

Klimastresstest auf Basis wissenschaftlicher Szenarien –
umsetzungsrelevante Neuerung ab 2024 trotz unklarer
Eintrittszeit, Schadenshöhe und Bewertung!



Institutsbezogene Klimastresstests zur Simulation von Umweltrisiken

Regulatorische Vorgaben • Integration von Klima-/ Umweltrisiken in
Risikotragfähigkeit • Analyse von Risikotreibern zur Szenario-Auswahl •
Simulation von Klimastresstests

- Prominente **Überführung** von **ESG-Risiken** in die **7. MaRisk-Novelle**: erhöhter Handlungsbedarf für LSI-Institute durch **umfangreiche Verpflichtungen** im Umgang mit Nachhaltigkeits-/ESG-Risiken **seit 2024**
- **Ergänzende** aufsichtliche **Anforderungen**: BaFin-Merkblatt, EZB-Leitfaden zu Klima- und Umweltrisiken, **neue EBA-Leitlinien** zu ESG, **Klimarisiko-Stresstest**, neue **Offenlegungspflichten** (u.a. EU-Taxonomie, Nachhaltigkeits-Reporting)
- **Klimarisiko-Assessment** als erster Schritt zum institutsbezogenen, steuerungsrelevanten Stresstest • Identifizierung von **Risikotreibern** und **Konzentrationen** – Wie wirken sich **physische** und **transitorische** Klima- und Umwelt-**Risikotreiber** auf verschiedene Risikoarten aus? • Festlegen von **ESG-Materialitätsschwellen** als Teil der Wesentlichkeitsanalyse
- **Abbildung** von Klima-/Umweltrisiken in **Geschäftsmodell** und **Geschäftsstrategie**: ESG-Risiken in **SWAT-Analyse** • **Risikobetrachtungshorizont** über 3 Jahre hinaus
 - Integration von **ESG-KPIs** ins Limitsystem?
- Geeignete **Bewertungskriterien/-kennzahlen**: Erfassung von (**Klimarisiko-)****Konzentrationen** im Portfolio • Darstellungsarten (z.B. Hochwasserkarte) bei Ermittlung **physischer** Risiken • Einsatz von „**Heatmaps**“?
- **Szenario-Gestaltung** für Klimastresstests: Was unterscheidet Klima- von klassischen Stresstests? • Nutzung wissenschaftlicher Szenarien der NGFS (Network for Greening the Financial System) • wertvolle Praxistipps zur Ausgestaltung **qualitativer** und Ausbau **quantitativer Klimarisiko-Szenarien**
- Auswirkungen von Klima-Stresstests auf **Kapitalplanung** in **normativer Risikotragfähigkeits-Perspektive**
- Voraussetzungen für eine **adressatengerechte** Abbildung der Klima- und Umweltrisiken im **Risikoreporting**

14:00 - 17:00 Uhr

Prof. Dr. Dirk Heithecker

Fachreferent Risikomanagement,
Risikotragfähigkeit und Nachhaltigkeit
Volkswagen Bank GmbH

Professur im Fachbereich Quantitative
Methoden & Corporate Finance an der
Hochschule Hannover. U.a.
Herausgeber des Handbuchs
„Nachhaltige Finanzwirtschaft“ und
Verfasser zahlreicher
Fachpublikationen.

(dazwischen 15 min. Pause)

Institutsbezogene Klimastresstests zur Simulation von Umweltrisiken

Ich melde mich an zu folgendem Seminar:

Institutsbezogene Klimastresstests zur Simulation von Umweltrisiken

25.06.2024 (SE2406060)



399,00 €*

Preise für TreuePlus Kunden	
Treue PLUS 15	339,15 €
Treue PLUS 20	319,20 €
Treue PLUS 25	299,25 €

Wenn Sie eine individuelle Beratung zum Thema benötigen, unterstützen wir Sie gerne, klicken Sie hier: <https://www.fch-gruppe.de/consult>

Wir haben Interesse an einem individuellen **Inhouse-Seminar** für unser Haus zu einem der oben genannten Seminarthemen.

Bitte kontaktieren Sie mich für weitere Informationen

Ich kann nicht am Seminar teilnehmen und bestelle deshalb die Seminarunterlagen als PDF zu den oben angekreuzten Seminaren (150,00 € *** je Semindokumentation)



Die **7. MaRisk-Novelle** verlangt trotz großer Komplexität **seit Anfang 2024** die Einführung und **Simulation** angemessener **Klimastresstests** zur Messung und Überwachung von **Nachhaltigkeits-** bzw. **ESG-Risiken**. Dies erfordert die Analyse/ **Bewertung von Risikofaktoren** in Bezug auf Klima- und Umweltrisiken, auf deren Basis Klimastresstests wissenschaftlich abzuleiten sind. Hierbei entstehen **methodische Herausforderungen** aufgrund **unsicherem Zeithorizont, Schadenshöhe und fehlender historischer Daten**. Zur **Klimarisikoanalyse** eignen sich v.a. **Stresstests**, Szenario- und Sensitivitätsanalysen **über mehrere Risikohorizonte** hinweg. Bei der Ausgestaltung **qualitativer** (nachvollziehbarer) und **quantitativer** (wissenschaftlich basierter) **Klimaszenarien** sind für Banken einige Besonderheiten zu beachten. Holen Sie sich wertvolle Praxistipps und Umsetzungserfahrungen.

25.06.2024 14:00 bis 17:00 Uhr

Der Zugang zum Seminar erfolgt über Ihren persönlichen Nutzerbereich in „MeinFCH“. Informationen zum Zugang und eine Anleitung erhalten Sie spätestens eine Woche vor dem Seminar. Ihre Teilnahmebestätigung und die Semindokumentation als PDF finden Sie ebenfalls unter „MeinFCH“.

Bei der Anmeldung gewähren wir ab dem zweiten Teilnehmer aus dem demselben Haus bei zeitgleicher Anmeldung einen **Rabatt von 20%**.

Sie erhalten nach Eingang der Anmeldung Ihre Anmeldebestätigung/Rechnung. Bitte überweisen Sie den Rechnungsbetrag innerhalb von 30 Tagen nach Zugang der Rechnung.

Eine Stornierung Ihrer Anmeldung ist nicht möglich. Eine kostenfreie Vertretung durch Ersatzteilnehmer beim gebuchten Termin dagegen schon. Der Name des Ersatzteilnehmers muss dem Veranstalter jedoch spätestens vor Seminarbeginn mitgeteilt werden. Wir weisen darauf hin, dass „Teilnahmen“ von anderen als den gebuchten Teilnehmern nicht gestattet sind und Schadensersatzansprüche des Veranstalters auslösen. Filmmitschnitt

Bei Absage durch den Veranstalter wird das volle Seminarentgelt erstattet. Darüber hinaus bestehen keine Ansprüche. Änderungen des Programms aus dringendem Anlass behält sich der Veranstalter vor.

Durch die Teilnahme am Seminar erhalten Sie 4 CPE-Punkte als Weiterbildungsnachweis für Ihre Zertifizierung

* zzgl. 19 % MwSt. ** inkl. 7 % MwSt. *** zzgl. 7 % MwSt.

Anmelden / Bestellen

Zum Thema

Termine / Ort

Teilnahmebedingungen

Name:

Vorname:

Position:

Abteilung:

Firma:

Straße:

PLZ/Ort:

Tel.:

Fax:

E-Mail:

Rechnung an:
(Name, Vorname)

(Abteilung)

E-Mail:

Bemerkungen:

Fach-/Produktinformationen und Datenschutz

Die FCH AG und ihre Dienstleister (z. B. Lettershop) verwenden Ihre personenbezogenen Daten für die Durchführung unserer Leistungen und um Ihnen ausgewählte Fach- und Produktinformationen per Post zukommen zu lassen. Sie können der Verwendung Ihrer Daten jederzeit durch eine Mitteilung per Post, E-Mail oder Telefon widersprechen.

Senden Sie mir bitte Fach- und Produktinformationen sowie die Banken-Times SPEZIAL für meinen Fachbereich kostenfrei an meine angegebene E-Mail Adresse (Abbestellung jederzeit möglich).

Senden Sie uns Ihre Bestellung per Mail an:
info@fch-gruppe.de

oder schriftlich an:

FCH AG
Im Bosseldorn 30, 69126 Heidelberg
Fax: +49 6221 99898-99

Weitere Informationen erhalten Sie unter:

+49 6221 99898-0
oder unter **www.FCH-Gruppe.de**