

Nachhaltige Vermögensanlage mit Indexfonds – Bremse oder Motor?

Welchen ökologischen und sozialen „Footprint“ hinterlässt mein Portfolio? Dies fragen sich institutionelle Anleger in zunehmendem Maße, zumal nachhaltige Anlagestrategien in den Medien intensiv diskutiert werden. Daraus ergibt sich die Folgefrage, ob sich ESG-basierte Strategien auch mit Indexfonds umsetzen lassen.

Beispiel MSCI: Aus dem Ansatz des Indexanbieters lassen sich alternative Indizes ableiten, die Unternehmen mit höheren Umwelt-, Sozial- und Governance-Standards enthalten. Diese kapitalmarktgewichteten Indizes berücksichtigen für jeden Sektor nur die 50 % der Firmen, die ESG Gesichtspunkte am stärksten berücksichtigen. Das Ziel ist ein repräsentativer Maßstab für die Rendite von nachhaltig investierten Aktienportfolios. Dieser soll nicht systematisch vom Standard abweichen, etwa bei Sektor- und Ländergewichtungen.

Doch neben der ökologischen und sozialen Dimension stellt sich die Frage nach der Renditeseite. Wirken sich Faktoren wie gestärkte Firmenkulturen oder verringerte operationelle Risiken durch ESG ökonomisch positiv aus? Gibt es Unterschiede zwischen Industrie- und Schwellenländern?

Der Workshop zeigt anhand von zwei Praxisbeispielen auf, wie nachhaltige Vermögensanlagen kostengünstig in einem Portfolio umgesetzt werden können.

Stefan Fröhlich



Stefan Fröhlich ist Leiter des Client Portfolio Managements für deutschsprachige Kunden im Bereich Index Solutions der Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG in Zürich. Zuvor war Herr Fröhlich Leiter des Portfoliomanagements für indexierte Anlagen in Aktien. Von 2008 bis 2011 leitete er das Portfoliomanagement bei VT Wealth Management AG in Zürich. Bereits von 2001 bis 2008 arbeitete Herr Fröhlich als Portfoliomanager für indexierte Portfolios bei der Credit Suisse in Zürich. Herr Fröhlich studierte an der Hochschule für Wirtschaft Zürich, ist Betriebsökonom FH und CFA Charterholder.

Kontaktdetails

Kontakt: Index Solutions

Tel.: + 41 44 334 41 41

Website: list.index@credit-suisse.com, www.credit-suisse.com/indexfonds