



Informatietafel Bestuurders Voorjaar 2022

14 april 2022

Datum: Donderdag 14 april 2022, 13.30 tot ca. 17.45 uur
Locatie: Kasteel de Wittenburg – Bloemcamplaan 55 – Wassenaar
Thema: **Integraal Risicomanagement & Capital at Risk**
Risico's mitigeren of juist adopteren?

IPFOS nodigt u van harte uit voor de Informatietafel Bestuurders – Voorjaar 2022

Een crisis heeft drie kenmerken: Het komt geheel onverwachts, het heeft een grote impact en achteraf proberen wij het te verklaren. Op welke wijze domineren de huidige geopolitieke spanningen de markten? In welke mate wordt rekening gehouden met crises binnen het integraal risicomanagement? De mogelijkheid op een oorlog in Oekraïne is onderschat. De gevolgen zijn groot.

Welke afwegingen worden gemaakt bij het beoordelen van risico's en hun impact? Wat kan dit voor de beleggingsportefeuille betekenen? Kan een downside protectie helpen de risico's te mitigeren? Is hier een onderscheid te maken bij een crisis, een CWO of de overgang naar het NPS? Wordt de deelnemer er uiteindelijk beter van?

Verschillende sprekers nemen u mee in bovenstaande vraagstukken. Daarnaast zal ook stil gestaan worden bij:

- Wat is een goede manier om zicht te hebben en te houden op de financiële risico's?
- Welke beleggingscategorieën bieden goede diversificatie in tijden van extreme stress?
- Wanneer worden niet financiële risico's financiële risico's?
- Absoluut return en kapitaalbescherming is dat verstandig bij oplopende rente of in aanloop naar de overgang naar het nieuwe pensioenstelsel?
- Hoe kunnen de 1^{ste}, 2^{de} en 3^{de} lijnfuncties goed met elkaar samenwerken?
- Welke aandachtspunten heeft DNB voor de inrichting van het integraal risicomanagement?
- Hoe meet je het volwassenheidsniveau van de risicomanagement functie?
- Wat kan ik leren van het risicomanagement van mijn dienstverleners?
- Wat kan een custodian betekenen op het gebied van integraal risicomanagement?
- Is mijn governancestructuur risk-proof?

De volgende organisaties leveren een inhoudelijke bijdrage aan deze bijeenkomst: BMO Global Asset Management, J.P. Morgan Asset Management, KKL Partners, Northern Trust, Twelve Capital en 4PP Audit.

Het aantal deelnemers is beperkt tot ca. 50 personen. Wilt u deelnemen aan deze Informatietafel (waarbij de geldende RIVM-richtlijnen worden opgevolgd), meldt u zich dan alvast aan op: www.ipfos.eu.

Vriendelijke groet,

Christiaan Tromp
Managing Partner
M: +31 6 244 66 070
E: actromp@ipfos.eu
www.ipfos.eu





Informatietafel Bestuurders Voorjaar 2022

14 april 2022

Agenda

13:30 – 14:00	Ontvangst & Registratie	
14:00 – 14:10	Welkom & Introductie	Christiaan Tromp, IPFOS
14:10 – 14:40	China en de Russische invasie van Oekraïne	Vincent Juvyns, J.P. Morgan Asset Management
14:40 – 15:10	Diversification of pension fund portfolios in extreme scenarios	Urs Ramseier, Twelve Capital
15:10 – 15:40	Beleggen onder extreme onzekerheid: Hoe robuust is de asset mix?	Farid Kabbaj & Fons Lute, KKL Partners
15:40 – 16:10	Pauze	
16:10 – 16:40	Is het verstandig om in aanloop naar de overgang naar het nieuwe pensioenstelsel de dekkingsgraad van een portefeuille te beschermen tegen neerwaartse risico's? Wanneer en hoe?	Arthur Stroj, BMO Global Asset Management
16:40 – 17:10	Risicomanagement in de 1e, 2e en 3e lijn	Daniël Brouwer, 4PP Audit
17:10 – 17:40	Custody is het risicomanagement op uw data	Benjamin Versluijs, Northern Trust
17:40 –	Sluiting & Ouderwetse-Netwerkborrel	

Biografieën Sprekers



Vincent Juvyns, J.P. Morgan Asset Management

Vincent Juvyns, Executive Director, is als global market strategist verantwoordelijk voor het verschaffen van marktgerelateerde en economische analyses aan klanten in de Benelux, Frankrijk en Genève via het Market Insights-programma. Voor zijn komst naar J.P. Morgan Asset Management in 2013 was hij onderzoeksanalist bij de multi-asset-groep van ING Investment Management, waar hij fundamenteel onderzoek verrichtte en verantwoordelijk was voor het communiceren van de groepsstrategie naar klanten en de pers. Vervolgens was hij productspecialist en later portefeuillebeheerder binnen de vastrentende afdeling van ING.



Dr Urs Ramseier, Twelve Capital

Prior to co-founding Twelve Capital, Urs was Head of ILS at Horizon21, an alternative investment manager based in Pfäeffikon, Switzerland. He began his career in 1995 with Credit Suisse in Zurich before moving to London in 1996 to work for Credit Suisse Financial Products, where Urs became responsible for managing insurance company credit risk. He was also a member of the Global Credit Committee at Credit Suisse First Boston in Hong Kong. From 1999 to 2001, Urs worked for Lombard Odier & Cie in Geneva as a sell-side Equity Analyst for insurance and real estate stocks. In 2001, he rejoined Credit Suisse First Boston in Zurich as a buy-side Analyst and Portfolio Manager and assumed responsibility for all of Credit Suisse Asset Management's investments in European insurance stocks.

Urs holds a PhD from the University of Bern, where his major study was Economic Geography. His earlier studies were at the Institute de Sciences Politiques in Paris and the University of Bern.



Farid Kabbaj, KKL Partners

Farid Kabbaj is Partner bij KKL Partners, dat een holistische kijk heeft op portefeuillebeheer, gecombineerd met en een sterke visie over optimaal beleggen binnen de huidige markt en (toekomstige) regelgeving. Hiervoor was Farid werkzaam als Director Investment Strategy & Solutions bij Russell Investments, waar hij zich richtte op maatwerk beleggingsoplossingen voor diverse grote cliënten, zowel als strategisch adviseur als fiduciair beheerder. Bij JPMorgan zat Farid in de Insurance & Pension Group, met verantwoordelijkheid voor de Nederlandse markt. Hier richtte hij zich specifiek op risico management oplossingen op basis van economische, juridische en boekhoudkundige vereisten. Als actuaaris is Farid verder werkzaam geweest bij Milliman, Deloitte en Bacon & Woodrow, met een focus op ALM/ beleggings- en risicobeheer oplossingen.



Fons Lute, KKL Partners

Fons Lute is Partner bij KKL Partners. Voordat hij KKL Partners begon, was Fons Client Portfolio Manager bij Russell Investments, verantwoordelijk voor het adviseren van klanten in Noord Europa ten aanzien van multi-asset beleggingsstrategieën. Zijn eerdere ervaring omvat meerdere senior beleggingsfuncties in Nederland, waaronder die van Manager Director bij het OCIO team van BlackRock Solutions in Londen, Managing Director Alternative Strategieën bij PGGM en Chief Investment Officer bij Blue Sky Group.



Arthur Stroj, BMO Global Asset Management

Arthur Stroj (Londen/Amsterdam) is Client Portfolio Manager in het LDI-team. Hij is verantwoordelijk voor het portefeuille beheer van LDI mandaten. Arthur werkt sinds 2015 voor BMO GAM en werkte daarvoor 6 jaar als consultant bij Towers Watson. Arthur heeft een master in Quantitative Finance van de universiteit van Tilburg en een master in Actuarial Science van de TIAS business school. Hij is gekwalificeerd actuaaris (AAG) en heeft de FRM titel van GARP.



Daniel Brouwer, 4PP Audit

Daniël Brouwer is een ervaren audit professional met meer dan 15 jaar werkervaring in de financiële sector. Daniël heeft zijn basis gelegd bij KPMG in de audit praktijk en heeft zich vervolgens gespecialiseerd in Internal Audit. Hierbij heeft hij zich voornamelijk gespecialiseerd in pensioenfondsen.

Hij is oprichter en directeur van 4PP Audit. 4PP Audit richt zich op het invullen van (onderdelen) van de Interne auditfuncties en risicomanagementfuncties.

Daniël is Sleutelfunctiehouder Interne audit (Chief Audit Executive) bij vier pensioenfondsen en daarnaast is 4PP Audit vervuller bij nog eens vier pensioenfondsen. Daarnaast is hij actief op gebied van operationeel risicomanagement.

Daniël is tevens lid van de agenda commissie van het kennisplatform sleutelfunctiehouders van de Pensioenfederatie en lid van de agenda commissie van het Assurance Diensten platform van AZL.



Benjamin Versluijs, Northern Trust

Benjamin werkt sinds vier jaar bij Northern Trust. In deze tijd heeft hij bijgedragen aan enkele van onze grotere strategische opdrachten in de EMEA-regio. In zijn rol ondersteunt hij institutionele partijen, waaronder pensioenfondsen, in de ontwikkeling van toekomstgerichte modellen en datavoorzieningen, alsmede het optimaliseren van de financiële posities.

Benjamin is sinds 2003 werkzaam in de financiële industrie, waarbij zijn expertise ligt op het gebied van custody en investment accounting. Voordat hij bij Northern Trust kwam, heeft hij in diverse commerciële en relatiebeheerfuncties gewerkt bij financiële instellingen en de lokale depositarissen van Euroclear in Nederland, België en Frankrijk, alsmede hun hoofdkantoor Euroclear Bank in Brussel.



Christiaan Tromp, IPFOS

Christiaan heeft expertise en werkervaring op het gebied van fiduciair management, vermogensbeheer, integraal risicomanagement en treasury. Deze ervaring is opgedaan bij institutionele organisaties zoals: Avery Dennison, Mn Services, Atradius, Fortis Investment, Bpf Vervoer, Bpf Bakkers en de ANWB.

Christiaan is lid van diverse Raden van Toezicht en beleggingscommissies bij pensioenfondsen. Daarnaast is hij ook bestuurder en voorzitter van de beleggingscommissie bij pensioenfonds Atos.