

Kommissorium for risikoudvalget i ATP

1. Etablering og formål

- 1.1 ATP har etableret et risikoudvalg under ATP's bestyrelse med virkning fra den 7. februar 2019.
- 1.2 Udvalget nedsættes i henhold til forretningsorden for ATP's bestyrelse.
- 1.3 Udvalget er nedsat med henblik på at understøtte bestyrelsens ORSA-hjul og dermed opgaven med at foretage vurdering af egen risiko og solvenssituation (ORSA).
- 1.4 Udvalget skal drøfte centrale emneområder i relation til ORSA-hjulet, der – som følge af kompleksitet, omfang m.v. – med fordel kan undergives yderligere og mere detaljeret behandling.
- 1.5 Udvalget skal bidrage til at skabe det bedst mulige grundlag for, at bestyrelsen kan varetage sine opgaver.



2. Medlemskab

- 2.1 Udvalgets medlemmer består af fire medlemmer af ATP's bestyrelse. Udvalgets medlemmer og formand udpeges af ATP's bestyrelse.
- 2.2 Udvalget er funktionsdygtigt, når mindst tre medlemmer er til stede.

3. Mødestruktur og frekvens

- 3.1 Møder afholdes så ofte, som formanden for risikoudvalget finder nødvendigt og som udgangspunkt fire gange årligt.
- 3.2 Risikoudvalget fastsætter et årshjul for sine opgaver. Årshjulet afstemmes med bestyrelsens årshjul.
- 3.3 Risikoudvalget er forbeholdende for bestyrelsen, og udvalgets møder lægges så vidt muligt forud for bestyrelsesmøderne i ATP. Når formanden og mindst to andre medlemmer af risikoudvalget er til stede, kan risikoudvalget indstille forslag til beslutning i bestyrelsen.
- 3.4 Udvalget vedligeholder en liste over potentielle fremtidige emner til drøftelse på udvalgs møder i tillæg de emner og opgaver, som er henlagt til udvalget i henhold til årshjulet, jf. pkt. 3.2.
- 3.5 På hvert møde sikrer udvalget, at der er truffet valg om emner til drøftelse på det næstkommende møde.
- 3.6 Udsendelse af dagsorden med bilag sker så vidt muligt senest 7 dage inden mødets afholdelse, medmindre andet er aftalt.
- 3.7 Risikoudvalget fastlægger mindst en gang årligt datoer for møderne i den kommende 24 måneders periode.
- 3.8 Risikostyringsfunktionen er sammen med ATP's Chief Risk Officer ansvarlig for planlægning, koordinering af materiale samt rapporteringer til risikoudvalget. Risikostyringsfunktionen varetager desuden sekretariatsfunktionen for udvalget.

4. Bemyndigelse og ressourcer

- 4.1 Udvalget har bemyndigelse til at undersøge alle forhold inden for rammerne af kommissoriet, herunder at indhente de nødvendige oplysninger og assistance fra ATP's direktør og medarbejdere i ATP Koncernen.
- 4.2 Risikoudvalget refererer og indstiller til bestyrelsen. Herudover kan udvalget komme med råd og vejledning til de emnekredse, der i øvrigt undergives behandling.
- 4.3 Relevante medarbejdere er forpligtet til at deltage i møder, hvis de indkaldes af udvalget.

5. Opgaver

- 5.1 Udvalget har til opgave at drøfte centrale emneområder i relation til ORSA-hjulet. Eksempler på overordnede emneområder, der følger af ORSA-hjulet er:

- *Risikoidentifikation* – er der nye risici eller kendte, der skal have ny opmærksomhed?
- *Risikoappetit* – retningslinjer og rammer for risici samt arbejdet hermed, herunder også arbejdet med informationsikkerhed
- *Kvantificering* – måling af ATP's risici, principper for værdiansættelse af større aktiver, engagementer og hensættelserne
- *Governance og organisering* – ATP's interne kontrolsystem, governance og risikostyringssystem
- *Risiko- og solvensvurdering* – vurderingen af risiko og solvenssituationen i ATP (kvantitativt) og vurdering af risikostyringssystemet.

Udvalget vedligeholder, jf. pkt. 3.4, en liste over potentielle fremtidige emner, der ønskes undergivet en mere detaljeret behandling. Listen vil indeholde specifikke emner, der hver især kan henføres til én eller flere af de nævnte overordnede emneområder.

5.2 Udvalget skal løfte opgaver, som ATP's bestyrelse i øvrigt ønsker udført af udvalget.


6. Rapportering

- 6.1 Fra risikoudvalgets møder optages referat. Formanden leder risikoudvalgets møder. Referater fra udvalgets møder godkendes af udvalgets medlemmer og journaliseres efterfølgende. Formanden er ansvarlig for, at der føres referat fra risikoudvalgs møder.
- 6.2 Referater fra risikoudvalgets møder er sammen med det øvrige materiale tilgængeligt for bestyrelsen.
- 6.3 Udvalget informerer bestyrelsen på førstkommande bestyrelsesmøde om udført arbejde og væsentlige konklusioner fra hvert møde i risikoudvalget.

7. Evaluering

- 7.1 Udvalget gennemgår og vurderer årligt, og efter behov når det vurderes hensigtsmæssigt, at nærværende kommissorium for risikoudvalget er ajourført og betryggende og foretager indstilling om ændringer heri til bestyrelsen.

Vedtaget af ATP's bestyrelse på bestyrelsesmødet den 12. december 2018 – kommissoriet er gældende fra den 7. februar 2019.



Torben M. Andersen
bestyrelsesformand