

Swiss Philanthropy Performance Index

StiftungSchweiz und Zürcher Kantonalbank | Dezember 2021

Der Philanthropie-Index sank im November leicht um 0,20 %

Nach der positiven Entwicklung im Vormonat musste der Durchschnitt der Portfolios gemeinnütziger Organisationen, die unserem Index zugrunde liegen, im November eine negative Performance von $-0,20\%$ hinnehmen. Dies führte zu einem leichten Rückgang der kumulierten Indexperformance für das laufende Jahr auf $+7,30\%$.

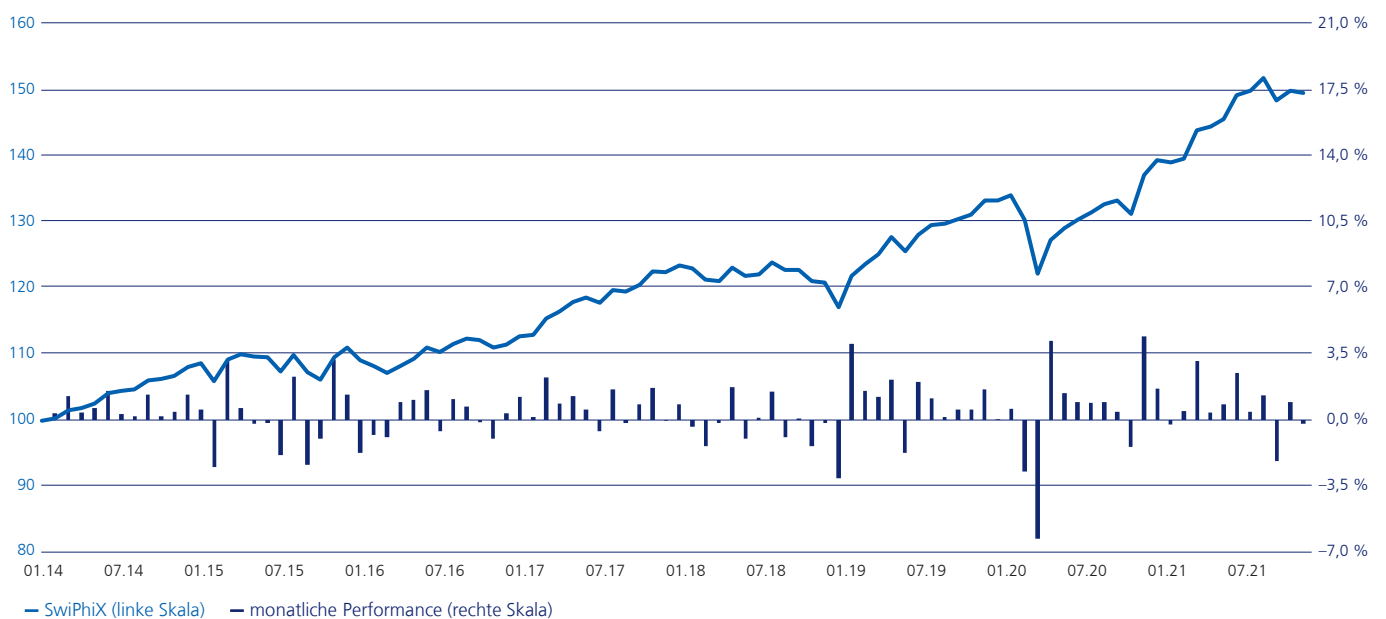
Omikron-Variante belastet ausländische Aktienmärkte

Das Aufkommen der Omikron-Variante des Coronavirus hat den Akteuren an den Finanzmärkten vor Augen geführt, dass die Pandemie möglicherweise länger als erhofft anhalten könnte. Dieser Unsicherheitsfaktor belastete die ausländischen Aktienmärkte, während sich der Schweizer Aktienmarkt dank seinem eher defensiven Branchenmix gut hielt.

Performance	SwiPhiX	Minimum	Maximum
November 2021	$-0,2\%$	$-1,6\%$	$0,6\%$
Seit Jahresanfang	$7,3\%$	$2,5\%$	$16,3\%$
Letzte 12 Monate	$9,1\%$	$3,3\%$	$19,0\%$
Letzte 3 Jahre	$23,7\%$	$11,7\%$	$40,6\%$
Letzte 5 Jahre	$34,2\%$	$16,4\%$	$61,0\%$

Streuung der Performancezahlen

Die Entwicklung der einzelnen Mandate verläuft aufgrund der voneinander abweichenden Strategien naturgemäss sehr unterschiedlich. Zur Illustration des Streubereichs zeigen die Tabellen die jeweilige minimale und maximale Performance aus der Gesamtheit aller erfassten Mandate über verschiedene Zeiträume.



Datenquelle und Berechnung: Swisssanto Invest by Zürcher Kantonalbank

Datenquelle

Als Datenquelle dienen Mandate, welche von Swisscanto Invest by Zürcher Kantonalbank, dem Asset Management der Zürcher Kantonalbank, verwaltet werden. Für die Berechnung werden nur Mandate ausgewählt, bei denen davon ausgegangen werden kann, dass die umgesetzte Strategie für die Anlagestrategie der gemeinnützigen Organisation repräsentativ ist. Momentan werden 64 verschiedene Mandate mit einer mittleren Grösse von rund CHF 51 Millionen und einem Gesamtvolumen von rund CHF 3,3 Milliarden berücksichtigt.

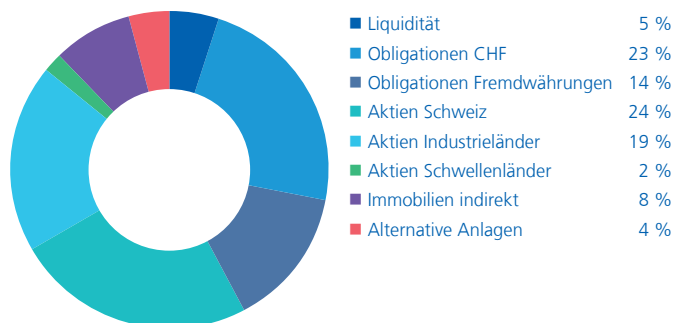
Berechnung

Für die Berechnung der durchschnittlichen Performance werden alle Mandate gleich gewichtet. Der aktuelle Indexwert berechnet sich als Indexwert des Vormonats, zuzüglich der durchschnittlichen Performance im aktuellen Monat. Bei sämtlichen Performancewerten handelt es sich um die Bruttoperformance, das heisst, die (individuellen) Kosten für die Vermögensverwaltung sind nicht berücksichtigt.

Asset-Allokation

Die Performance eines Portfolios hängt von der Entwicklung in den einzelnen Anlagekategorien ab. Die nachstehende Grafik zeigt die aktuelle mittlere Allokation über die verschiedenen Anlagekategorien.

Durchschnittliche Asset-Allokation im Berichtsmonat



Historische Performance	SwiPhiX	Minimum	Maximum
2020	4,6 %	-2,1 %	8,4 %
2019	13,8 %	8,1 %	28,0 %
2018	-5,2 %	-11,7 %	-2,3 %
2017	9,5 %	3,1 %	18,9 %
2016	3,4 %	1,2 %	6,6 %
2015	0,4 %	-1,6 %	2,7 %
2014	8,8 %	2,0 %	12,2 %

Datenquelle und Berechnung: Swisscanto Invest by Zürcher Kantonalbank



Kontakt

Dr. Hansjörg Schmidt
Key Clients Stiftungen
Zürcher Kantonalbank
Direktwahl 044 292 47 13
hansjoerg.schmidt@zkb.ch

Rechtliche Hinweise:

Dieses Dokument dient Werbezwecken und richtet sich nicht an Personen mit Sitz oder Wohnsitz im Ausland. Es wurde von der Zürcher Kantonalbank mit geschäftsüblicher Sorgfalt erstellt. Die Zürcher Kantonalbank bietet jedoch keine Gewähr für die Richtigkeit und Vollständigkeit der darin enthaltenen Informationen und lehnt jede Haftung für Verluste ab, die sich aus deren Verwendung ergeben. Der Swiss Philanthropy Performance Index ist keine Grundlage von Produkten. Indexanpassungen, welche die Zusammensetzung oder die Gewichtung betreffen, werden in geeigneter Weise mitgeteilt. Die Zürcher Kantonalbank behält sich das Recht vor, die Indexberechnung ohne Angabe von Gründen einzustellen. Wertentwicklungen und Renditen der Vergangenheit sind keine Garantie für den zukünftigen Anlageerfolg. Dieses Dokument ist weder ein Angebot zum Abschluss eines Vertrags noch eine Einladung zur Offertstellung für Produkte und Dienstleistungen. Es stellt kein Angebot und keine Empfehlung für den Erwerb, das Halten oder den Verkauf von Finanzinstrumenten dar. © 2021 Zürcher Kantonalbank