

Första AP-fonden (AP1) inleder tillsammans med Ortec Finance och fyra andra finansiella institutioner ett unikt forskningsprojekt för att ta hänsyn till klimatförändringarna i strategiska investeringsbeslut

5 september 2018 – De finansiella institutionerna AP1, a.s.r., OPTrust Pensioenfonds van de Metalektro (PME) och Philips Pension Fund kommer i samarbete med Ortec Finance, leverantör av tekniska lösningar som stöd vid investeringsbeslut, att inleda en pilotstudie om klimatförändringarnas inverkan, vid sidan av traditionella data, vid framtagandet av underlag för beslut om strategisk portföljallokering.

– Bättre kunskap om hur klimatförändringarna kan påverka risker och avkastning är av stor vikt för vår långsiktiga avkastning. Att delta i denna klimatstudie kommer inte bara att fördjupa vår förståelse utan också vara en viktig del i hur vi utformar vår klimatstrategi, säger Mikael Angberg, kapitalförvaltningschef på AP1.

Projektets mål

Pilotstudien är en av de första i sitt slag när det gäller att integrera och kvantifiera risker kopplade till klimatförändringar i de traditionella finansiella framtidsscenarier som ligger till grund för beslut om långsiktig portföljsammansättning. Investerarna som ingår i den nyskapande pilotstudien kommer med hjälp av dessa utbyggda scenarier att analysera hur olika scenarier för den globala uppvärmningen kan påverka deras långsiktiga portföljsammansättning. Pilotstudien förväntas pågå till slutet av 2018. Om allt går enligt plan räknar man med att i början av 2019 kunna offentliggöra en sammanställning av olika klimatscenariers påverkan.

En gemensam insats

Pilotprojektet är ett brett samarbete mellan AP1, a.s.r., OPTrust, Pensioenfonds van de Metalektro (PME), Philips Pensioenfonds och Ortec Finance samt ledande akademiska institutioner såsom Cambridge Econometrics, Carbon Delta, CICERO, Potsdam Institute for Climate Impact Research, och det stöds också av Institute for Environmental Studies vid Vrije Universiteit Amsterdam, London School of Economics, Radboud University, Sustainable Finance Lab Utrecht och University of East Anglia.

Arbetsätt

Projektet som länkar vetenskaplig klimatdata till verktyg för framtagning underlag för beslut om strategisk portföljallokering är ett nytt sätt att beskriva möjlig framtida klimatpåverkan på portföljvinst. I pilotstudien kombineras befintlig akademisk forskning om klimatrelaterade risker knutna till ett antal scenarier för den globala uppvärmningen med viktiga makroekonomiska riskfaktorer (tillväxt, inflation, räntesatser). Resultatet kommer att integreras i Ortec Finances finansiella scenarier, där ett brett spektrum av vanliga finansiella och ekonomiska variabler redan ingår. Den strategiska portföljsammansättningen för de finansiella institutionerna i pilotprojektet kommer sedan att testas utifrån de nya klimatpåverkade finansiella scenarierna.

Förväntat resultat

Insikterna från denna analys kommer att ge investerarna en ökad förståelse för hur känsliga deras investeringsstrategier är för klimatrelaterade risker, hur väl anpassad den strategiska portföljsammansättningen är till internationella klimatöverenskommelser samt möjliggöra framtida rapportering i linje med TCFD. Ett annat syfte med pilotstudien är att forskarvärlden ska få information om de kunskaps- och dataluckor som finns så att framtida forskning kan anpassas till den finansiella sektorns faktiska behov.

Kontakt

Anna Fall, kommunikationschef
0709-681 250

Första AP-fonden (AP1) är en av fem AP-fonder som säkerställer stabiliteten i det svenska inkomstpensionssystemet. AP1 förvaltar tillgångar till ett värde av 338 miljarder kronor (30 juni 2018) i en global portfölj bestående av aktier, räntebärande värdepapper och alternativa investeringar. Uppdraget är att, med väl avvägda finansiella risker, uppnå högsta möjliga avkastning och därmed bidra till en hög och förutsägbar inkomstpension för nuvarande och framtida pensionärer. Första AP-fonden investerar långsiktigt och är en aktiv och engagerad ägare. Som ägare ställer fonden höga krav inom miljö, etik och bolagsstyrning.