17.85	4.78%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	98.23	26.31%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	11.79	3.16%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	27.20	7.28%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	38.99	10.44%	11.5%	0%	15%	15%
	373.37	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	124.12 127.95
Immobilien Schweiz	Prosperita	80.38
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	11.79
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	27.20
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	1.93
		373.37

Performance

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	III. Qu. 2018	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.99%	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-0.63%	1.04%	5.11%

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.