

Ihre Nestlé Pensionsfonds AG (NPF): Aktuelle Informationen zum Unternehmen und zu den Grundsätzen unserer Anlagepolitik

Stand 31.12.2019

Lage des Unternehmens – Zusammenfassung der wichtigsten Informationen aus dem Jahresabschluss 2019:

- Die Bilanzsumme beträgt 271,5 (256)¹ Mio. €
- Der Bilanzgewinn beträgt 163,4 (-17) Tsd. €
- Die Gewinnrücklagen betragen 66,4 (57) Tsd. €
- Realisierte Marktwertverzinsung der Kapitalanlage der Gesellschaft beträgt 3,2 (3,4) % und der Kapitalanlagen für Rechnung und Risiko von Arbeitnehmern und Arbeitgebern beträgt 12,6 (-3,1) %
- Vereinnahmte Beitragseinnahmen in Höhe von 0,6 (0,7) Mio. €
- Die planmäßigen Zahlungen für Versicherungsfälle betragen 15,7 (16,3) Mio. €
- Die NPF hat 13.306 (13.546) Versicherte, davon 5.503 (5.636) Anwärter und 7.803 (7.910) Rentner

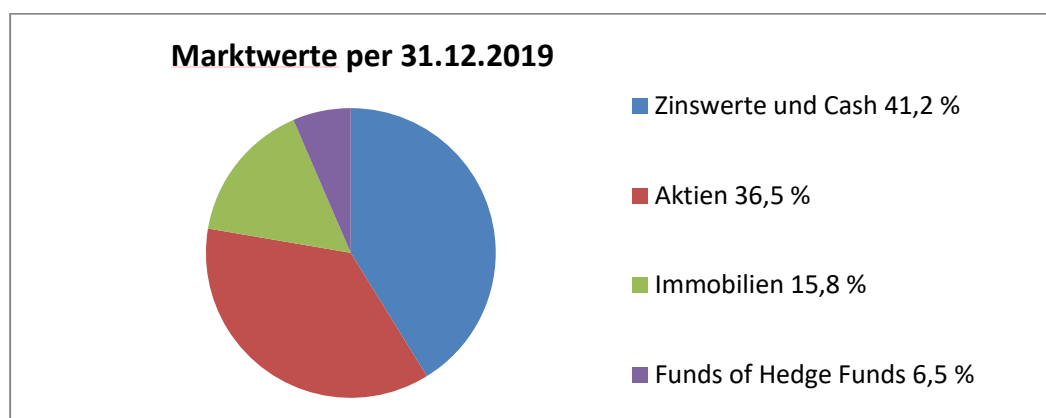
Die wirtschaftliche Lage der Gesellschaft ist stabil. Die aufsichtlichen Solvabilitätsanforderungen wurden im Geschäftsjahr 2019 erfüllt.

Grundsätze der Anlagepolitik

Die Erfüllung der Leistungsverpflichtungen steht im Mittelpunkt unserer Kapitalanlagestrategie. Sie berücksichtigt wesentliche Kriterien wie Rentabilität, Sicherheit und Liquidität unter Wahrung angemessener Mischung und Streuung der Kapitalanlagen. In unserer internen Kapitalanlagerichtlinie werden Grundsätze zur Kapitalanlage und zum Investmentprozess definiert. Sie wurde mit unserer Aufsichtsbehörde abgestimmt und vom Vorstand der NPF verabschiedet.

Die strategische Aufteilung unserer Kapitalanlagen gemäß der im April 2019 aktualisierten Asset-Liability-Management-Studie (ALM-Studie) lautet: 42,5 % in Zinswerte und Cash, 33,0 % in Aktien, 18,0 % in Immobilien und 6,5 % in alternative Investmentanlagen. Diese Ausrichtung berücksichtigt im Vergleich zur letzten ALM-Studie eine etwas höhere Allokation in Zinswerte und Immobilien und eine etwas geringere Allokation in alternative Investmentanlagen und Aktien. Das Kapital wird zum größten Teil von externen Investmentmanagern verwaltet. Diese investieren auf der Basis von transparenten und allgemein zugänglichen Anlageindizes sowie unter Beachtung von aufsichtlichen Anforderungen.

Aufteilung der Kapitalanlagen des NPF



Risikomanagement

Das den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorgaben entsprechende Risikomanagement ist zentraler Bestandteil der Unternehmenssteuerung und dient zur frühzeitigen Erkennung bestandsgefährdender Entwicklungen. Kernelement des Risikomanagements der NPF ist ein Asset-Liability-Management zur

¹ Angaben in Klammern jeweils Vorjahreszahlen

Überwachung und Steuerung der langfristigen Erfüllbarkeit der Verpflichtungen. Zur Früherkennung der Risiken unserer Kapitalanlagen wurde ein auf die Größe des Fonds abgestimmtes Überwachungssystem eingerichtet. Das Risiko der Kapitalanlagen wird laufend als VaR (Value at Risk) mit einem Konfidenzniveau von 99,5 % und einer quartalsweisen Betrachtungsperiode gemessen. Dem Gesamtvorstand wird darüber in regelmäßigen Sitzungen berichtet.

Ziel des Risikomanagements ist es, auch bei Fortbestehen des bereits lang andauernden historisch niedrigen Zinsniveaus die Erfüllbarkeit der Verpflichtungen sicherzustellen.

Berücksichtigung ökologischer, sozialer und die Unternehmensführung betreffender Belange im Rahmen der Kapitalanlage

Die Firma Institutional Shareholder Services Germany AG, München, wurde beauftragt, die Nestlé Versorgungseinrichtungen bei der Verstärkung der Nachhaltigkeitsausrichtung ihrer Kapitalanlagen zu unterstützen. Zusätzlich nutzt der Vorstand der NPF bei dieser Aufgabe die Expertise eines aus sechs externen Experten zusammengesetzten Socially Responsible Investments-Gremiums. Dieses Gremium gibt sowohl dem Vorstand als auch dem Investment Committee eine Rückkopplung über die Auswirkungen und Konsequenzen der Investments. Damit hilft es uns, die in den Nestlé Unternehmensgrundsätzen beschriebenen Werte auch bei den Kapitalanlagen zu unterstützen.

Weitere detaillierte Informationen entnehmen Sie gerne den Jahresabschlussunterlagen der NPF AG, die im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlicht werden.

Wichtiger Hinweis: Obwohl die Erstellung der vorliegenden Information mit größtmöglicher Sorgfalt vorgenommen wurde, erfolgt diese vorbehaltlich Irrtümern und Druckfehlern.