

Medienmitteilung

Sicherheit - Zentrales Thema in der beruflichen Vorsorge

Der Swiss Liability Index SLIX schafft Klarheit auf der Verpflichtungsseite

Zürich, den 1. März 2007 – Änderungen am technischen Zinssatz und am Umwandlungssatz haben weitreichende Auswirkungen sowohl auf die Finanzierungskosten als auch auf die Renten der Versicherten. Zudem beeinflusst die Wahl des technischen Zinssatzes den von den Pensionskassen auszuweisenden Deckungsgrad (Art. 44 BVV) und die daraus abgeleitete Notwendigkeit Sanierungsmassnahmen zu ergreifen oder die Möglichkeit freie Mittel zu verteilen. Veränderungen dieser Parameter müssen deshalb wohl durchdacht und breit abgestützt sein. Im heutigen, sich schnell wandelnden Umfeld sind frühzeitige Szenarien von immer grösserer Bedeutung.

Für die Bewertung der Vermögenswerte stehen verschiedene Finanzinformationen zur Verfügung. Die führenden Beratungsunternehmen der beruflichen Vorsorge Hewitt Associates, LCP Libera AG und PPCmetrics AG entwickelten gemeinsam den „Swiss Liability Index SLIX“. Damit können nun auch die Verpflichtungen monatlich marktnah bewertet werden.

Der Swiss Liability Index dient als Hilfsmittel zur Bestimmung und monatlichen Fortschreibung des ökonomischen Deckungskapitals und ökonomischen Deckungsgrades einer Pensionskasse. Zudem kann er zur Darstellung der finanzökonomischen Risiken der Verpflichtungen einer Pensionskasse herangezogen werden.

Online-Kalkulator

Dem Index liegen die biometrischen Daten der versicherungstechnischen Grundlagen BVG 2005 (aufgestellt durch Hewitt und Libera) zugrunde. Ähnlich wie bei Obligationen erfolgt die Bewertung der Verpflichtungen mittels laufzeitabhängigen Marktzinsen. Die von PPCmetrics durchgeführten Indexberechnungen erlauben eine monatliche Fortschreibung der Deckungskapitalien der laufenden und darauf basierenden anwartschaftlichen Rentenzahlungen. Mit Hilfe eines Online-Kalkulators können sich Pensionskassen die entsprechenden Werte für Ihre eigene Situation jeden Monat neu errechnen.

Unter <http://www.slix-index.ch> finden Sie neben dem Online-Kalkulator unter anderem auch einen Kurzbeschrieb mit Rechnungsbeispiel und die komplette Dokumentation des Swiss Liability Index.

Über Hewitt Associates

Hewitt Associates ist mit mehr als 24'000 Mitarbeitern und 100 Büros in rund 35 Ländern vertreten und als Beratungs- und Outsourcing-Unternehmen im Bereich Human Resources (inkl. Pensionskassenberatung) weltweit führend. In der Schweiz beschäftigt Hewitt über 160 Mitarbeitende in den Büros Zürich, Neuchâtel und Nyon.

Über Libera

Die LCP Libera AG ist ein führendes von Banken, Lebensversicherungs-Gesellschaften und Wirtschaftsprüfungs-Unternehmen unabhängiges Beratungsunternehmen. Libera unterstützt seit mehr als 35 Jahren Unternehmen durch die umfassende Beratung in allen Pensionskassen- und Vorsorgefragen und entlastet sie durch die bedarfsgerechte Verwaltung von Vorsorgeeinrichtungen. Die Fachspezialisten der Libera sind höchsten Qualitätsansprüchen verpflichtet und lösen Vorsorgefragen kreativ, innovativ und mit grossem Engagement. Die Einbettung in die Gruppe Lane Clark & Peacock eröffnet den global tätigen Kunden den Zugang zu einem internationalen Netzwerk.

Über PPCmetrics

PPCmetrics ist ein führendes Beratungsunternehmen für institutionelle Anleger. Wir unterstützen seit über 15 Jahren institutionelle Investoren bei der Planung, Umsetzung und Überwachung ihrer Vermögensanlagen. Unsere Spezialisten beraten Sie unabhängig und kompetent im Asset & Liability Management, dem Festlegen der Anlagestrategie, bei der Anlageorganisation, der Auswahl von Portfoliomanagern und Depotbanken, dem Investment Controlling und der Weiterbildung von Stiftungsräten. Zu unseren Kunden zählen Pensionskassen unterschiedlicher Grösse aus allen Bereichen der Wirtschaft und der öffentlichen Hand.

Kontaktpersonen:

Alfred Bühler, Dr. oec. HSG, Partner PPCmetrics AG
Tel. 044 204 32 00, alfred.buehler@ppcmetrics.ch

Marco Jost, Dr. sc. math. ETH, eidg. dipl. Pensionsversicherungsexperte, LCP Libera AG
Tel. 043 817 73 00, marco.jost@libera.ch

Werner Koradi, eidg. dipl. Pensionsversicherungsexperte, Hewitt Associates
Tel. 044 298 12 11, werner.koradi@hewitt.com