



Auswirkungen risikogewichteter Regulierung auf die Investmentstrategie von Langfristinvestoren

VON DR. CHRISTIAN SCHMITT

Die in Brüssel diskutierten risikogewichteten Eigenkapitalregeln für Pensionseinrichtungen könnten ungewollte Konsequenzen für das Anlageverhalten von Langfristinvestoren haben. Dr. Christian Schmitt von Risklab analysiert, welche Folgen eine risikobasierte Regulierung auf die Asset Allocation haben kann. Er zeigt, dass Pensionseinrichtungen im Standardmodell zum Verzicht auf attraktive Asset-Klassen und Diversifikationspotenzial gezwungen würden. Damit ergeben sich Forderungen an die Regulierer, wie der noch in Diskussion befindliche Ansatz ausgestaltet werden sollte.

Inhalt 06 2014



kommentare

Die Skalierbarkeit von Credit-Strategien hängt an der Liquidität
Thomas Herbert, CIO, Mgl. der Geschäftsführung, Meriten

Auswirkungen des KAGB auf geschlossene Investmentvermögen
Oliver Porr, Vorstandsvorsitzender bsi

artikel

Auswirkungen risikogewichteter Regulierung auf die Investmentstrategie von Pensionseinrichtungen
Dr. Christian Schmitt, risklab GmbH/Allianz Global Investors

Regimebasierte Asset Allocation im institutionellen Portfolio
Dr. Harald Iohre, Dr. Ivica Duš und Regina Hammerschmid, Deka

Paradigmenwechsel durch dynamische Investmentstrategien
Dr. Jan Viebig, Harcourt Investment Consulting

Rebalancing-Strategien in der institutionellen Kapitalanlage
Dr. Hubert Dichtl, Alpha Portfolio Advisors GmbH, Prof. Dr. Wolfgang Drobetz, Universität Hamburg und Jan Tille, Absolut Research GmbH

Funded Futures versus ETFs
Peter Scharl, BlackRock

Einsatz von ESG-Faktormodellen zur Verbesserung von Aktienportfolios
Prof. Dr. Dirk Söhnholz, Veritas Investment GmbH

Zeitenwende in der Finanzmarktregulierung
Frank Dornseifer, Bundesverband Alternative Investments e.V. (BAI)

analyse Multi-Asset-Strategien

drei fragen an Peter Hadasch, Vorstand Nestlé Deutschland

Ja, ich möchte den Absolutreport 06 2014 als kostenloses Leseexemplar anfordern.

Bitte senden oder faxen an:
info@absolut-report.de, 0049 (0)40 303779-15

Absolut Research GmbH
Große Elbstraße 277a, 22767 Hamburg

Vorname/Nachname

Bereich/Funktion*

Unternehmen*

Straße/Nr.

PLZ/Ort

Tel./Fax

E-Mail

* Pflichtangaben