

Introduktion til klimarisikostyring i den finansielle sektor

Kursus i København

09.00 Velkomst og introduktion

09.15 1. Introduktion til styring af klimarisiko

- Risk Taxonomy
- Hvad kendetegner klimarisiko i den finansielle sektor?
- Fysisk risiko vs. transitionsrisiko
- ESG-risiko og klimarisiko
- IPCC's sjette rapport
- Paris-aftalen
- Net Zero i 2050
- Corporate Sustainability Reporting Directive (CSRD)
- Task Force on Climate-related Financial Disclosure (TCFD)
- Science-based Target
- Greenhouse Gas Protocol
- Scope 1, 2 and 3
- Partnership for Carbon Accounting Financial

10.45 Kaffepause

11.00 2. Risikostyring af klimarisiko

- Udfordringer med klimarisikostyring
- Risk Management Framework
 - Risikoappetit, Politikker, Strategi, Kultur, Dataudfordringer
- Kobling mellem klimarisiko og øvrige risici
- Myndighedernes forventninger
- Effektiv governance

12.00 Frokost

13.00 3. Transitionsrisiko

- Definition af transitionsrisiko
 - Lovgivning
 - Teknologiændringer
 - Adfærdsændringer
- Mapping af kunder/investeringer
- Transitionsdata
 - IEA (Stated Policy Scenario eller Sustainable Development Scenario)
 - Network for Greening the Financial System (de syv scenarier)
- Transmissionsmekanismen
- Workshop

14.00 Kaffepause

14.15 4. Fysisk risiko

- Definition af fysisk risiko
 - Akutte
 - Permanente
- Modellering af fysisk risiko
- Eksempel med KMV Moody's modellering af Probability of Default

15.00 5. Klimarisiko i porteføljeoptimering

- Hvordan indlejres klimarisiko i de tre optimeringspunkter?
 - Korrelation
 - Afkast
 - Risiko
- Skabelse af klimaoptimale porteføljer

16.00 Afslutning på kurset og evaluering

Pris

Prisen for kurset er DKK 7.000 ex moms. Prisen inkluderer kursusmateriale og forplejning.

