

Swiss Philanthropy Performance Index

StiftungSchweiz und Zürcher Kantonalbank | Dezember 2019

Neuer Referenzindex für die Anlagen-Performance gemeinnütziger Organisationen

Die Kooperationspartner StiftungSchweiz und Zürcher Kantonalbank lancieren erstmals einen Referenzindex für die Performance der Anlagen von gemeinnützigen Organisationen. Der Swiss Philanthropy Performance Index (SwiPhiX) illustriert eine mittlere Performance der von Swisscanto Invest by Zürcher Kantonalbank verwalteten Mandate gemeinnütziger Organisationen.

Durchschnittliche Performance im laufenden Jahr liegt bei fast 14%

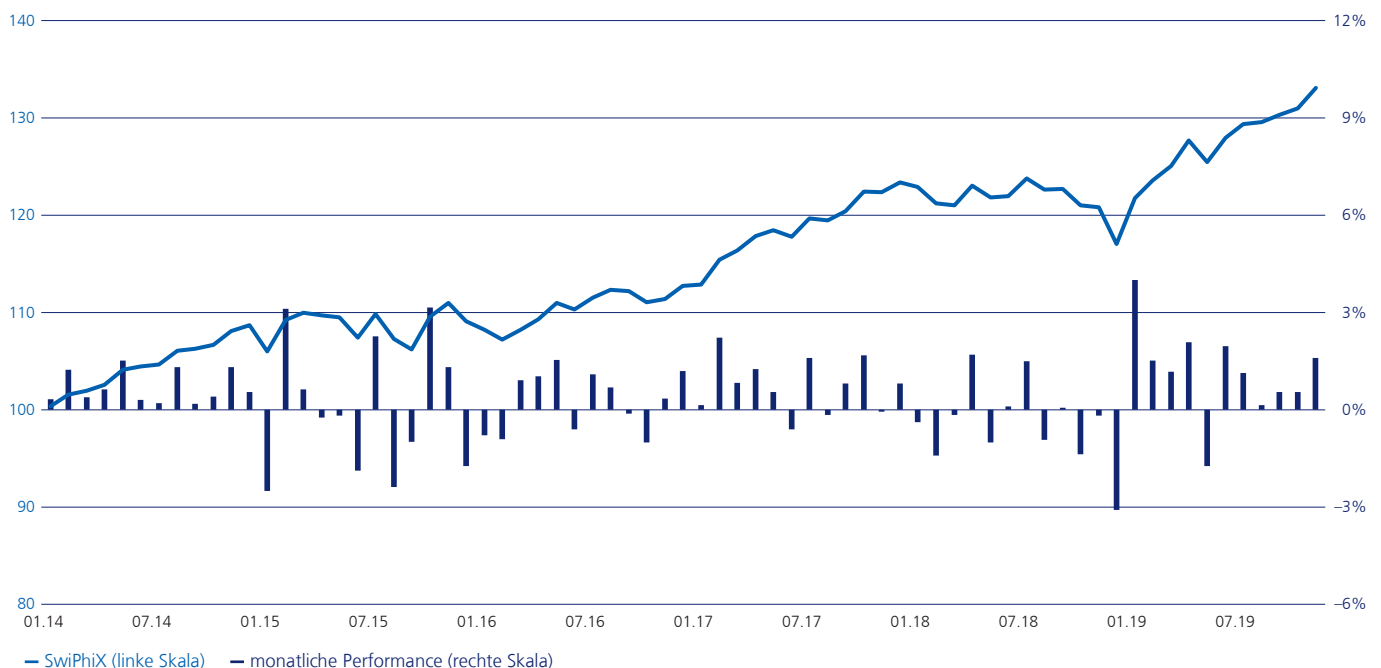
Im laufenden Jahr lieferten die Anlagen der gemeinnützigen Organisationen bisher (1. Januar bis 30. November 2019) eine sehr bemerkenswerte mittlere Performance von 13,8%. Die Performance im November 2019 trug mit 1,6% sehr deutlich dazu bei. Jene Mandate, die bereits seit mindestens fünf Jahren bestehen, erreichten

eine mittlere Gesamtpformance von 23,5%, wobei die einzelnen Mandate über einen Bereich von +14% bis +28,5% gestreut sind.

Performance	SwiPhiX	Minimum	Maximum
November 2019	1,61%	0,75%	2,87%
Year-to-date	13,77%	8,00%	26,90%
letzte 12 Monate	10,24%	6,83%	17,64%
letzte 3 Jahre	19,59%	9,89%	36,85%
letzte 5 Jahre	23,28%	13,95%	28,54%

Streuung der Performancezahlen

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



Datenquelle und Berechnung: Swisscanto 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 solche Mandate ausgewählt, bei denen davon ausgegangen werden kann, dass die umgesetzte Strategie für die Anlagestrategie der gemeinnützigen Organisation repräsentativ ist. Momentan werden 56 verschiedene Mandate mit einer mittleren Grösse von ca. CHF 32 Mio. und einem Gesamtvolumen von ca. CHF 1,8 Mrd. berücksichtigt.

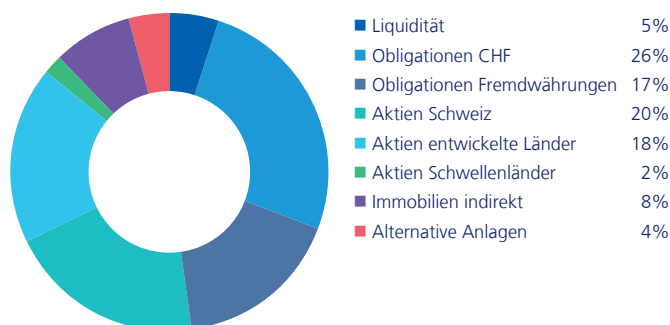
Berechnung

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

Asset-Allokation

Die Performance eines Portfolios hängt von den Entwicklungen 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
2018	-5,16%	-11,7%	-2,3%
2017	9,52%	3,1%	18,9%
2016	3,38%	1,2%	6,6%
2015	0,35%	-1,6%	2,7%
2014	8,76%	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 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 Vertrages 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. © 2019 Zürcher Kantonalbank