

The Community Foundation of Herkimer & Oneida Counties, Inc.

Nazareth Pool

Investment Performance and Asset Allocation Summary - Period Ending January 31, 2020

Net of Fees

Name	Assets Market Value	% of Total Fund	Target	Annualized									
				Periods Ending - January 31, 2020									
				1 mon %	3 mon %	CYTD %	1 yr %	3 yr %	5 yr %	7 yr %	10 yr %	ITD %	
Total Managed Assets	11,758,622	100.0	100.0	0.3	2.7	0.3	NA	NA	NA	NA	NA	8.6	
<i>60% MSCI ACW/40% Barclays Capital Aggregate CPI +5.0%</i>				<i>0.1</i>	<i>3.7</i>	<i>0.1</i>	<i>13.7</i>	<i>8.6</i>	<i>6.5</i>	<i>6.7</i>	<i>7.2</i>	<i>11.2</i>	
				<i>0.5</i>	<i>1.8</i>	<i>0.5</i>	<i>7.6</i>	<i>7.2</i>	<i>7.2</i>	<i>6.8</i>	<i>6.9</i>	<i>4.7</i>	
Aperio Group (5/31/19)	4,850,302	41.2	60.0	-1.2	4.9	-1.2	NA	NA	NA	NA	NA	15.3	
<i>MSCI ACWI</i>				<i>-1.1</i>	<i>4.9</i>	<i>-1.1</i>	<i>16.0</i>	<i>11.0</i>	<i>8.5</i>	<i>8.9</i>	<i>9.1</i>	<i>14.8</i>	
Garcia Hamilton (5/31/19)	4,668,532	39.7	40.0	1.9	1.6	1.9	NA	NA	NA	NA	NA	5.0	
<i>Barclays Capital Aggregate</i>				<i>1.9</i>	<i>1.8</i>	<i>1.9</i>	<i>9.6</i>	<i>4.6</i>	<i>3.0</i>	<i>3.1</i>	<i>3.8</i>	<i>5.7</i>	
Vanguard ST Treasury Index (6/30/19)	1,989,787	16.9		0.6	0.7	0.6	NA	NA	NA	NA	NA	1.7	
<i>Barclays 1-3 Yr Govt</i>				<i>0.5</i>	<i>0.7</i>	<i>0.5</i>	<i>3.9</i>	<i>2.0</i>	<i>1.4</i>	<i>1.3</i>	<i>1.3</i>	<i>0.5</i>	
Cash	250,000	2.1		0.0	0.0	0.0	NA	NA	NA	NA	NA	0.0	
<i>US T-Bills</i>				<i>0.1</i>	<i>0.4</i>	<i>0.1</i>	<i>2.3</i>	<i>1.7</i>	<i>1.1</i>	<i>0.8</i>	<i>0.6</i>	<i>1.4</i>	