

## Extrait de la « Revue de l'ACPR » numéro 33 (juin - juillet 2017)

### Rubrique études

Dans le cadre du suivi du rapport associant, la direction générale du Trésor, la Banque de France et l'ACPR sur le secteur bancaire face au changement climatique – [http://www.tresor.economie.gouv.fr/15823\\_le-secteur-bancaire-face-au-changement-climatique](http://www.tresor.economie.gouv.fr/15823_le-secteur-bancaire-face-au-changement-climatique) -, un atelier international sur le thème des « stress-tests et changement climatique » s'est tenu à l'ACPR le 14 juin. Organisé par la direction des Études de l'ACPR et la direction de la Stabilité financière de la Banque de France, l'atelier a réuni plus de 70 personnes, universitaires, représentants des banques centrales et des autorités de supervision bancaires, assureurs et membres d'associations ou experts du risque climatique.

Stefano Battiston (université de Zürich) a présenté ses travaux sur le risque de contagion au sein du système bancaire lié au changement climatique, en mesurant l'impact des politiques qui pourraient être mises en place pour gérer la transition énergétique, et en mobilisant une riche base de données sur les participations croisées entre les institutions (banques, assurances, gestionnaires d'actifs) et des analyses de réseaux. Carsten Jung et Nicolas Pondard de la Prudential Regulation Authority (Banque d'Angleterre) ont présenté la stratégie de la Banque d'Angleterre sur la transition climatique et leurs travaux sur les stress-tests climatiques en assurance, notamment s'agissant du risque de catastrophes naturelles. Tijmen Daniëls de la Banque centrale des Pays-Bas a évoqué les projets de stress-tests qui pourraient être mis en œuvres le domaine bancaire, dans un pays caractérisé par un usage intensif des énergies fossiles et exposé au risque physique (digues). Enfin, Grégoire Hug (BNP Paribas Securities Service) a présenté ses travaux sur la gestion des expositions du portefeuille d'actions au changement climatique.

Cet atelier s'est poursuivi par des réunions qui se sont tenues à l'ACPR sur la gestion du risque climatique dans les banques le 3 juillet et les organismes d'assurance le 7 juillet. Les établissements ont pu à cette occasion échanger sur les meilleures pratiques internes ainsi que les travaux pour mieux appréhender la mesure des expositions au risque climatique.



Tijmen Daniëls de la Banque centrale des Pays-Bas.