

Pensionskasse der C&A Gruppe

Bericht zur Umsetzung der Grundsätze einer nachhaltigen und verantwortungsbewussten Anlagepolitik

Im November 2019 hat der Stiftungsrat die Einführung von Grundsätzen einer nachhaltigen und verantwortungsbewussten Anlagepolitik beschlossen. Die Pensionskasse wird wenn immer möglich Produkte berücksichtigen, die die Grundsätze zum nachhaltigen und verantwortungsbewussten Investieren befolgen, sofern dies ohne Beeinträchtigung des Risiko-Rendite-Profiles und ohne erhebliche Mehrkosten möglich ist.

Der Anlageausschuss (AA) hat dem Stiftungsrat jährlich über die Fortschritte im Zusammenhang mit den Grundsätzen zu berichten. Der Stiftungsrat orientiert die Versicherten von Zeit zu Zeit über die Weiterentwicklung und Umsetzung der Grundsätze:

Seit der Einführung der Grundsätze hat der Anlageausschuss bei Umschichtungen im Portfolio, wenn immer vorhanden, die ESG Tranche der jeweiligen passiven Umsetzungen berücksichtigt.

Insbesondere waren dies:

Aktien WELT:

Credit Suisse Index Fund (CH) III Umbrella – CSIF (CH) III Equity World ex CH ESG Blue – Pension Fund

Marktwert am 31.12.2020 CHF 2.84 Millionen Anteil am Aktien Portfolio 2.45%

Der Fonds wird entsprechend einer indizierten Methode bewirtschaftet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation, einen geringen Tracking Error und eine kostengünstige Verwaltung aus. Anlageziele des Fonds sind eine möglichst genaue Replikation des Referenzindex und eine Minimierung der Performance-Abweichungen vom Benchmark. Der MSCI World ex Switzerland ESG Index ist nach Marktkapitalisierung gewichtet und bietet ein Engagement in Unternehmen mit hoher Performance bezüglich Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien (ESG-Kriterien) im Vergleich zu ihren Branchenmitbewerbern; er umfasst Large- und Mid-Cap-Unternehmen in Industrieländern weltweit. Der Fonds investiert nicht in Unternehmen, die in der Entwicklung und Produktion von nuklearen, biologischen und chemischen Kampfstoffen und Waffen, Antipersonenminen und Streubomben gemäss der Ausschlussliste des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK – ASIR) involviert sind.

Aktien EMERGING MARKETS:

Credit Suisse Index Fund (LUX) SICAV – CSIF (Lux) Equity Emerging Markets ESG blue DB CHF Capitalisation

Marktwert am 31.12.2020 CHF 11.51 Millionen Anteil am Aktien Portfolio 10.82%

Der Fonds wird mittels einem indexierten Ansatz verwaltet. Anlageziele des Fonds sind eine möglichst genaue Replikation des Referenzindex und eine Minimierung der Performance-Abweichungen vom Benchmark. Der MSCI Emerging Markets ESG Leaders Index ist ein Marktkapitalisierungsindex, der ein Engagement in Unternehmen mit hoher Performance bezüglich Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien (ESG-Kriterien) im Vergleich zu ihren Branchenmitbewerbern bietet; er umfasst Large- und Mid-Cap- Unternehmen in Schwellenländern weltweit. Der Fonds investiert nicht in Unternehmen, die in der Entwicklung und Produktion von nuklearen, biologischen und chemischen Kampfstoffen und Waffen, Antipersonenminen und Streubomben gemäss der Ausschlussliste des Schweizer Vereins für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK – ASIR) involviert sind.

Aus Kostengründen werden Umschichtungen zu ESG grundsätzlich nur im Rahmen von Portfolioanpassungen vorgenommen. Im November 2020 hat der AA jedoch die Umschichtung der verbliebenen Tranche Aktien Emerging Markets von CHF 5.3 Millionen trotz der Kosten (TCHF 32.5) beschlossen. Der AA ist der Auffassung, dass sich im Bereich Emerging Markets ein Engagement in ESG besonders Sinn macht.

Baar, 21.4.2021