

PENSIONS-KASSE DER SCHNEIDER ELECTRIC- GESELLSCHAFTEN SCHWEIZ

NACHTRAG NR. 2 ZUM ANLAGEREGLEMENT

GÜLTIG AB 1. DEZEMBER 2022

ANHANG 1: KOMPETENZORDNUNG – GÜLTIG AB 01.05.2020

Kompetenzen		Stellen	
E	Entscheid	SR	Stiftungsrat
P	Planung / Initiative	AA	Anlageausschuss
D	Durchführung	LA	Liegenschaftenausschuss
C	Controlling	GF	Geschäftsführung
()	freiwillig	GC / VV	Global Custodian / Vermögensverwalter
		EX	Externe Unternehmung

Kompetenz	SR	AA / LA	GF	GC / VV	EX
Anlagerichtlinien					
Änderungen des Anlagereglements, der Grundsätze für die Kapitalanlagen und der Kompetenzordnung	E	(P)	P/D		
Periodische Überprüfung der Anlagestrategie	E	(P)	P/D		D
Umsetzung der Anlagerichtlinien bei Wertschriften					
Gestaltung der Grundsätze der Anlageorganisation (z.B. interne oder externe Vermögensverwaltung, Auslagerung einzelner Aufgaben)	E	(P)	P/D		
Bestimmung externer Berater oder Vermögensverwalter	E		P	D	D
Kauf und Verkauf einzelner Valoren von neuen Anlageklassen, aber innerhalb der bestehenden Strategie		E	P/D		
Auftragsspezifikation für interne/externe Vermögensverwalter, Kauf und Verkauf einzelner Valoren innerhalb der bestehenden Anlageklassen			E/D		
Temporäres Aussetzen des Rebalancings für max. 3 Monate		E	P	D	
Bewirtschaftung der operativen Liquidität			D		
Depotführung					
Einrichten und Führen der revisionsfähigen Wertschriftenbuchhaltung mit Quartals- und Jahresabschlüssen			P/D	D	D
Rückforderung der Quellen- und Verrechnungssteuer			D		D
Wertschriften Reporting / Controlling					
Überwachen der Anlagestrategie und der Performance		P	C	D	D
Performanceanalyse und quartalsweise Berichterstattung			C/P	D	D
Periodische Besprechungen mit den Vermögensverwaltern		D	P/D	D	

Kompetenz	SR	AA / LA	GF	GC / VV	EX
Überwachung der BVG-Vorschriften und internen Vorgaben für Vermögensverwalter		E	P/D	D	D
Wahrnehmung der Stimmrechte gemäss VegüV					
Änderung der Grundsätze für die Wahrnehmung	E	(P)	P/D		
Regelmässige Überprüfung und Entscheid/Wahl Proxy Advisor	E	(P)	P/D		D
Umsetzung der Anlagerichtlinien im Bereich Immobilien					
Evaluation von Immobilien	E	P	P/D		(D)
Kauf und Verkauf von Immobilien	E	P	P/D		(D)
Liegenschaftenrenovationen - bis CHF 100'000 pro Jahr - über CHF 100'000 pro Jahr	E	E	C C		P/D P/D
Mietzinspolitik		E	C/D		P
Liegenschaftenverwaltung (Vermietung, Mietverträge, Mietzinskontrolle, Heizkostenabrechnung)		E/C	D		P/D
Wahl externer Liegenschaftsverwalter	E		C/P/D		
Periodische Bewertung und Qualitätsanalyse des Immobilienbestandes		E	C		P/D

ANHANG 2: ANLAGESTRATEGIE – GÜLTIG AB 01.12.2022

Anlageinstrument	Untere Bandbreite	Strategie	Obere Bandbreite
Liquidität	0%	1.0%	5.0%
Obligationen CHF ESG	22.4%	24.0%	33.6%
Hypotheken CHF "AST" aktiv		4.0%	
Obligationen FW (hedged)	5.6%	7.0%	8.4%
Obligationen FW (Emerging Markets)	2.4%	3.0%	3.6%
Aktien Schweiz	4.0%	5.0%	6.0%
Aktien Ausland ESG (hedged)	21.6%	27.0%	32.4%
Aktien Ausland (Small Caps)	3.2%	4.0%	4.8%
Aktien Ausland (Emerging Markets)	3.2%	4.0%	4.8%
Immobilien Schweiz (AST)	16.0%	13.0%	26.0%
Immobilien Schweiz (Fonds)		4.0%	
Immobilien Ausland (AST hedged)		4.0%	

Ergänzungen

- Der Stiftungsrat hat die vorliegende Anlagestrategie am 06.12.2022 beschlossen. Sie tritt per 01.12.2022 in Kraft. Die Bandbreiten sind am 03.12.2020 letztmals angepasst worden.
- Die Zielgrösse der Wertschwankungsreserve beträgt 20.5% des Vorsorgekapitals und der technischen Rückstellungen (Konkretisierung von Art. 2 Abs. 5 durch Anlageberater: Stand 20.05.2020).
- Die Umsetzung der Anlagestrategie erfolgt über ein passiv-indexiertes Verwaltungsmandat mit Rebalancing bei Verletzung einer der mit dem Vermögensverwalter vereinbarten oberen oder unteren Bandbreiten.

ANHANG 3: BENCHMARK – GÜLTIG AB 01.12.2022

Anlagekategorie	Vergleichsindex
Liquidität und Geldmarkt	FTSE Eurodeposit Index 3 Months CHF, Total Return
Obligationen CHF	Swiss Bond Index ESG AAA-BBB, Total Return 1-5 Years (TR)
Hypotheken CHF "AST" aktiv	Swiss Bond Index AAA-BBB, Total Return 1-5 Years (TR)
Obligationen Fremdwährungen Entwickelte Länder (hedged in CHF)	Bloomberg Barclays Global Aggregate (hedged CHF)
Obligationen Fremdwährungen Emerging Markets (Lokalwährung)	JP Morgan GBI-EM Global Diversified (TR)
Aktien Schweiz	Swiss Performance Index, Total Return
Aktien Welt (hedged in CHF)	MSCI World ex. Switzerland ESG Screened Index, hedged CHF (USA: gross dividend reinvested, Übrige: net dividend reinvested)
Aktien Welt Small Caps	MSCI World Small Cap Index ex. Switzerland, hedged CHF (USA: gross dividend reinvested, Übrige: net dividend reinvested)
Aktien Welt Emerging Markets	MSCI Emerging Markets Index (net dividend reinvested)
Immobilien Schweiz Direktanlagen und Anlagestiftungen	KGAST Immobilien (Referenzindex)
Immobilien Schweiz Fonds	SXI Real Estate Funds (TR)
Immobilien Ausland Anlagestiftungen (hedged)	4% p.a. in CHF

Diese Anhänge 2 und 3 ersetzen die bisherigen Anhänge 2 und 3 des Anlagereglements vom 01.01.2018 und ersetzen den Nachtrag Nr. 1 zum Anlagereglement, gültig ab 01.10.2018 sowie den Nachtrag Nr. 2, gültig ab 01.07.2021.

Dieser Nachtrag tritt rückwirkend auf den 1. Dezember 2022 in Kraft.

Horgen, 23.05.2023

Der Stiftungsrat der Pensionskasse der Schneider Electric-Gesellschaften Schweiz

Katrin Bischofberger
Vertretung Arbeitgeber

Georges Lipp
Vertretung Arbeitnehmer