

Kleine Anfrage

der Abgeordneten Dr. Gerhard Schick, Anja Hajduk, Annalena Baerbock, Sylvia Kotting-Uhl, Dr. Danyal Bayaz, Lisa Paus, Stefan Schmidt, Markus Kurth, Katharina Dröge, Sven-Christian Kindler, Beate Müller-Gemmeke, Corinna Rüffer, Matthias Gastel, Christian Kühn (Tübingen), Markus Tressel, Daniela Wagner und der Fraktion BÜNDNIS 90/DIE GRÜNEN

Nachhaltigkeit der Kapitalanlage des Bundes

Während die Bundesregierung für betriebliche Pensionskassen die verpflichtende Offenlegung von Nachhaltigkeitsrisiken vorsieht (vgl. Bundestagsdrucksache 19/4673), investiert sie über Aktien- und Anleihemärkte oder direkte Beteiligungen in Geschäftsfelder und Produktionsweisen, die der Deutschen Nachhaltigkeitsstrategie, der Agenda 2030 und dem Pariser Klimaschutzabkommen nach Ansicht der Fragesteller diametral zuwiderlaufen, darunter Atomkraft, fossile Brennstoffe und völkerrechtlich geächtete Waffen. Nicht einmal Kinderarbeit ist ausgeschlossen. Ein Großteil der so veranlagten Gelder dient der Altersversorgung von Beamtinnen und Beamten, Richterinnen und Richtern und Soldatinnen und Soldaten. Konzepte für Divestment und nachhaltige Geldanlage sind nicht bekannt, entsprechende parlamentarische Initiativen wurden ohne Nennung von Gründen zwischen CDU, CSU und SPD abgelehnt (vgl. Bundestagsdrucksachen 18/10529, 18/12843). Entweder droht nach Ansicht der Fragesteller die kapitalgedeckte Beamtenversorgung oder die Nachhaltigkeitsstrategie des Bundes zu scheitern.

Wir fragen die Bundesregierung:

1. Wie hoch in Mrd. Euro ist aktuell das Kapitalanlagevermögen des Bundes einschließlich bundesunmittelbarer Körperschaften, Anstalten und Stiftungen des öffentlichen Rechts, und wie wird es mit welchem Ergebnis am Finanzmarkt veranlagt (bitte Körperschaft und Zweck, Summe gesamt und je Anlageklasse – Bankeinlagen, Pfandbriefe, Staatsanleihen, Unternehmensanleihen, Aktien, etc. –, Rendite – akkumuliert seit 1. Januar 2010 oder später, je nach Verfügbarkeit – sowie die Information tabellarisch auflisten, ob Nachhaltigkeitsrisiken berücksichtigt werden, und wenn ja, wie und seit wann)?
2. Wie wird sich voraussichtlich die Summe des Kapitalanlagevermögens unter Berücksichtigung derzeit geplanter Ein- und Auszahlungen bis 2030 entwickeln?
3. Sieht die Bundesregierung jenseits vom finanziellen Risikomanagement Gründe, wieso die Kapitalanlage des Bundes Nachhaltigkeitskriterien berücksichtigen sollte?

4. Wie bewertet die Bundesregierung den Einfluss von Nachhaltigkeitsrisiken auf das in der Vergangenheit erzielte Rendite-Risiko-Verhältnis der in Frage 1 aufgelisteten Vermögen (bitte anhand der Empirie begründen)?
 - a) Welche akkumulierte Aktienrendite seit 1. Januar 2010 erzielten Versorgungsfonds und -rücklage des Bundes sowie der Versorgungsfonds der Bundesagentur für Arbeit mit a) Aktien insgesamt und b) Aktien der Branchen fossile Brennstoffe und Atomkraft (für b) bitte Aktienbestand zum 1. Januar 2018 und heute je Unternehmen einzeln auflisten)?
 - b) Welche akkumulierte Aktienrendite seit 1. Januar 2010 erzielte die Deutsche Bundesstiftung Umwelt und welche Nachhaltigkeitsrisiken wurden dabei wie berücksichtigt (vgl. Drucksache 18(4)678 C)?
 - c) Welche akkumulierte Aktienrendite seit 1. Januar 2010 erzielte nach Kenntnis der Bundesregierung die Versorgungsrücklage des Landes Hessen, und welche Nachhaltigkeitsrisiken wurden dabei wie berücksichtigt (vgl. Drucksache des Hessischen Landtags 19/6383)?
 - d) Im Vergleich zu den vorgenannten Benchmarks, hat die Nichtberücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken im Aktienportfolio von Versorgungsfonds und -rücklage des Bundes und Versorgungsfonds der Bundesagentur für Arbeit zu einer Minderrendite geführt?

Wenn ja, wie hoch in Euro ist der geschätzte akkumulierte Fehlbetrag?

5. Welche Geschäftsfelder schließt der Fonds zur Finanzierung der kerntechnischen Entsorgung bezüglich Investitionen derzeit aus, und welche weiteren Ausschlüsse sollen nach Vorschlag des Vorstands hinzukommen?
 - a) Wie beeinflussen die Ausschlüsse das Rendite-Risiko-Verhältnis (bitte Backtesting im Vergleich mit MSCI-World-Index)?
 - b) Wie viele Planstellen in der Fondsverwaltung verfügen derzeit über eine ausgewiesene ESG-Expertise (ESG = Environment, Social, Governance), welche Personalstärke wird mittelfristig angestrebt, und wo sollen die Stellen organisatorisch angegliedert sein, im Portfoliomanagement oder in der Kommunikationsabteilung?
6. Wieso erhöht der Bund die Beteiligung anderer staatlicher Fonds an AKW im Ausland, und wie und bis wann soll die Vereinbarung aus dem Koalitionsvertrag zwischen CDU, CSU und SPD, solche Investitionen zu unterlassen, umgesetzt werden?
7. Seit wann existiert die interministerielle Arbeitsgruppe zur Erarbeitung von Nachhaltigkeitskriterien für Versorgungsfonds und -rücklage des Bundes, wie lautet ihr genauer Arbeitsauftrag, wie oft hat sie seither getagt, welche Bundesministerien bzw. Referate sind darin mit wie vielen Personen vertreten, was ist der aktuelle Stand der Arbeit und wann soll sie abgeschlossen sein?
8. Sieht die Bundesregierung einen Zielkonflikt zwischen der Umsetzung der Deutschen Nachhaltigkeitsstrategie einerseits und der Kapitalanlagestrategie des Bundes andererseits (bitte begründen)?
9. Wie bewertet die Bundesregierung Maßnahmen, die helfen, den vorgenannten Zielkonflikt zu entschärfen, darunter Ausschlusskriterien, ESG-Integration, Positivlisten, Engagement, Stimmrechtsausübung, etc. (Maßnahmen bitte einzeln bewerten)?
10. Inwieweit hält es die Bundesregierung für angebracht, die Berücksichtigung von Nachhaltigkeitsrisiken beim Versorgungsfonds des Bundes offenzulegen unter der Maßgabe, dass Bundestagsdrucksache 19/4673 eine solche Offenlegungspflicht für betriebliche Pensionsfonds vorsieht?

11. Sieht die Bundesregierung beim Versorgungsfonds des Bundes finanzielle Risiken „im Zusammenhang mit dem Klimawandel, der Verwendung von Ressourcen und der Umwelt sowie soziale Risiken und Risiken im Zusammenhang mit der durch eine geänderte Regulierung bedingten Wertminderung von Vermögenswerten“ gemäß Bundestagsdrucksache 19/4673?
12. Stimmt die Bundesregierung dem Bundesrat zu in dessen Einschätzung, dass die „Verpflichtung, den Umgang mit ESG-Faktoren transparent zu machen, [...] nicht nur im Interesse der Begünstigten, sondern auch der Aufsicht und der Öffentlichkeit [ist]“ (vgl. Beschluss zu Bundesratsdrucksache 428/18)?
13. Hält die Bundesregierung einen konsistenten Nachhaltigkeitsansatz für die Kapitalanlage des Bundes für erstrebenswert, und falls ja, wie könnte er aussehen?

Berlin, den 6. November 2018

Katrin Göring-Eckardt, Dr. Anton Hofreiter und Fraktion

