



Schweizerischer Pensionskassenverband
Association suisse des Institutions de prévoyance
Associazione svizzera delle Istituzioni di previdenza
Kreuzstrasse 26
8008 Zürich

Telefon 043 243 74 15/16
Telefax 043 243 74 17
E-Mail info@asip.ch
Website www.asip.ch

Zürich, November 2009

Fachmitteilung Nr. 78

ASIP Performancevergleich: Praxisorientiertes Führungsinstrument

Im Rahmen der Vermögensbewirtschaftung sind die Performance-Messung und das Performance-Controlling unabdingbar. Der ASIP Performancevergleich ist dafür ein nützliches Führungsinstrument. Er ermöglicht eine Interpretation der Gesamtrendite und unterstützt eine objektive Beurteilung der Leistung der Vermögensverwalter. Rendite und Risiko* werden auf Stufe Gesamtportfolio, Anlagekategorie und Anlageprodukt mit anderen Vorsorgeeinrichtungen (VE) verglichen und dargestellt.

Die VE erhalten eine halbjährliche, fundierte, unabhängige und sehr detaillierte individuelle Darstellung der Performance der VE, welche die Position der einzelnen VE im Verhältnis zum Gesamtmarkt festhält. Der Performancevergleich gibt dem Führungsorgan und der Geschäftsführung Aufschluss über die erzielte Performance und die eingegangenen Risiken im Vergleich mit andern VE. Der durch Watson Wyatt erstellte Performancevergleich dient als Orientierungshilfe für eine erfolgversprechende Anlagepolitik. Zudem versetzt er die Führungsorgane in die Lage, aufgrund gesicherter professioneller und unabhängiger Erkenntnisse die Interessen der Versicherten optimal wahrzunehmen. Die Teilnehmer erhalten eine Interpretation und Analyse der Resultate.

Wir sind der Auffassung, dass den verantwortlichen Führungsorganen ein Instrument angeboten wird, welches im Interesse der langfristigen Vorsorgesicherheit genutzt werden sollte. Den Beilagen können die Details des ASIP Performancevergleiches entnommen werden.

ASIP

Hanspeter Konrad

***(vgl. Fachmitteilung Nr. 79: ASIP Leitfaden für die Vermögensanlage von Vorsorgeeinrichtungen; www.asip.ch)**

Beilagen (zu finden auf unserer Homepage unter der Rubrik Themen):

- Performancevergleich
- Musterbericht