

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

30. September 2020

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BV2 Max.
Liquidität	12.58	2.55%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	39.40	7.98%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	55.68	11.28%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	22.30	4.52%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	17.03	3.45%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	65.20	13.21%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	63.40	12.84%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	19.56	3.96%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	148.16	30.02%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	72.62	14.71%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	41.94	8.50%				
Total Immobilien Schweiz	114.56	23.21%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	23.10	4.68%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	137.66	27.89%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	26.60	5.39%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	34.17	6.92%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	60.77	12.31%	11.5%	0%	15%	15%
Total	493.58	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.	%
Obligationen, Aktien, Immobilien Welt	Zürcher Kantonalbank	152.49	30.89%
	Vontobel Asset Management AG	157.49	31.91%
Immobilien Schweiz	Prosperita	114.56	23.21%
Private Equity	Partners Group, Schroder Adveq, Renaissance	26.60	5.39%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	34.17	6.92%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	8.27	1.68%
		493.58	100.00%

Performance

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020 YTD	III. Qu. 2020	7 J. p.a.
Nettoperformance	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	0.70%	2.66%	4.41%

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.