

Klimatrisico- management voor institutionele investeerders



Is uw beleggingsstrategie bestand tegen klimatrisico's?



1. Uitdaging

2. Aanpak

3. Uw toepassingen



1. Uitdaging: Integreer klimaat in uw beleggingsstrategie

- ⊗ Krijg vooruitkijkende inzichten in de effecten van klimaatverandering op risico en rendement;
- ⊗ Versterk strategisch risicomanagement op basis van geïntegreerde state-of-the art klimaat-, economische en financiële modellen.



UN PRI



TCFD



EIOPA



Nationale wetgeving



2. Hoe gaan we deze uitdaging aan?

Het integreren van fysieke en transitierisico's en -kansen, op basis van drie verschillende temperatuurspaden (1,5, 3 en 4+°C), in een traditionele economische en financiële scenarioset.

Wetenschappelijke klimaatmodellen



Klimaatimpacts per temperatuurspad gebaseerd op wetenschappelijke klimaatprognoses (op basis van IPCC gegevens)...



Macro-econometrisch model



...worden geïntegreerd in een macro-economisch model met mondiale dekking die de vertaalslag maakt naar BBP-schokken per land, per jaar...



Stochastic financieel model



...De BBP-schokken worden op consistente wijze doorvertaald naar de 600+ financiële en economische variabelen van de Ortec Finance stochastische real world economische scenario's...



Klimaatbewuste Scenarioset

...Dit genereert klimaatbewuste economische en financiële vooruitzichten per temperatuurspad tot 2100, per land.



3. Uw toepassingen

Integreer klimaat kansen en risico's in uw beleggingstrategie compleet met top-down, korte- en lange termijn risico-analyse gebaseerd op klimaatbewuste scenariosets voor:

- ⊗ Klimaatbewuste ALM/SAA
- ⊗ ORSA stresstests met klimaatscenario's
- ⊗ Portefeuille-optimalisatie mede op basis van klimaatinformatie
- ⊗ Klimaatscenario-analyse voor rapportage (e.g. TCFD, UN PRI & de toezichthouder)

In strategische samenwerking met



Meer weten?

Lees hier het research paper

Neem voor meer informatie contact op met:



Willemijn Verdegaaal
Climate & ESG Solutions
+31 10 700 54 97
Willemijn.Verdegaaal@ortec-finance.com



Lisa Eichler
Climate & ESG Solutions
+31 10 700 54 98
Lisa.Eichler@ortec-finance.com

Follow us

