

Factsheet Vermögenanlagen Pool 1

31. Dezember 2019

Stand der Vermögenanlagen nach Anlagekategorien

	CHF Mio.	%	Strategie	Min.	Max	BVV2 Max.
Liquidität	9.41	2.12%	1.0%	0%	10%	
Obligationen CHF	36.66	8.27%	10.5%	5%	25%	
Obligationen Fremdwährungen, hedged in CHF	49.29	11.12%	13.0%	7%	27%	
Obligationen Emerging Markets, hedged in CHF	23.31	5.26%	5.0%	0%	8%	
Wandelanleihen Welt, hedged in CHF	14.51	3.27%	3.0%	0%	5%	
Aktien Schweiz	60.34	13.62%	12.0%	7%	15%	
Aktien Ausland	62.50	14.11%	12.0%	7%	15%	
Aktien Emerging Markets	16.88	3.81%	3.0%	0%	5%	
Total Aktien	139.72	31.53%	27.0%	14%	35%	50%
Immobilien Schweiz, direkte Anlagen	37.05	8.36%				
Immobilien Schweiz, indirekte Anlagen	60.29	13.61%				
Total Immobilien Schweiz	97.34	21.97%	25.0%	20%	30%	30%
Immobilien Welt, hedged in CHF	22.47	5.07%	4.0%	2%	7%	10%
Total Immobilien	119.81	27.04%	29.0%	22%	37%	30%
Private Equity	21.00	4.74%	4.0%	0%	6%	
Übrige Alternative Anlagen	29.39	6.63%	7.5%	0%	9%	
Total Alternative Anlagen	50.39	11.37%	11.5%	0%	15%	15%
Total	443.10	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	142.01	32.05%
	Vontobel Asset Management AG	147.68	33.33%
Immobilien Schweiz	Prosperita	97.34	21.97%
Private Equity	Partners Group AG, Schroder Adveq	21.00	4.74%
Übrige Alternative Anlagen	Prosperita (Kollektivanlagen)	29.39	6.63%
Cash (Zahlungsverkehr)	Prosperita	5.68	1.28%
		443.10	100.00%

Performance

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019 YTD	III. Qu. 2019	7 J. p.a.
Nettoperformance	6.40%	9.59%	1.53%	1.89%	7.64%	-4.08%	12.44%	2.48%	4.93%

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.