

PRESSEMITTEILUNG

FMA-Bericht zum 3. Quartal 2011 der österreichischen Pensionskassen: Performance negativ, verwaltetes Vermögen leicht verringert

(Wien, 7. Dezember 2011)

Das von den österreichischen Pensionskassen verwaltete Vermögen beträgt zum 30. September 2011 € 14,5 Mrd. und hat sich damit um -2,3% verringert. Das im Rahmen der betrieblichen Kollektivversicherung von in Österreich zum Geschäftsbetrieb zugelassenen Versicherungsunternehmen verwaltete Vermögen erhöhte sich im Vergleich dazu um 2,1% auf € 490,6 Mio. Bei der Vermögensveranlagung erzielten alle Pensionskassen zusammen im 3. Quartal 2011 ein durchschnittliches Veranlagungsergebnis von -2,8%. Dies geht aus dem heute von der Finanzmarktaufsichtsbehörde FMA veröffentlichten Bericht über das 3. Quartal 2011 der österreichischen Pensionskassen hervor.

Zu Ende des 3. Quartals war das Aktieninvestment von 25,1% des verwalteten Vermögens zu rund einem Viertel mittels derivativer Instrumente abgesichert. Die Netto-Aktienquote (Aktienquote nach derivativen Absicherungsmaßnahmen) entsprach demnach 18,8% des veranlagten Vermögens. Ein geringerer effektiver Aktienanteil dämpfte heuer bisher tendenziell die Verluste aus der Vermögensveranlagung (der österreichische Aktienindex ATX verlor allein im 3. Quartal um -29,6%, der Eurostoxx 50 um -23,5% an Wert). Die Performance Year-to-Date zu Ende des 3. Quartals beträgt durchschnittlich -4,0%, für die Gruppe mit der geringsten Aktienquote (von durchschnittlich 7,4% des veranlagten Vermögens) beträgt sie -1,9%.

Das Vermögen der Pensionskassen wird zu 93,4% und damit fast zur Gänze indirekt über Investmentfonds gehalten. Die im PKG erlaubte Bewertungserleichterung von Forderungswertpapieren (Abweichung vom Marktwert durch Held-to-Maturity-Widmung) wird im Umfang von rd. 4,7% des Gesamtvermögens in Anspruch genommen. Der übrige Teil der Veranlagung wird zu den jeweils aktuellen Marktpreisen bewertet, wodurch sich Abwertungen etwa von Schuldverschreibungen bis zum 3. Quartal 2011 größtenteils bereits performancewirksam ausgewirkt haben.

Die größte Veränderung in der Zusammensetzung des Veranlagungsportfolios verzeichnet der Anteil der Aktien mit einer Reduktion von -5,3%-Punkten. Ebenfalls reduziert hat sich der Anteil an Unternehmensanleihen. Dahingegen ist der Anteil der Staatsanleihen und jener von Bankeinlagen mit 2,7%- bzw. 3,3%-Punkten stark gestiegen. Den größten Anteil am Portfolio haben damit weiterhin Staatsanleihen und Anleihen mit Haftung von Staaten oder Teilstaaten mit zusammen 36,3%. An zweiter Stelle stehen Aktien mit 25,1%. An dritter Stelle folgen Unternehmensanleihen mit 16,5%. Guthaben bei Banken haben einen Anteil von 11,0%.

Die Zahl der Anwartschafts- und Leistungsberechtigten (AWLB) bleibt gegenüber dem Vorquartal nahezu unverändert.

Den gesamten Quartalsbericht finden Sie auf der FMA-Website unter <http://www.fma.gv.at/de/statistik-berichtswesen/statistiken-unternehmen/pensionskassen.html>

Rückfragehinweis für Journalisten:

Klaus Grubelnik (FMA-Mediensprecher)

+43/(0)1/24959-5106

+43/(0)676/882 49 516