



Stiftung Auffangeinrichtung BVG
Fondation institution supplétive LPP
Fondazione istituto collettore LPP

Unsere Verantwortung

ESG-Kriterien als Grundhaltung unseres Handelns und Investierens

Inhaltsverzeichnis

1	Einleitung	3
2	Unsere Verantwortung als Unternehmen	4
3	Unsere Verantwortung als Investorin	5
3.1	Abstimmung: Stimmrechte ausüben	6
3.2	Engagement: Dialog mit Unternehmen	7
3.3	Ausschluss: Unternehmen, die nicht berücksichtigt werden	8

Stiftung Auffangeinrichtung BVG

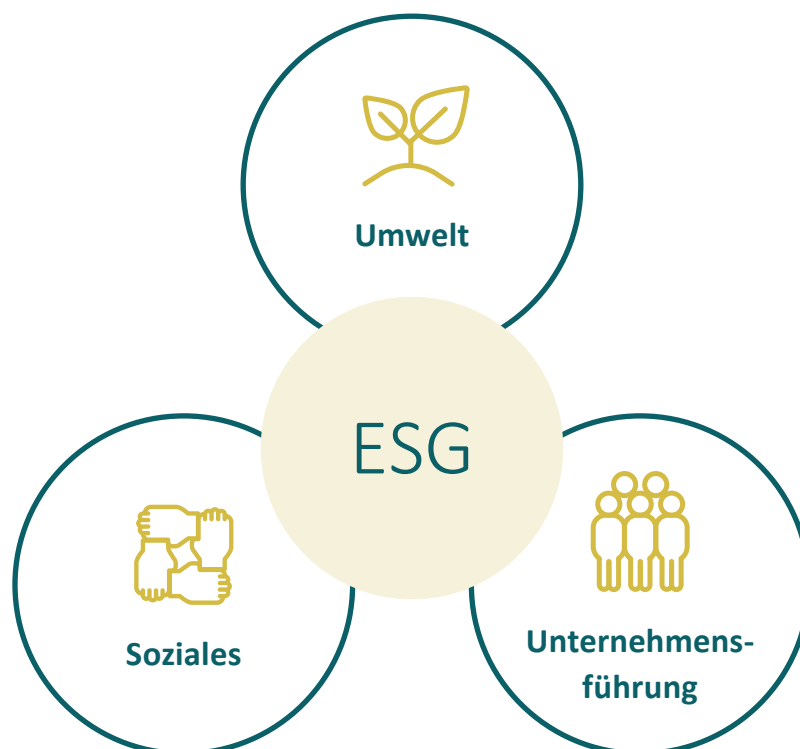
Die Stiftung Auffangeinrichtung BVG ist einzigartig: Im Auftrag des Bundes versichert die Non-Profit-Organisation als einzige Vorsorgeeinrichtung der Schweiz alle anschlusswilligen Arbeitgeber und Einzelpersonen in der obligatorischen beruflichen Vorsorge (BVG) und betreut im Bereich Freizügigkeitskonten über 1.3 Mio. Kunden. Die von den Arbeitnehmer- und Arbeitgeberverbänden getragene privatrechtliche Stiftung ist damit ein wichtiger Pfeiler in der zweiten Säule und unterstützt wesentlich die Stabilität des Systems.

1 Einleitung

Die Stiftung Auffangeinrichtung BVG nimmt ihre Verantwortung als Unternehmen und Investorin wahr. In ihrem Handeln sind Kriterien zu den Themen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG-Kriterien) berücksichtigt. Diese bilden die Grundlage für die Stiftung als Arbeitgeberin sowie für ein nachhaltiges und verantwortungsbewusstes Investieren.

Die Auffangeinrichtung ist eine soziale Arbeitgeberin: zertifizierte Lohngleichheit für alle (SQS Fair Compensation) und transparente Funktionslohnbander sind für uns selbstverständlich. Die modern eingerichteten Büros an den drei Standorten in Zürich-Oerlikon, Lausanne und Bellinzona befinden sich direkt beim Bahnhof und erlauben ökologische Arbeitswege mit öffentlichen Verkehrsmitteln. Die meisten Mitarbeiterinnen und Mitarbeiter arbeiten zudem regelmässig im Home-Office. Hybrides Arbeiten ist auf allen Stufen möglich.

Die ESG-Kriterien sind ein wichtiger Bestandteil des Chancen- und Risikomanagements bei der Vermögensbewirtschaftung und als Grundsatz im Anlagereglement der Stiftung festgelegt. Damit erzielt die Auffangeinrichtung bei ESG-Themen eine nachweisliche Wirkung. Um den langfristigen Erfolg der Aktienanlagen zu sichern, nimmt die Stiftung die Aktionärsrechte aktiv wahr. Sie orientiert sich dabei an den Richtlinien zur Ausübung der Stimmrechte der Ethos Stiftung und kommt so ihrer treuhänderischen Verantwortung gegenüber ihren Destinatären nach.



2 Unsere Verantwortung als Unternehmen

Die Stiftung Auffangeinrichtung BVG übernimmt wirtschaftliche, soziale und ökologische Verantwortung. Zum einen, indem sie einen zentralen Beitrag leistet zur Stabilität und Funktionsfähigkeit der Altersvorsorge in der Schweiz, zum anderen als soziale Arbeitgeberin in allen Landesteilen. Für uns ist eine wertebasierte Zusammenarbeit von zentraler Bedeutung. In Sachen Umwelt achten wir darauf, unseren Energie-, Wasser- und Papierverbrauch niedrig zu halten.



Wir engagieren uns für die Stabilität und Funktionsfähigkeit der Altersvorsorge in der Schweiz

Durch ihre durch den Bund übertragenen Spezialaufgaben, ihre Stellung im Markt und ihre Vernetzung in Politik, Verwaltung und Behörden ist die von den Arbeitnehmer- und Arbeitgeberverbänden getragene privatrechtliche Stiftung ein wichtiger Pfeiler in der zweiten Säule und unterstützt wesentlich die Stabilität des Systems.



Wir treiben die Digitalisierung voran

Durch die Online Services, die Kundinnen und Kunden wie auch andere Vorsorgeeinrichtungen nutzen können, tragen wir zu Effizienz und sparsamem Ressourceneinsatz (u. a. weniger Papierverbrauch) bei.



Wir zahlen faire Löhne

Zertifizierte Lohngleichheit für alle 200 Mitarbeitenden (SQS FAIR Compensation) und transparente Funktionsbeschriebe und -lohnbänder sind uns wichtig – von den Lernenden bis zum Geschäftsführer.



Wir fördern nachhaltige Mobilität

Die Bürostandorte Zürich-Oerlikon, Lausanne und Bellinzona sind in nächster Nähe zu Bahnhöfen, die zu den grössten der jeweiligen Landesgegenden gehören und damit die beste Anbindung an den öffentlichen Verkehr gewährleisten. Wir legen unsere Geschäftsreisen primär mit der Bahn zurück.



Wir ermöglichen flexibles Arbeiten

Im Rahmen des betrieblich Möglichen unterstützen wir Arbeitszeitmodelle wie Home-Office, Teilzeit- und Gleitzeitarbeit.



Wir beschaffen nachhaltig

Im Beschaffungswesen achten wir darauf, dass eine tiefe Umweltbelastung entsteht. Rund 99 Prozent unseres Stromverbrauchs (2021: 412 MWh) wird mit erneuerbaren Energien produziert.

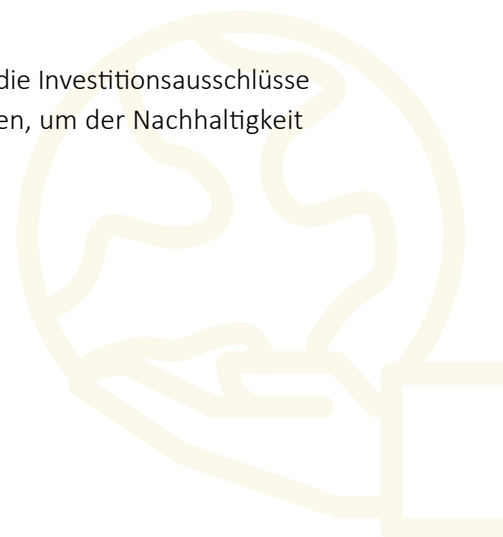
3 Unsere Verantwortung als Investorin

Für die Stiftung Auffangeinrichtung BVG ist die langfristig erfolgreiche Kapitalanlage aufgrund der gesetzlich verankerten, [treuhänderischen Sorgfaltspflicht](#) zur Ausrichtung von Renten und sicheren Führung von Freizügigkeitskonten von zentraler Bedeutung. Dabei werden Nachhaltigkeitsfaktoren wie eine intakte Umwelt, Soziales und verantwortungsvolle Unternehmensführung (ESG-Kriterien) berücksichtigt.

Beim Definieren der im Anlagereglement verankerten Anlagegrundsätze hat der Stiftungsrat der Auffangeinrichtung einen spezifischen [Grundsatz zur Nachhaltigkeit](#) formuliert. Auf Basis dieses Grundsatzes finden ökologische und soziale Aspekte im Investmentprozess Eingang und dank der konkreten Umsetzung erzielt die Stiftung Wirkung in der nachhaltigen Entwicklung.

Die Vermögensverwaltung erfolgt hauptsächlich über Vermögensverwaltungsmandate, die an externe Portfoliomanager (Banken oder andere spezialisierte Institutionen) übertragen werden. Bei der Portfoliomanager-Selektion wird der Einbezug von [ESG-Kriterien](#) in den Anlageprozess explizit berücksichtigt. Alle Vermögensverwalter der Auffangeinrichtung haben die [UN Principles for Responsible Investment \(UN-PRI\)](#) unterzeichnet.

Die Wahrnehmung der Aktionärsrechte, der Dialog mit den Unternehmen und die Investitionsausschlüsse im Ausnahmefall sind für die Auffangeinrichtung die geeignetsten Massnahmen, um der Nachhaltigkeit langfristig Rechnung zu tragen.



ESG-Kriterien

Es sind Kriterien zur Messung der Nachhaltigkeit, die Aspekte der Bereiche Umwelt, Soziales und Unternehmensführung beinhalten. Die Abkürzung ESG stammt von den englischen Begriffen Environment, Social und Governance.

Quelle: ASIP

3.1 Abstimmung: Stimmrechte ausüben

Die Stimmrechtsausübung ist ein wichtiges Instrument zur Sicherstellung der langfristigen Interessen der Begünstigten des Vorsorgevermögens. Neben den rein finanziellen Interessen rücken die ESG-Faktoren in den Fokus. Die Auffangeinrichtung orientiert sich dabei an den [Stimmrechtsempfehlungen der Ethos Stiftung](#).

Die Stimmrechte werden im langfristigen Interesse der Versicherten ausgeübt. Die Stimmrechtsempfehlungen der Ethos Stiftung basieren auf den jährlich überarbeiteten [Richtlinien zur Ausübung der Stimmrechte](#). Sie regeln detailliert, unter welchen Umständen Anträge des Verwaltungsrats angenommen respektive abgelehnt werden. [ESG-Kriterien](#) insbesondere die Unternehmensführung (Corporate Governance), aber auch die CO₂-Emissionen, [bilden die Grundlage](#) für die Stimmrechtsempfehlung.

Für sämtliche Schweizer Unternehmen im SPI (Swiss Performance Index), in welche die Auffangeinrichtung investiert, nimmt sie seit 2009 ihre Stimmrechte wahr. Für das Jahr 2021 bedeutete dies, dass die Auffangeinrichtung bei Generalversammlungen von [200 Schweizer Unternehmen](#) ihre Stimmen abgegeben hat ([Details](#)). Zudem übt die Stiftung Auffangeinrichtung die Stimmrechte für die 500 grössten Beteiligungen ausländischer Gesellschaften aus.

Ethos Stiftung

Die [Ethos Stiftung](#) schliesst mehr als 220 schweizerische Pensionskassen und andere steuerbefreite Institutionen zusammen. Sie wurde 1997 zur Förderung einer nachhaltigen Anlagetätigkeit und eines stabilen und gesunden Wirtschaftsumfelds gegründet.

Quelle: Ethos

3.2 Engagement: Dialog mit Unternehmen

Die Stiftung Auffangeinrichtung übt das Engagement über die beiden Ethos Engagement Pools [Schweiz](#) und [International](#) aus. Durch die Bündelung, innerhalb der beiden Pools, mit anderen Pensionskassen und Investoren erhält der Dialog mit den Unternehmen mehr Gewicht. Dadurch ist der konstruktive Dialog ein wichtiges Element, um die Nachhaltigkeit – insbesondere auch im Bereich der CO₂-Reduktion – zu fördern.

Ethos sucht im Namen der Mitglieder den dauerhaften Dialog mit dem Management von Unternehmen und richtet sich dabei nach den Werten der [Ethos-Charta](#) und [auf internationalen Standards](#) (Sustainable Development Goals, UN Global Compact, OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen).

EEP Schweiz

Der Ethos Engagement Pool Schweiz führt aktiv den Dialog mit den 150 grössten börsenkotierten Unternehmen anhand der jährlich von den Pool-Mitgliedern festgelegten [Dialogthemen](#) und hält die Resultate in einem [Bericht](#) fest.

EEP International

Der Ethos Engagement Pool International führt einerseits direkte Gespräche mit börsenkotierten Unternehmen im Ausland, andererseits beteiligt er seine Mitglieder an internationalen Investoren-Initiativen (Beispiel Carbon Disclosure Project). Die [Themenschwerpunkte](#) und die [Zusammenfassung der Aktivitäten](#) werden jeweils publiziert.

Quelle: Ethos

3.3 Ausschluss: Unternehmen, die nicht berücksichtigt werden

Die Stiftung Auffangeinrichtung BVG schliesst explizit Unternehmen aus ihrem Anlageportfolio aus, welche sich nicht an die [Osloer Abkommen](#) gegen die Herstellung und Verbreitung von Streumunition und Personenminen und den New Yorker Atomwaffensperrvertrag halten. Zudem hält sich die Auffangeinrichtung an allfällige Sanktionsregime der Schweiz und der UNO.

Einmal jährlich oder wenn ausserordentliche Ereignisse es erfordern, beschliesst der Anlageausschuss der Stiftung Auffangeinrichtung, ob er die [SVVK-ASIR+](#)-Ausschlussliste auf den Kapitalanlagen der Auffangeinrichtung anwenden will. In den vergangenen Jahren und auch aktuell findet die [Ausschlussliste](#) ohne Einschränkung auch bei der Auffangeinrichtung Anwendung.



Stiftung Auffangeinrichtung BVG

Standort Deutschschweiz
Elias-Canetti-Strasse 2
8050 Zürich

Fondation institution supplétive LPP

Agence Suisse romande
Boulevard de Grancy 39
1006 Lausanne

Fondazione istituto collettore LPP

Agenzia Svizzera italiana
Viale Stazione 36
6501 Bellinzona

September 2022