

- Thema:** Integration von Klimarisiken in die Risikomessung unter Solvency II
- Zielgruppe:** Diese Websession richtet sich an Aktuare mit Bezug zu Risikomessung und -steuerung auf Basis von Solvency II.
- Beschreibung:** Spätestens seit dem Vertrag von Paris ist der Klimawandel auch im Fokus der politischen Aufmerksamkeit. Maßnahmen und Initiativen der EU-Kommission in Bezug auf die Ökologisierung des Finanzsystems haben dazu geführt, dass Finanzaufsichten Klimarisiken für Banken und Versicherungen stärker in den Blick nehmen.
- Im Rahmen von Solvency II bedeutet dies die Notwendigkeit einer quantitativen Risikobewertung mindestens in Säule II (ORSA). Darüber hinaus scheint eine Berücksichtigung von Klimarisiken in die Berechnung des Solvenzkapitals in naher Zukunft zumindest für Nutzer eines Interne Modells unabdingbar.
- In diesem Webinar wird ein konkreter Ansatz zur Integration von Klimarisiken in Interne Modelle vorgestellt. Der vorgestellte Ansatz basiert auf Bewertungsmethoden, die aus dem aktuellen Stand der Forschung heraus entwickelt wurden, unter Berücksichtigung jüngste Stellungnahmen europäischer Aufsichtsbehörden.
- Zunächst werden allgemeinen Grundsätze und Paradigmen der Bewertung von Klimarisiken diskutiert. Darauf aufbauend wird eine szenarienbasierte Wertermittlung entwickelt, die auch für ORSA-Zwecke geeignet ist. Schließlich werden der Ansatz und seine Auswirkungen mit einem realistischen Fallbeispiel illustriert.
- Referenten:** Dr. Mario Zacharias & Daniel Teetz  
(Oliver Wyman Actuarial Services)
- Termin/Uhrzeit:** 30. Oktober 2020, 10:00 – 12:00 Uhr  
2 Netto-Weiterbildungsstunden
- Kosten:** 100,00 €/120,00 € Mitglieder/Nicht-Mitglieder zzgl. MwSt.