

The Community Foundation of Herkimer & Oneida Counties, Inc.

Nazareth Pool

Investment Performance and Asset Allocation Summary - Period Ending February 29, 2020

Net of Fees

Name	Assets Market Value	% of Total Fund	Target	Annualized									
				Periods Ending - February 29, 2020									
				1 mon %	3 mon %	CYTD %	1 yr %	3 yr %	5 yr %	7 yr %	10 yr %	ITD %	
Total Managed Assets	11,466,454	100.0	100.0	-2.5	-0.8	-2.2	NA	NA	NA	NA	NA	NA	5.9
<i>60% MSCI ACW/40% Barclays Capital Aggregate CPI +5.0%</i>				<i>-4.1</i>	<i>-2.0</i>	<i>-4.0</i>	<i>7.3</i>	<i>6.4</i>	<i>5.0</i>	<i>6.0</i>	<i>6.7</i>	<i>6.6</i>	<i>6.6</i>
Aperio Group (5/31/19)	4,476,754	39.0	60.0	-7.7	-5.6	-8.8	NA	NA	NA	NA	NA	NA	6.5
<i>MSCI ACWI</i>				<i>-8.1</i>	<i>-5.9</i>	<i>-9.1</i>	<i>3.9</i>	<i>7.0</i>	<i>5.5</i>	<i>7.6</i>	<i>8.1</i>	<i>5.5</i>	<i>5.5</i>
Garcia Hamilton (5/31/19)	4,732,106	41.3	40.0	1.4	3.0	3.2	NA	NA	NA	NA	NA	NA	6.5
<i>Barclays Capital Aggregate</i>				<i>1.8</i>	<i>3.7</i>	<i>3.8</i>	<i>11.7</i>	<i>5.0</i>	<i>3.6</i>	<i>3.3</i>	<i>3.9</i>	<i>7.6</i>	<i>7.6</i>
Vanguard ST Treasury Index (6/30/19)	2,007,594	17.5		0.9	1.6	1.5	NA	NA	NA	NA	NA	NA	2.6
<i>Barclays 1-3 Yr Govt</i>				<i>0.9</i>	<i>1.7</i>	<i>1.4</i>	<i>4.7</i>	<i>2.3</i>	<i>1.6</i>	<i>1.4</i>	<i>1.3</i>	<i>0.5</i>	<i>0.5</i>
Cash	250,000	2.2		0.0	0.0	0.0	NA	NA	NA	NA	NA	NA	0.0
<i>US T-Bills</i>				<i>0.2</i>	<i>0.5</i>	<i>0.3</i>	<i>2.3</i>	<i>1.7</i>	<i>1.2</i>	<i>0.8</i>	<i>0.6</i>	<i>1.6</i>	<i>1.6</i>