



## SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

Viale delle Milizie, 1 - 00192 Roma - Tel.: 06 3202922  
E-mail: [info@sia-attuari.it](mailto:info@sia-attuari.it)

Roma, 23 settembre 2020

**Prot. n. 007/20**

Cari colleghi,

siamo lieti di comunicarvi che, in continuità con la formazione a distanza dato il perdurare dell'emergenza sanitaria, sono aperte le iscrizioni al 4° corso del 2020 dal titolo: **“La riforma di Solvibilità II 2020 con particolare attenzione alle assicurazioni vita”**. Il corso si terrà **giovedì 15 ottobre 2020 in diretta web**.

Ricordiamo che è possibile iscriversi anche online direttamente dal nostro sito: [www.sia-attuari.it](http://www.sia-attuari.it).

Qualche giorno prima del corso, gli iscritti riceveranno, via mail, un link per il collegamento con una sala virtuale, con possibilità d'interazione con il docente. **Il collegamento, non richiede nessuna installazione di software.**

Il corso si rivolge agli attuari e ad altre figure professionali dotate di conoscenze tecnico-attuariali nel campo delle assicurazioni vita e dei bilanci assicurativi di solvibilità; si propone di illustrare le novità che prevedibilmente saranno introdotte dal 2022 o 2023 in Solvency II. Si tratta del secondo passo della rivisitazione del regolamento comunitario (n. 35/2015) voluto dalla Commissione Europea (lettera 11/02/2019) e che vede coinvolti l'autorità di vigilanza europea EIOPA e diversi stakeholders europei, a partire dalle imprese di assicurazione.

### **Presentazione del corso**

Data la vastità della materia trattata dalla riforma, il corso si concentra sulle aree dove sono tipicamente coinvolti gli attuari in Europa; peraltro queste materie sono quelle che avranno impatto economico in quanto cambieranno il calcolo delle riserve, il calcolo del requisito di capitale, il patrimonio netto. Particolare risalto verrà dato sulle possibili alternative di metodo di calcolo dell'aggiustamento di volatilità.

Il materiale è scritto in inglese e verrà esposto in italiano

### **Docente**

La docenza è tenuta dal dott. Luca Bianchi (Gruppo Aviva. Responsabile della Funzione Attuariale).

### **Programma**

#### **Prima Parte**

##### **Vista delle 19 aree di emendamenti**

#### **Seconda parte**

##### **Primo gruppo di modifiche**

Dynamic Volatility Adjustment per la formula standard  
Buffer sul patrimonio netto

Carriers per il risk margin  
Riassicurazione non proporzionale (GI)



Investimenti azionari di lungo periodo  
Rischio di tasso di interesse e aggiustamento di volatilità. Caratteri generali  
Estrapolazione della curva tassi  
Rischio di tasso di interesse

### **Volatility adjustment**

Volatility Adjustment nell'holistic impact assessment  
Volatility adjustment. Le soluzioni alternative originarie  
Rischio di tasso di interesse e correlazione con il rischio spread

### **Secondo gruppo di modifiche**

Uso di misure di lungo periodo  
SRMP, LRMP, recovery and resolution (accenni)  
Aree che non saranno toccate dalla riforma  
Rischio decadenza  
Finite reinsurance  
Proporzionalità (accenno)  
Reporting and Disclosure (accenni)

### **Riserve tecniche Vita**

EPIFP  
Contract Boundaries  
Management actions  
Calibrazione degli scenari ESGs  
Trattamento delle spese ricorrenti  
Trattamento del comportamento dinamico dei clienti assicurati  
Tasso di inflazione

### **Terzo gruppo di modifiche**

Rischio di controparte  
Transizione per il trattamento di titoli governativi che non emettono nella propria divisa  
MCR

**Ao**

### **Proposte dell'ESRB**

**Riserve tecniche dopo la riforma della solvibilità II a confronto delle riserve tecniche IFRS17: dove permarranno differenze**



Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come stabilito dalle Linee Guida emanate dal Consiglio Nazionale degli Attuari in attuazione del regolamento sulla Formazione Attuariale Continua, redatto ai sensi dell'art. 7 comma 3 del D.P.R. N. 137/2012, pubblicato in gazzetta dal Ministero di Giustizia in data 30 dicembre 2018, saranno attribuiti **5 (cinque) CFP ai fini FAC** (Formazione Attuariale Continua).

Si allega la scheda di iscrizione che dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.A. entro **martedì 12 ottobre 2020.**

Con l'auspicio che anche questo corso possa dare luogo ad una intensa partecipazione, si inviano cordiali saluti.

Il Presidente  
(Giampaolo Crenca)



***Segreteria operativa:***

S.I.A. s.r.l. - Viale delle Milizie 1 - 00192 Roma

E-mail: [info@sia-attuari.it](mailto:info@sia-attuari.it)

Federica Campanini

***Orario:***

**Giovedì 15 ottobre 2020**

**09.15 – 09.30** Registrazione

09.30 – 11.00 Lezione

11.00 – 11.15 Pausa

11.15 – 13.00 Lezione

13.00 – 14.00 Intervallo

14.00 – 15.30 Lezione

15.30 – 15.45 Pausa

15.45 – 17.15 Lezione

***Numero dei partecipanti:***

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 70 unità, ammessi secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda.

***Iscrizioni:***

Ci si può iscrivere direttamente sul nostro sito [www.sia-attuari.it](http://www.sia-attuari.it) oppure inviando la scheda allegata alla segreteria della S.I.A. all'indirizzo email: [info@sia-attuari.it](mailto:info@sia-attuari.it), **entro martedì 12 ottobre 2020. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostra email.**

***Quota di iscrizione:***

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 450,00 + IVA**. La quota dà diritto alla partecipazione ai lavori, al materiale didattico, alle due pause caffè giornaliere.

***Modalità di pagamento:***

**Il versamento della quota di iscrizione, da effettuarsi successivamente alla nostra conferma, dovrà pervenire entro e non oltre l'inizio del corso, con l'evidenza del corrispondente numero di fattura.**

Eventuali rimborsi per impedita partecipazione saranno consentiti nella misura dell'80% se la mancata partecipazione sarà comunicata per iscritto almeno 2 giorni prima dell'inizio del corso.



## 4° CORSO DI FORMAZIONE PERMANENTE 2020

sul tema

**“La riforma di Solvibilità II 2020 con particolare attenzione alle assicurazioni vita”**

**Giovedì, 15 ottobre 2020 – Diretta Web**

IL SOTTOSCRITTO (Dott., Prof., Sig.) .....

ATTUARIO:  - OPERATORE FINANZIARIO:  - INTERMEDIARIO:  - ALTRO:

INDIRIZZO .....

CAP ..... CITTA' ..... PROV.....

TELEFONO ..... E-MAIL del partecipante.....

SOCIETA' O ENTE DI APPARTENENZA.....

Intende partecipare al 4° Corso 2020 di Formazione Attuariale Permanente in diretta web. Al tal fine effettua il pagamento della quota di iscrizione mediante versamento sul c/c BNL: **IBAN: IT88F 01005 03240 00000 0021725 intestato alla S.I.A. s.r.l.**

La fattura va intestata a: .....

Indirizzo ..... **Codice Univoco SDI** .....

CAP ..... CITTA' ..... PROV.....

Partita IVA n. .... Cod. Fisc. ....  
(si prega di indicare sia partita IVA che codice fiscale anche se coincidenti)

La fattura va inviata a (email): .....

**INDICARE SE LA FATTURA DEVE ESSERE IN REGIME DI SPLIT PAYMENT SI'  NO**

Data

FIRMA

### **Oggetto: Informativa ai sensi del Regolamento EU 2016/679**

Questa informativa viene fornita ai sensi dell'art. 13 del Regolamento EU 2016/679 (di seguito anche Regolamento); secondo la legge indicata, tale trattamento sarà improntato ai principi di correttezza, liceità e trasparenza e di tutela della Sua riservatezza e dei Suoi diritti.

Pertanto, Sviluppo Iniziative Attuariali S.r.l. (in seguito anche SIA) con sede in Viale delle Milizie, 1 - 00192 Roma, Titolare del trattamento, La informa che il trattamento dei suoi dati, realizzato con strumenti automatizzati e manuali adottando misure di sicurezza tali da garantire la tutela e la massima riservatezza dei dati trattati, è effettuato per lo svolgimento delle seguenti attività:

1. la sua iscrizione e partecipazione al corso di formazione, nonché l'esecuzione di attività connesse alla sua partecipazione (p.e. gestione ed organizzazione dell'evento formativo, gestione ed organizzazione dell'aula) e per l'esecuzione delle attività amministrative, fiscali e contabili collegate; la base giuridica del trattamento è il contratto e l'esecuzione dei servizi richiesti dall'interessato. Il conferimento dei dati è necessario e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di perseguire le finalità menzionate;
2. l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi; la base giuridica per lo svolgimento di queste attività si fonda sul conferimento del consenso. Il conferimento dei dati è facoltativo e in sua mancanza il Titolare non potrà realizzare le relative attività. Lei ha il diritto di revocare il consenso in qualsiasi momento. La revoca del consenso non pregiudica la liceità del trattamento in base al consenso da lei fornito prima del ritiro.

I dati relativi allo svolgimento delle attività di cui al punto 1. saranno conservati per tutto il tempo necessario alla gestione dell'evento.

I dati relativi allo svolgimento delle attività promozionali e di marketing (di cui al punto 2) saranno conservati per 24 mesi dall'invio dell'ultima comunicazione.

I dati, che non saranno diffusi, potranno essere comunicati ai professionisti e alle aziende che, per nostro conto, svolgono le attività di gestione contabile e fiscale, a soggetti terzi per l'esecuzione di attività collegate alla gestione e organizzazione dell'evento formativo e a soggetti cui la facoltà di accedere ai dati sia riconosciuta da disposizioni di legge e/o di normativa secondaria. La informiamo, infine, che potrà esercitare i diritti contemplati dal Regolamento, scrivendo a [info@sia-attuari.it](mailto:info@sia-attuari.it). Lei potrà pertanto chiedere di avere conoscenza dell'origine dei dati nonché della logica e delle finalità del Trattamento; di ottenere la cancellazione, la trasformazione in forma anonima o il blocco dei dati trattati in violazione di legge, nonché l'aggiornamento, la rettifica o, se vi è interesse, l'integrazione dei dati stessi; di opporsi, per motivi legittimi, al trattamento. È garantito il diritto a revocare il consenso in qualsiasi momento senza pregiudicare la liceità del trattamento basata sul consenso prestato prima della revoca. È garantito il diritto alla portabilità dei dati, a proporre reclamo a un'autorità di controllo.

**Il Titolare del trattamento**  
**Sviluppo Iniziative Attuariali S.r.l.**

**Consenso al trattamento dei dati personali**

Il/La sottoscritto/a ..... conferma di aver letto con attenzione l'informativa su esposta e conferisce il consenso al trattamento dei propri dati personali per l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;

Data .....

Firma .....