

seminář MĚŘENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK VE FINANČNÍCH INSTITUCÍCH

1. června 2023

Business Park Košíře, Jinonická 80, Praha 5

Seminář je zaměřen především na praktické aspekty měření environmentálních rizik v bankách a dalších finančních institucích. V úvodní části je představen kontext problematiky, vč. členění environmentálních rizik a jejich potenciálních dopadů na soukromé společnosti i banky. Seminář se následně zabývá principy, předpoklady a použitím jednotlivých metod měření environmentálních rizik, ať již se jedná o modelování budoucího vývoje a stresové testování, metriky přímo zachycující environmentální faktory, proxy ukazatele pro vystavení bank environmentálním rizikům nebo zohlednění v ratingu. V rámci semináře jsou představeny i relevantní regulační požadavky/očekávání a problémy, se kterými se lze při měření environmentálních rizik setkat.

CÍLOVÁ SKUPINA

Seminář je určen zejména risk managerům, specialistům zodpovědným za řízení rizik, pracovníkům z oddělení udržitelného rozvoje a řízení ESG rizik a interním auditorům. Cenné informace poskytnete také zaměstnancům velkých společností, které se měření environmentálních rizik věnují, ať již z důvodu vlastních interních analýz, splnění nároků na získání financování nebo požadavků stakeholderů.

PŘEDNÁŠEJÍCÍ

Mgr. Ing. Václav Novotný

ředitel, Advanced Risk Management, s.r.o.



Václav Novotný je ředitelem společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. Více než 20 let se specializuje na poradenství a školení v oblasti identifikace, měření a řízení finančních rizik.

V roce 1994 započal svou kariéru v investičním oddělení České pojišťovny, a. s. Je zakládajícím členem a předsedou sdružení Risk Management Klub a často zvaným lektorem na konferencích a seminářích uznávaných institucí.

Václav Novotný vystudoval Matematicko-fyzikální fakultu Univerzity Karlovy a Fakultu financí a účetnictví Vysoké školy ekonomické v Praze. S oběma vysokými školami dlouhodobě spolupracuje jako externí lektor.

TÉMATA SEMINÁŘE

Seminář se podrobně věnuje následujícím oblastem:

- › ÚVOD K ENVIRONMENTÁLNÍM RIZIKŮM
- › DOPAD ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK NA FIRMY A FINANČNÍ INSTITUCE
- › PRINCIPY MĚŘENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK
- › METRIKY
- › RIZIKOVÉ SEGMENTY
- › ZDROJE DAT A PROBLÉMY S NIMI SPOJENÉ
- › PRINCIPY KONSTRUKCE KLIMATICKÝCH MODELŮ
- › PRINCIPY KONSTRUKCE EMISNÍCH SCÉNÁŘŮ
- › ANALÝZY NAVAZUJÍCÍ NA KLIMATICKÉ MODELY
- › APLIKACE MODELŮ V PRAXI
- › REGULATORNÍ POŽADAVKY A OČEKÁVÁNÍ
- › ŘÍZENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK V BANCE

seminář

MĚŘENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK VE FINANČNÍCH INSTITUCÍCH

PRŮBĚH SEMINÁŘE

Seminář se koná od 9.00 do 17.00 (s přestávkami v 10.30, 12.30 a 15.15). Po skončení semináře následuje koktejl, na kterém je možné dále diskutovat.

PROGRAM SEMINÁŘE

ÚVOD K ENVIRONMENTÁLNÍM RIZIKŮM

- Základní pojmy
- Proces řízení rizik
- Klasifikace finančních rizik
- ESG rizika
- Zkratky a použité pojmy
- Použitá literatura

DOPAD ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK NA FIRMY A FINANČNÍ INSTITUCE

- Úvod do environmentálních rizik
- Riziko změn klimatu
- Ostatní environmentální rizika
- Fyzická rizika
- Přechodová rizika
- Změny v poptávce
- Reputační riziko
- Transmisní mechanismy
- Přímé a nepřímé dopady na finanční instituce

PRINCIPY MĚŘENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK

- Východiska
- Co a proč chceme vlastně měřit?
- Vstupní, mezivýstupní a skutečné výstupní proměnné
- Délka časového horizontu
- Metody měření

METRIKY

- Procesy spojené s definicí ukazatelů
- Environmentální faktory, indikátory a metriky
- Proxy ukazatele používané v bankách
- Metodologie ESG ratingů
- Zahrnutí environmentálních rizik v „klasickém“ (kreditním) ratingu

RIZIKOVÉ SEGMENTY

- Pohled na úrovni odvětví vs. pohled na úrovni expozice
- Odvětví obvykle označovaná jako rizikovější
- Ziskovost, rizikovost a atraktivita neudržitelných činností
- Ziskovost, rizikovost a atraktivita udržitelných činností

ZDROJE DAT A PROBLÉMY S NIMI SPOJENÉ

- Externí data
- Interní data
- Okruhy emisí skleníkových plynů
- Problémy spojené s daty používanými pro měření environmentálních rizik

PRINCIPY KONSTRUKCE KLIMATICKÝCH MODELŮ

- Východiska
- Konstrukce klimatického modelu
- Emisní a koncentrační scénáře
- Zpětné vazby a další předpoklady
- Výstupy modelů
- Posouzení kvality modelů
- Shrnutí hlavních závěrů z aktuálně používaných modelů IPCC
- Spolehlivost modelů
- Model risk

PRINCIPY KONSTRUKCE EMISNÍCH SCÉNÁŘŮ

- Východiska: simulace ekonomických aktivit
- Simulace politicko-společenských reakcí
- Výstup: emisní scénáře

ANALÝZY NAVAZUJÍCÍ NA KLIMATICKÉ MODELÝ

- Východiska
- Typy analýz a jejich využití (ukazatele odvozené z klimatických modelů)
- Přehled postupů používaných v rámci analýz

APLIKACE MODELŮ V PRAXI

- Vědecká komunita
- Státy a mezinárodní organizace
- Soukromé podniky
- Finanční instituce
- Centrální banky a jejich modely („stresové testování“)
- ECB climate risk stress test 2022

REGULATORNÍ POŽADAVKY A OČEKÁVÁNÍ

- Přehled regulací a norem v EU
- Mezinárodní standardy
- Klasifikace expozic z hlediska udržitelnosti (EU Taxonomy a TSC)
- Specifické požadavky na banky a dohledová očekávání
- Ukazatele používané při reportingu E rizik

ŘÍZENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK V BANCE

- Přístupy bank k E problematice
- Začlenění environmentálních aspektů do cílů a strategie banky
- Posouzení materiality
- Systém limitů a KPI
- Dopad na cenotvorbu
- Další činnosti v bance související s E problematikou

SHRnutí SEMINÁŘE A Závěr

seminář

MĚŘENÍ ENVIRONMENTÁLNÍCH RIZIK VE FINANČNÍCH INSTITUCÍCH

REFERENCE

Allianz - Slovenská dôchodková
správovská spoločnosť, a.s.

Air Bank a.s.

Artesa, spožitelní družstvo

Aviva životní pojišťovna, a.s.

BNP PARIBAS PERSONAL FINANCE SA,
pobočka zahraničnej banky

CENTRAL EUROPEAN ADVISORY GROUP

Čepro, a.s.

ČEPS, a.s.

Česká exportní banka, a.s.

Česká národní banka

Česká podnikatelská pojišťovna, a.s.

Česká spořitelna, a.s.

Česká spořitelna – penzijní společnost, a.s.

Českomoravská hypoteční banka, a.s.

Českomoravská stavební spořitelna, a.s.

Československá obchodní banka, a.s.

ČEZ, a.s.

Direct pojišťovna, a.s.

Dopravní podnik hl. m. Prahy, akciová společnost

E.ON Česká republika, s.r.o.

Equa bank a.s.

Erste & Steiermärkische Bank d.d.

Erste Asset Management GmbH,
pobočka Česká republika

Exportní garanční a pojišťovací společnost, a.s.

Ezpada s.r.o.

Generali Česká pojišťovna a.s.

Hypoteční banka, a.s.

Komerční banka, a.s.

Kooperativa pojišťovna, a.s.

KPMG Česká republika, s.r.o.

ING Bank N.V.

Investiční kapitálová společnost KB, a.s.

J&T Banka, a.s.

KB Penzijní společnost, a.s.

Leasing České spořitelny, a.s.

Modrá pyramida stavební spořitelna, a.s.

Moneta Money Bank, a.s.

Moravia IT, a.s.

Národní banka Slovenska

Národní rozvojová banka, a.s.

NESS Czech s.r.o.

NET4GAS, s.r.o.

Nova KBM d.d.

OTP Banka Slovensko, a.s.

Penzijní fond České pojišťovny, a.s.

Pojišťovna České spořitelny, a.s.

Poštová banka, a.s.

PPF banka a.s.

Pražská energetika, a.s.

Pražská plynárenská, a.s.

Prima banka Slovensko, a.s.

Raiffeisen stavební spořitelna a.s.

Raiffeisenbank a.s.

Scania Finance Czech Republic, spol. s r.o.

SG Equipment Finance Czech Republic s.r.o

SKB banka d.d. Ljubljana

Slovenská banková asociácia

Slovenská sporiteľňa, a.s.

Slovenský plynárenský priemysel, a.s.

Slovnaft, a.s.

STABILITA, d.d.s., a.s.

ŠkoFIN, s.r.o.

Tatra banka, a.s.

TRINITY BANK a.s.

UniCredit Bank Czech Republic and Slovakia, a.s.

Unipetrol, a.s.

Všeobecná úverová banka, a.s.

Zentiva, a.s.

Železničná spoločnosť Slovensko, a.s.

Věříme, že naše semináře budou, stejně jako minulým účastníkům, užitečné i vám.

ORGANIZAČNÍ INFORMACE K SEMINÁŘI

Přihlášení Na seminář se můžete přihlásit na našich webových stránkách www.arm.cz/prihlaska nebo e-mailem na adresu arm@arm.cz. Přijetí přihlášky vám potvrdíme zasláním e-mailu.

Poplatek Účastnický poplatek za seminář činí 9 900 Kč + DPH. Poplatek za seminář zahrnuje kurzové, studijní materiály, kompletní celodenní občerstvení včetně obědů.

Po přihlášení bude vystavena zálohová faktura. Platba (provedena před termínem konání akce) je zálohou ve výši 100 % sjednaného poplatku. Daňový doklad obdrží účastník po zaplacení zálohové faktury nebo po skončení semináře poštou. Platby poukazujte na účet společnosti Advanced Risk Management, s.r.o. číslo 13923349/0800 vedený u České spořitelny, a.s. na základě zaslání zálohové faktury.

Storno podmínky Účast na semináři lze zrušit pouze písemně. V případě odhlášení nejpozději 3 týdny před

zahájením akce bude účtován stornovací poplatek ve výši 10 % z uhrazené ceny. Při zrušení objednávky v době kratší než 3 týdny před zahájením akce je splatný celý účastnický poplatek bez náhrady. Organizace může vyslat na tento seminář jiného účastníka, než který byl původně přihlášen.

Advanced Risk Management, s.r.o. si vyhrazuje právo zrušit pořádání semináře a vrátit účastníkům zpět celou uhrazenou zálohu. Přihlašující organizace i účastník berou na vědomí, že svým přihlášením akceptují všechny výše uvedené podmínky.

Ochrana osobních údajů Advanced Risk Management, s.r.o. primárně pracuje s údaji, které jsou poskytnuty v rámci objednávky služeb. Jedná se zejména o následující údaje: e-mail, jméno a příjmení (případně akademický titul), kontaktní (doručovací a/nebo fakturační adresa), telefonní číslo a pracovní pozice.

Přehled základních zásad a principů ochrany osob-

ních údajů a dalších údajů zpracovaných společností Advanced Risk Management, s.r.o. naleznete na webové stránce společnosti www.arm.cz (Informace a přístup k osobním údajům).

Ostatní ujednání Advanced Risk Management, s.r.o. informuje účastníky, že na seminářích či jiných akcích pořizuje fotografie, které účastníky zachycují při účasti na seminářích a akcích. Společnost Advanced Risk Management, s.r.o. tyto fotografie poskytuje pouze ostatním účastníkům stejné akce, neposkytuje je třetím osobám a ani je nezveřejňuje. Účastníci mohou požádat, aby focení nebylo nebo aby jejich fotografie byly smazány a Advanced Risk Management, s.r.o. musí jejich požadavek dodržet.

 Chcete-li se během semináře zaměřit na vybrané téma nebo řešit v rámci případových studií konkrétní problém, napište nám prosím svůj návrh e-mailem na adresu arm@arm.cz.

Advanced Risk Management, s.r.o.

Paříkova 3

190 00 Praha 9

t +420 257 290 252

e arm@arm.cz

i www.arm.cz

IČO 26140403 • DIČ CZ26140403 • Městský soud v Praze, oddíl C, vložka 73787

