

Ortec Finance Seminar

Trends und Neuerungen im Vorsorgebereich / Latest trends and innovations in the pension fund field

Donnerstag, 28. März 2019
Thursday, March 28, 2019

Detailliertes Programm / Detailed Program

Vormittag

(in deutscher Sprache gehalten)

08:30 Einlass und Anmeldung

09:00 Begrüssung und Einleitung

Raymond Hamersma, Senior Consultant, Ortec Finance

09:15 ALM – Neuerungen und Trends

Reto Wild, Senior Consultant, Ortec Finance

Die traditionelle ALM-Studie prüft, ob die Verbindlichkeiten mit der jetzigen Anlagestrategie bedient werden können, beziehungsweise, ob die Anlageseite die Risiken auf der Verpflichtungsseite auszugleichen vermag. Die Anforderungen an ALM-Studien und deren Aussagekraft sind in den letzten Jahren stetig angestiegen. Reto Wild, Senior Consultant bei Ortec Finance, geht auf die Neuerungen und Trends in der ALM-Branche ein und macht Sie darauf aufmerksam, auf welche Faktoren in den nächsten Jahren speziell zu achten ist und welche Tücken sich den Pensionskassenverantwortlichen in einem ALM-Prozess stellen.

09:45 Nachhaltigkeit bei PUBLICA

Patrick Uelfeti, CFA, Stellvertretender Leiter Asset Management, Pensionskasse des Bundes PUBLICA

Seit 2015 berücksichtigt die Pensionskasse des Bundes Aspekte der Nachhaltigkeit in ihrem Investitionsprozess und nimmt damit eine Vorreiterrolle in der schweizerischen PK-Landschaft ein. Unser Gastredner, Patrick Uelfeti, führt Sie durch den Nachhaltigkeitsansatz der PUBLICA, welcher neben bekannten Massnahmen wie der Wahrnehmung der Aktionärsrechte (Screening und Engagement) auch die ESG-Risikoanalyse beinhaltet. Dabei handelt es sich um einen festen Teil des strategischen Risikomanagements, wobei wirtschaftliche, ökologische, technologische oder soziale Risiken hinsichtlich ihrer potenziellen Folgen für das Vermögen von PUBLICA untersucht, priorisiert und wenn möglich umgesetzt werden.

10:30 Pause

11:00 Integration von Klimarisiken in den Anlageentscheidungsprozess: Einführung unseres klima-integrierten ökonomischen und finanziellen Szenarios

Lisa Eichler, Co-Head of ESG and Climate Solutions, Ortec Finance

Lisa Eichler, die ESG-Spezialistin bei Ortec Finance, gibt Ihnen einen Einblick zum Thema Klimarisikoanalysen und wie die neuesten, klima-integrierten Szenarien von Ortec Finance die Pensionskassen dabei unterstützen können, das Thema gesamtheitlich anzugehen.

11:45 Stehlunch / Lunch

Afternoon

(conducted in English)

13:15 Introduction

Hens Steehouwer, Head of Research, Ortec Finance

13:20 The Dutch and Swiss Pension Fund System – conclusions from an international comparison

Elwin Molenbroek, Senior Consultant, Ortec Finance

The Dutch Pension Fund system was awarded the highest rank in the Mercer Global Pension Index 2018. What makes the Dutch Pension Fund system so successful and how does it distinguish itself from Switzerland? Elwin Molenbroek, Senior Consultant at Ortec Finance, will give an introduction on the Dutch pension funds and highlights what lessons can be learned from the land without mountains.

13:50 Dutch pensions in practice

Martijn Penders, Investment Manager, DSM Pension Services B.V.

The current economic environment is challenging for pension funds around the globe. During the presentation Martijn Penders will share experiences from the Dutch pension fund of DSM, a Dutch multinational corporation active in the fields of health, nutrition and materials. He will cover the following questions: How does the Dutch regulatory framework impact the decisions taken by the pension fund. How to deal with sometimes contradictory objectives between local and corporate regulations? And last but not least, why are there so many discussions about improving one of the best systems in the world?

14:45 Break

15:15 On the quality of investment decision models

Hens Steehouwer, Head of Research, Ortec Finance

Models play an important role in making investment decisions. The better the models, the better the information to base these decisions on and the more likely it can become that objectives will be achieved. In this presentation Hens Steehouwer, our Head of Research, will touch upon several topics related to the quality of investment decision models in general and the Ortec Finance models in particular: a live track record of the Ortec Finance scenario models, the latest methodological improvements in these scenario models, advances in the use of robust optimization techniques and last but not least some important guidelines to ensure a sensible use of models.

15:45 Navigating climate scenario analysis: Implications for strategic investment decision-making

Lisa Eichler, Co-Head of ESG and Climate Solutions, Ortec Finance

This session will provide insights about the implications of systemic climate risks for your portfolio, what climate scenario analysis really means, as well as how to conduct top-down scenario analysis taking global warming pathways into account and how this affects your strategic asset allocation, i.e. is your investment strategy climate change-proof across different global warming pathways? Does sea level rise affect your funding ratio in 2045?

16:30 Drinks

Rotterdam

Boompjes 40
3011 XB Rotterdam
The Netherlands
Tel. +31 10 700 50 00

Zurich

Poststrasse 4
8808 Pfäffikon SZ
Switzerland
Tel. +41 55 410 38 38

Amsterdam

Naritaweg 51
1043 BP Amsterdam
The Netherlands
Tel. +31 20 700 97 00

Toronto

250 University Avenue #200
Toronto, ON M5H 3E5
Canada
Tel. +1 416 736 4955

London

Bridge House
181 Queen Victoria Street
London EC4V 4EG
United Kingdom
Tel. +44 20 3770 5780

Hong Kong

Unit 211, Building 12W
Phase 3 Hong Kong
Science Park
Shatin, Hong Kong
Tel. +852 2477 9288