



**Investment & Actuarial Consulting,
Controlling and Research.**



www.ppcmetrics.ch



Marktscreen

Gemischte Mandate, aktiv

Anzahl Anbieter

40

Verwaltetes Vermögen in der Anlagekategorie

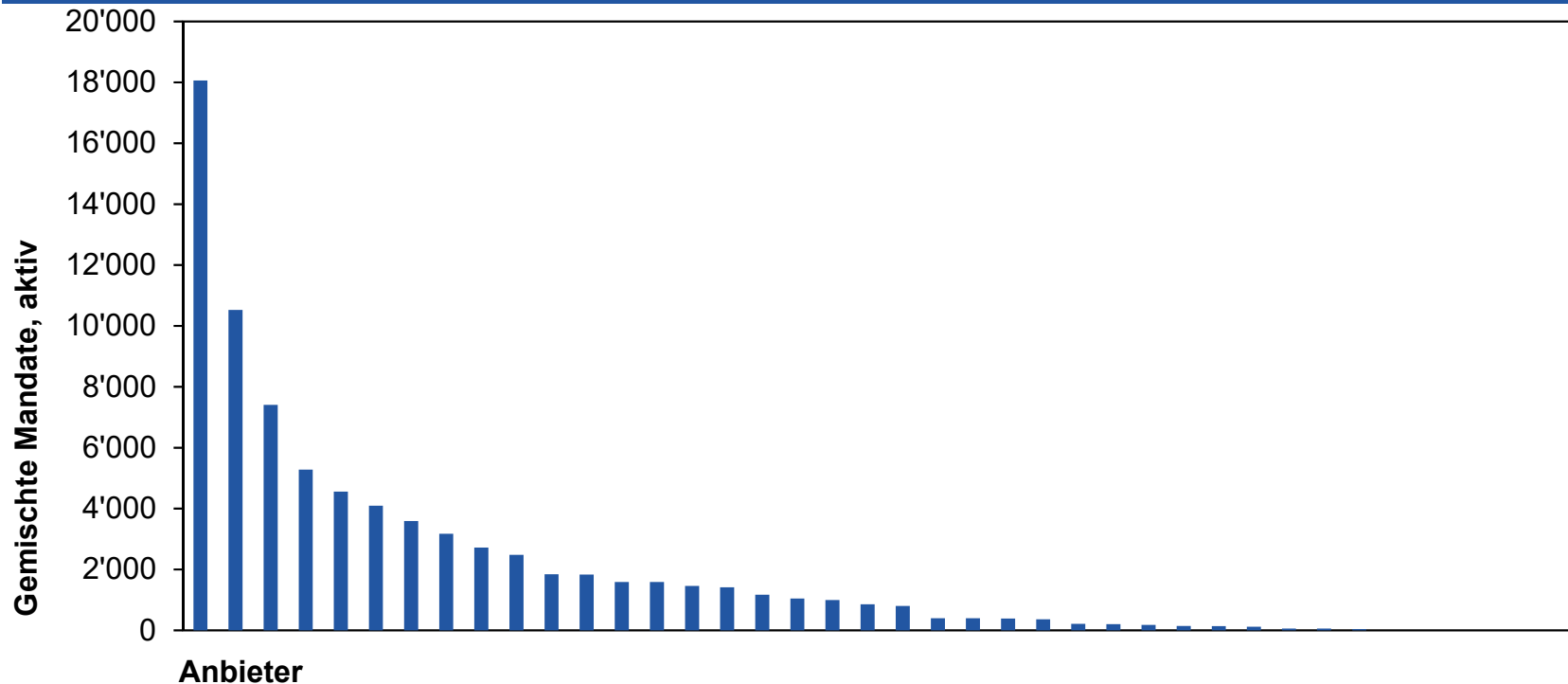
CHF 610 Mrd.

Verwaltetes Vermögen für Schweizer Pensionskassen

CHF 350 Mrd.

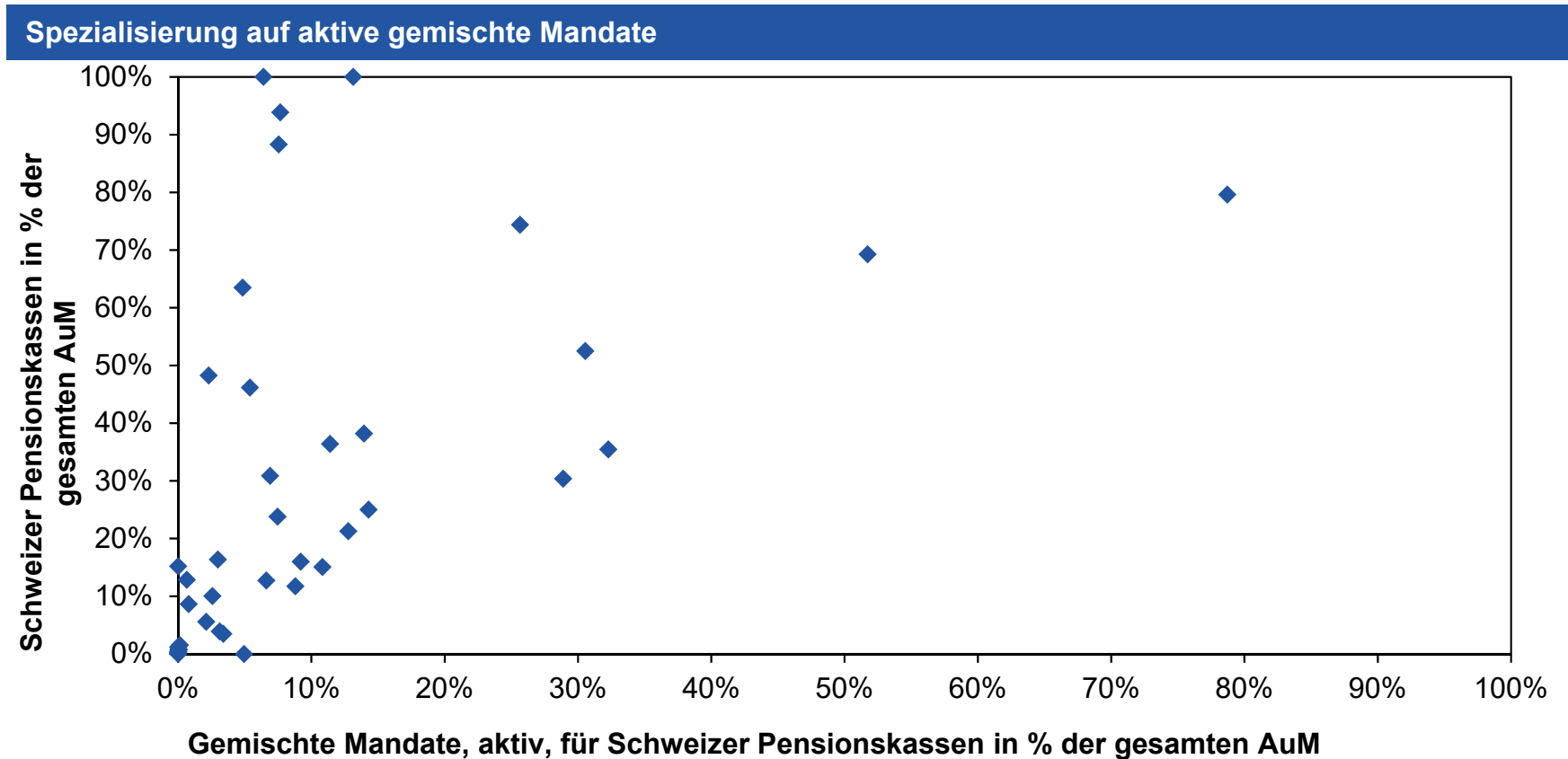
Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (1)

Verwaltetes Vermögen für Schweizer Pensionskassen in CHF Mio.



Die hier abgebildeten Vermögensverwalter verwalten aktive gemischte Mandate im Umfang von insgesamt CHF 79 Mrd. für Schweizer Pensionskassen. Der Durchschnitt (Median) liegt bei rund CHF 830 Mio. Die zehn grössten Asset Manager verwalten insgesamt CHF 62 Mrd. und machen somit über 78% der verwalteten Vermögen in aktiven gemischten Mandaten aus, die von den hier abgebildeten Asset Managern insgesamt verwaltet werden.

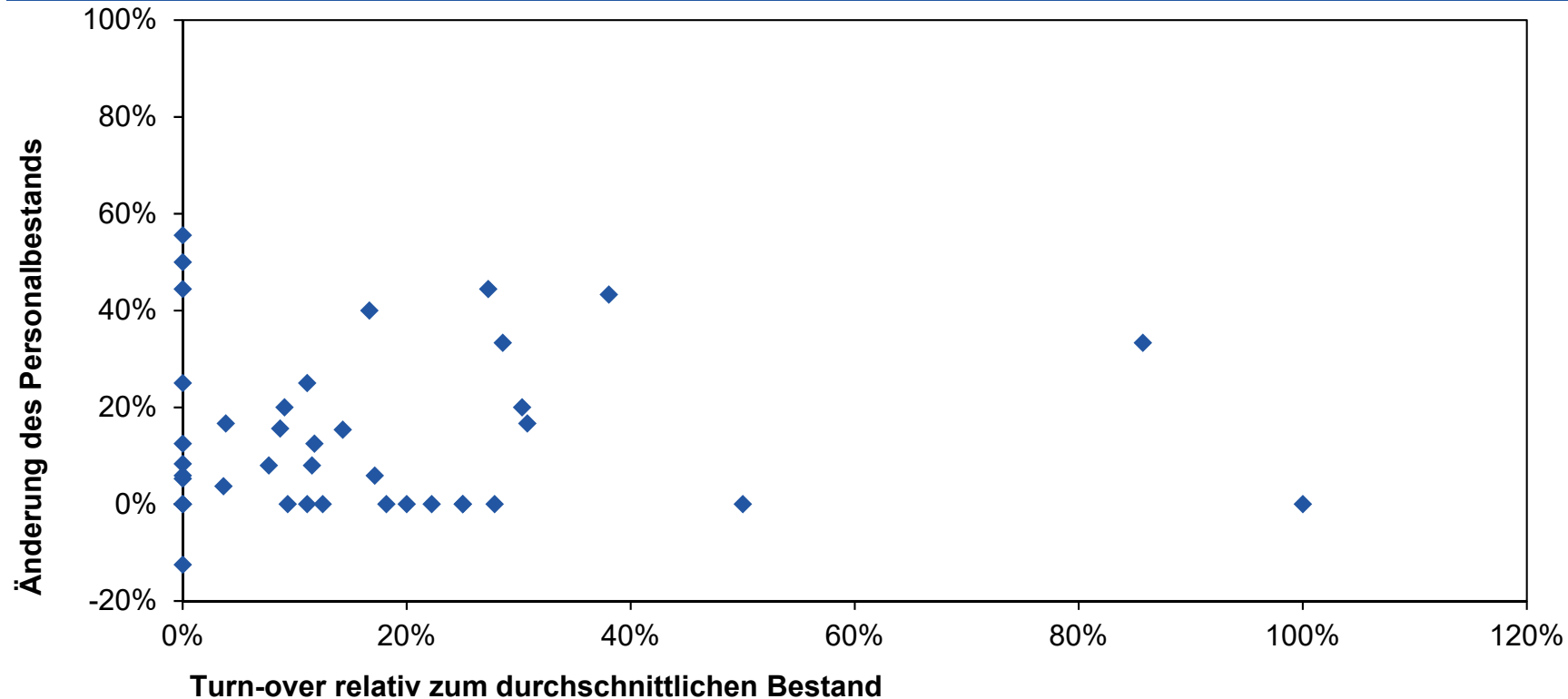
Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (2)



Der Anteil von aktiven gemischten Mandaten für Schweizer Pensionskassen am gesamthaft verwalteten Vermögen des Asset Managers variiert zwischen 0% und 100% und liegt im Median bei 16.2%. Somit ist die Spezialisierung der abgebildeten Vermögensverwalter auf aktive gemischte Mandate für Schweizer Pensionskassen relativ gering.

Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (3)

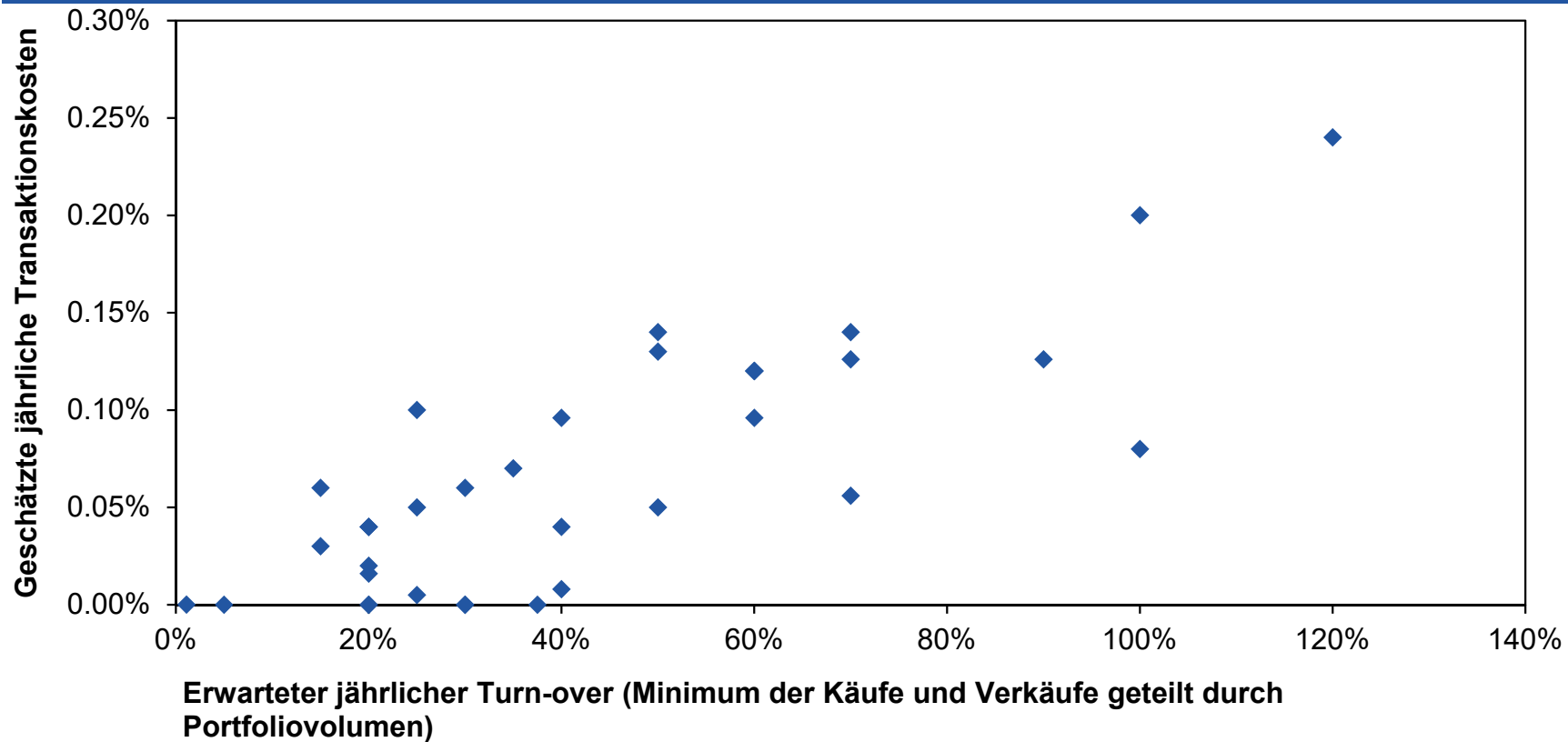
Wachstum und Stabilität des Produkt-Teams



Der Turn-over relativ zum durchschnittlichen Personalbestand ist ein Mass für die Stabilität des Produkt-Teams. Im Durchschnitt (Mittelwert) liegt der Turn-over über die vergangenen drei Jahre bei 16.9% (Median 11.3%), d.h. die Mehrheit der Teams kann als stabil bezeichnet werden. Die Teamgrösse ist durchschnittlich angewachsen. Die Änderung des Personalbestands beträgt im Mittelwert 14% (Median 8%) über die vergangenen drei Jahre, d.h. die Teamgrösse ist leicht gewachsen.

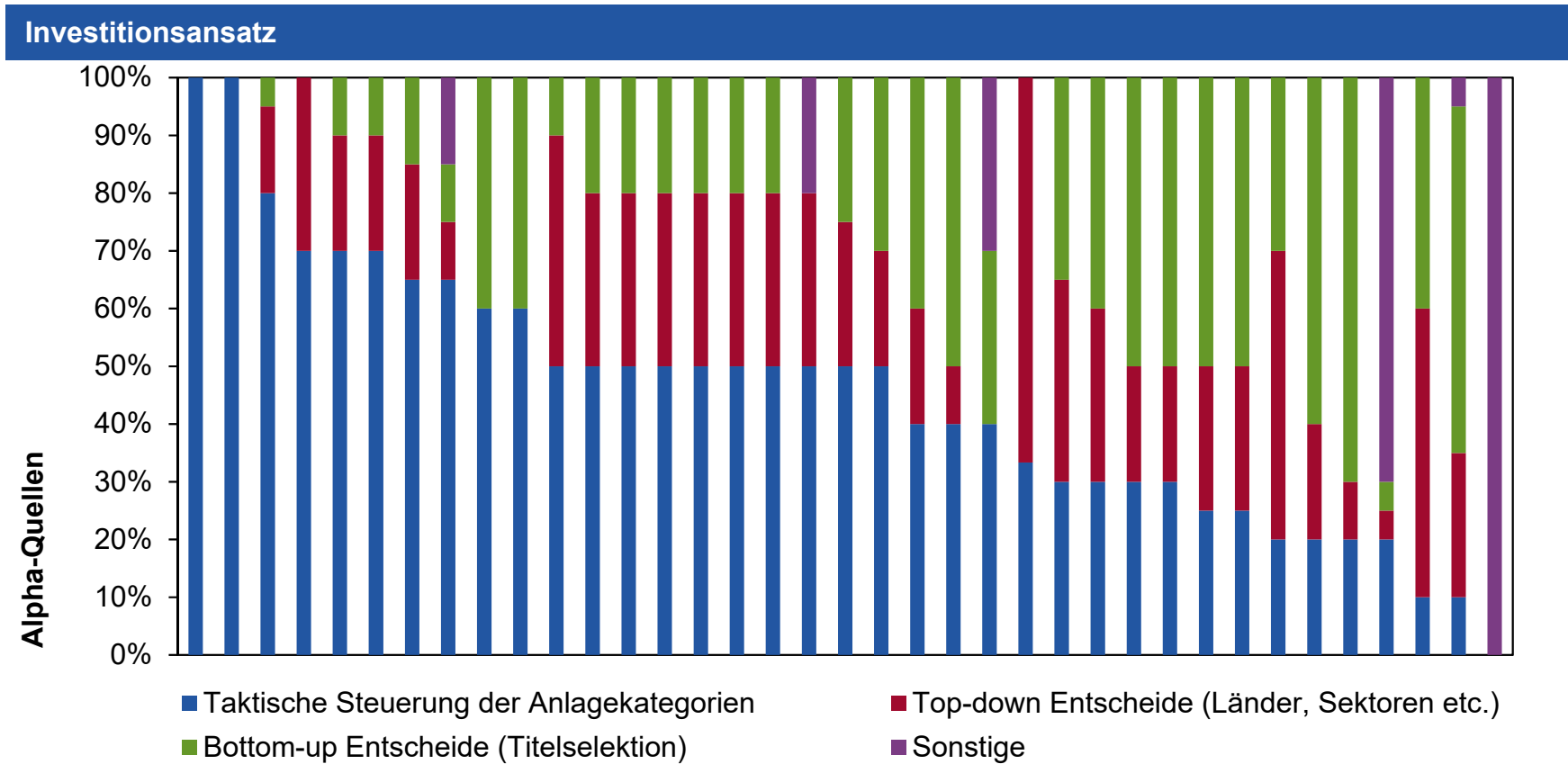
Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (4)

Turn-over und Transaktionskosten



Die jährlichen Transaktionskosten liegen im Mittel (Median) bei 0.06% bei einer Spannweite von 0.00% bis 0.24%. Der durchschnittliche Portfolio Turn-over (einseitig, Median) liegt bei 43%, im Maximum bei 120%.

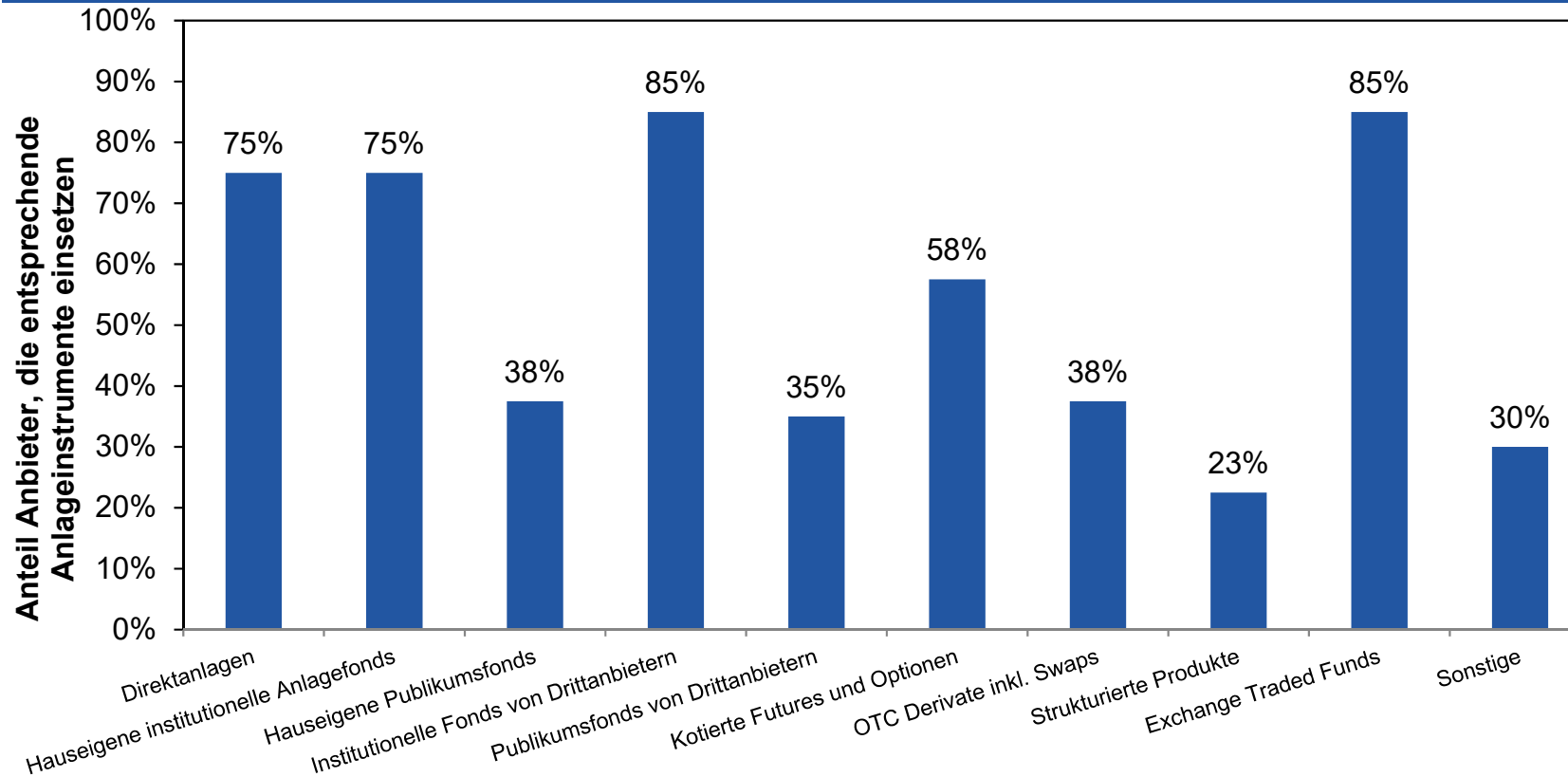
Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (5)



Die taktische Steuerung der Anlagekategorien stellt die wichtigste Alpha-Quelle dar. Im Mittel beträgt der Beitrag der taktischen Steuerung der Anlagekategorien 45%. Weitere Alpha-Quellen sind die Steuerung der Länder/Sektoren sowie die Titelselektion mit einem durchschnittlichen Renditebeitrag von 24% bzw. 28%.

Marktscreen gemischte Mandate, aktiv (6)

Eingesetzte Anlageinstrumente



Von über drei Viertel der Anbieter werden typischerweise Direktanlagen, hauseigene institutionelle Anlagefonds, institutionelle Fonds von Drittanbietern und Exchange Traded Funds eingesetzt. Eine untergeordnete Bedeutung spielen hauseigene Publikumsfonds, Publikumsfonds von Drittanbietern sowie strukturierte Produkte, die jeweils von ca. einem Drittel der Anbieter eingesetzt werden.

PPCmetrics Marktscreen

Verwaltetes Vermögen

Organisation und Human Resources

Produkt-Team

Investitionsansatz und Portfolio

Historische Anlageleistung

Gebühren

Um aktuelle Informationen von Vermögensverwaltern zu erhalten, führen wir regelmässig breite Marktscreens für eine spezifische Anlagekategorie resp. einen Mandats-typ durch.

Marktscreens dienen institutionellen Anlegern als transparentes Instrument, um anhand von über 100 qualitativen und quantitativen Filter- und Beurteilungskriterien eine Vorauswahl der für das Ausschreibungsverfahren geeigneten Kandidaten zu treffen.

Marktscreens ermöglichen zudem einen aktuellen, breiten Marktüberblick der Produktlandschaft für institutionelle Anleger.

Kontakt



Investment & Actuarial Consulting,
Controlling and Research

PPCmetrics AG

Badenerstrasse 6
Postfach
CH-8021 Zürich

Telefon +41 44 204 31 11
Telefax +41 44 204 31 10
E-Mail ppcmetrics@ppcmetrics.ch

PPCmetrics SA

23, route de St-Cergue
CH-1260 Nyon

Telefon +41 22 704 03 11
Telefax +41 22 704 03 10
E-Mail nyon@ppcmetrics.ch

Website www.ppcmeters.ch

Social Media 

PPCmetrics (www.ppcmeters.ch) ist ein führender Schweizer Investment Consultant, Investment Controller, strategischer Anlageberater und Pensionskassenexperte. Unsere Kunden sind institutionelle Investoren (beispielsweise vom Typ Pensionskasse, Vorsorgeeinrichtung, Personalvorsorgestiftung, Versorgungswerk, Versicherung, Krankenversicherung, Stiftung, NPO und Treasury-Abteilung) und Privatkunden (beispielsweise Privatanleger, Family Office, Familienstiftung oder UHNWI - Ultra High Net Worth Individuals). Unsere Dienstleistungen umfassen das Investment Consulting und die Anlageberatung sowie die Definition einer Anlagestrategie (Asset Liability Management - ALM), die Portfolioanalyse, die Asset Allocation, die Entwicklung eines Anlagereglements, die juristische Beratung (Legal Consulting), die Auswahl von Vermögensverwaltern (Asset Manager Selection), die Durchführung öffentlicher Ausschreibungen, das Investment Controlling, die aktuarielle und versicherungstechnische Beratung und die Tätigkeit als Pensionskassenexperte.

Jährlich publizieren wir mehr als 40 Fachartikel zu unterschiedlichen Fragestellungen.



Unsere Fachleute teilen ihr Wissen und ihre Meinungen mit der Öffentlichkeit.



Erleben Sie uns live an den diversen Tagungen, die wir mehrmals jährlich organisieren.



PPCmetrics AG
Investment & Actuarial Consulting,
Controlling and Research. **Mehr**

