

PIMCO

Messung und Steuerung von Klimarisiken in Investment Portfolios: Vom Konzept zur Implementierung

Ziel des Workshops ist es den Teilnehmern einen Überblick über die wichtigsten Bausteine für das Management von Klimarisiken in festverzinslichen Anlageportfolios zu geben. Wir bieten Einblicke in PIMCO's Methoden und Werkzeuge für die Messung und Steuerung von Klimarisiken in Rahmen des Portfolio Managements, insbesondere anhand von Beispielen aus dem Bereich der Kreditmärkte.

Der Klimawandel wird wahrscheinlich tiefgreifende Auswirkungen auf die Weltwirtschaft, die Finanzmärkte und die Emittenten haben. Wir glauben, dass es wichtig ist, Klimarisikobewertungen in unsere Investitionsentscheidungen einzubeziehen.

Die Analyse von Klimarisiken bei der Emmittenauswahl wird bei PIMCO wird von Kreditanalysten geleitet, die in enger Abstimmung mit unseren ESG-Spezialisten (Environmental, Social and Governance) arbeiten und Klimarisiken bei der Vergabe von proprietären ESG-Scores und der unabhängigen Kreditanalyse explizit berücksichtigen.

Um unser Kreditanalysten bei der Einschätzung von Klimarisiken zu unterstützen, haben die ESG-Spezialisten von PIMCO sieben firmeneigene Tools entwickelt, die die möglichen Auswirkungen extremer Wetterereignisse, den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und weiterer Faktoren untersuchen. Die mit diesen Tools gewonnenen Erkenntnisse sollen Portfoliomanagern helfen, klimabedingte Kreditrisiken besser zu steuern und zu mindern. Durch die Harmonisierung der Analyse über verschiedene Anlageklassen und Sektoren hinweg möchten wir sicherstellen, dass sowohl dedizierte ESG-Portfolios als auch generalistische Strategien Klimarisiken bei der Portfoliokonstruktion berücksichtigen.

Auch wenn die Risiken zunehmen, ergeben sich Chancen, wenn Menschen auf der ganzen Welt vom Klimabewusstsein zum Handeln übergehen. Unsere unabhängige klimabezogene Analyse hilft uns, diese Anlageideen zu bewerten und zu nutzen.



Christian Schütz

Christian Schütz ist Senior Vice President und Kreditanalyst in der Niederlassung München und ist dort für die Analyse der europäischen Versorgungs- und Energiesektoren verantwortlich. Er ist auch Mitglied der globalen Nachhaltigkeitsinitiative von PIMCO und hilft bei der Überwachung der Integration von ESG-Faktoren (Environmental, Social and Governance) in die Kreditanalyse. Bevor er 2007 zu PIMCO kam, arbeitete er über zwei Jahre lang als Trainee und Werksstudent im Team für europäische Kreditpapiere. Er ist seit 15 Jahren in der Investmentbranche tätig und besitzt einen Masterabschluss in Betriebswirtschaftslehre der Katholischen Universität Eichstätt - WFI School of Business.

Kontakt: Daniel Huk
Tel.: +41 44 512 49 17
E-Mail: daniel.huk@pimco.com
Website: www.pimco.co.uk