



SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

Viale delle Milizie, 1 - 00192 Roma - Tel.: 06 3202922, fax 06 3210250
E-mail: info@sifa-attuari.it

Roma, 26 settembre 2017

Prot. n. 022/17

Siamo lieti di informarvi che sono aperte le iscrizioni al 5° corso 2017 di formazione permanente dal titolo: **“Data quality (Vita) con particolare attenzione agli adempimenti secondo Solvency II”**. Il corso si terrà a **Milano il 24 e 25 ottobre 2017** presso Hotel Michelangelo Via Scarlatti, 33 - 20124 Milano.

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; si propone di illustrare la normativa sui controlli dei dati che riguardano le riserve tecniche, come introdotto dalla Solvibilità II. La qualità del dato è essenziale: valutare correttamente le riserve tecniche non dipende soltanto da formule ed equazioni. La qualità del dato la si deve intendere sotto tre diverse accezioni. La prima riguarda i data base utilizzati per la costruzione preliminare delle assunzioni e parametri utilizzati per il calcolo delle riserve; la seconda riguarda i dati dei portafogli assicurativi - polizza per polizza - e quelli che rappresentano gli investimenti; la terza riguarda proprio i risultati finali, ossia i valori delle riserve tecniche imputate nei vari tipi di bilancio (Solvency II, IFRS e Locale).

Obiettivi del corso

La qualità dei dati riguarda la redazione dei bilanci locale, IFRS e di Solvibilità II. La necessità di disporre di dati sui portafogli attivi e passivi che siano corretti non è una novità. Tuttavia con la Solvibilità II il tema è diventato più specifico ed è normato sia a livello comunitario che a livello locale. La normativa di Solvibilità tratta di qualità del dato specificamente per le riserve tecniche, per il modello interno e per i parametri specifici d'impresa (calcolo del SCR). Questo corso tratta della qualità dato con riferimento alle riserve tecniche vita. Si parte dalla normativa per proseguire con le tecniche di controllo dove non si può prescindere dal considerare il legame fra la valutazione delle riserve e la predisposizione del bilancio. La presentazione è in italiano sulla base di materiale scritto in lingua inglese.

Docente

Dott. Luca Bianchi (Manager nel Risk e nella Funzione Attuariale - Gruppo Aviva).

Programma

1. Prima parte

- 1.1 Regolamento IVASS 18. Riferimenti diretti alla qualità dei dati in Solvency II
- 1.2 Dati interni ed esterni per le assunzioni alla base del calcolo delle riserve tecniche
- 1.3 Assunzioni secondarie ed assunzioni non ammesse al calcolo delle riserve tecniche



2. Seconda parte

Regolamento IVASS 18: riferimenti indiretti alla qualità dei dati

- a. L' "Health similar to Life"
- b. HRG e segmentazione
- c. Coerenza nell'utilizzo delle ipotesi economiche e non economiche
- d. Variabili biometriche stocastiche
- e. Spese future
- f. Opzioni contrattuali e garanzie finanziarie
- g. Comportamento dinamico dei clienti
- h. Azioni future di management sui portafogli attivi e passivi
- i. Proporzionalità e semplificazione
- j. Prezzo unitario delle quote unit linked
- k. Scorporo
- l. Premi futuri
- m. L' EPIFP
- n. Trattamento contabile dei premi
- o. Somme da pagare
- p. Validazione (cenni)

3. Terza parte

- 3.1 Validazione attraverso l' "experience variance"
- 3.2 Accuratezza, completezza e appropriatezza
- 3.3 Documentazione sulle riserve tecniche
- 3.4 Il controllo del dato tramite l' analisi delle variazioni delle riserve tecniche

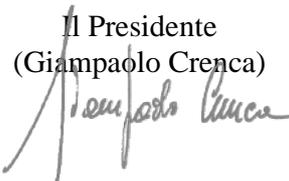
4. Quarta parte

- 4.1 Il controllo dei dati tramite l' analisi di sensitività
- 4.2 Il controllo del dato polizza per polizza
- 4.3 Il controllo delle riserve nelle proiezioni del PLAN e del Report ORSA
- 4.4 Coerenza fra SCR e riserve tecniche
- 4.5 Controlli specifici nel bilancio IFRS
- 4.6 Controlli specifici nel bilancio locale

La partecipazione al corso dà diritto all'acquisizione di 8 CFP.

Si allega la scheda di iscrizione che dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.A. entro **mercoledì 18 ottobre 2017.**

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

Il Presidente
(Giampaolo Crenca)




Sede del corso:

Hotel Michelangelo
Via Scarlatti, 33
20124 Milano

Segreteria operativa:

S.I.A. s.r.l. - Viale delle Milizie 1 - 00192 Roma
Tel. 06.3202922, fax 06.3210250, E-mail: info@sia-attuari.it
Federica Campanini

Orario:

Martedì 24 ottobre 2017

09.15 – 09.30 Registrazione
09.30 – 11.00 Lezione
11.00 – 11.15 Pausa caffè*
11.15 – 13.00 Lezione
13.00 – 14.00 Intervallo
14.00 – 15.30 Lezione
15.30 – 15.45 Pausa caffè*
15.45 – 17.15 Lezione

* Presso Hotel Michelangelo

Mercoledì 25 ottobre 2017

09.30 – 11.00 Lezione
11.00 – 11.15 Pausa caffè*
11.15 – 13.00 Lezione
13.00 – 14.00 Intervallo
14.00 – 15.30 Lezione
15.30 – 15.45 Pausa caffè*
15.45 – 17.15 Lezione

Numero dei partecipanti:

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 25 unità, ammessi secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda.

Iscrizioni:

La scheda allegata va inviata alla segreteria della S.I.A. s.r.l., Viale delle Milizie 1, 00192 Roma, tramite fax o email, **entro mercoledì 18 ottobre 2017. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostra email.**

Quota di iscrizione:

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 1.000,00 + 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.



5° CORSO 2017 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

“Data quality (Vita) con particolare attenzione agli adempimenti secondo Solvency II” Milano, 24 e 25 ottobre 2017

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

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

INDIRIZZO.....

CAP CITTA' PROV.....

TELEFONO FAX E-MAIL

SOCIETA' O ENTE DI APPARTENENZA.....

Intende partecipare al 5° Corso 2017 di Formazione Attuariale Permanente. 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:

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

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

La fattura va inviata a:

Data

FIRMA

.....

.....

1.1 Oggetto: Informativa ai sensi dell'art. 13 Decreto Legislativo n 196 del 2003

Questa informativa viene fornita ai sensi dell'art. 13 del Decreto Legislativo 196 del 2003 (di seguito Codice privacy), dettato in materia di “protezione dei dati personali”. 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.

Ai sensi dell'articolo 13 del Codice privacy, **Sviluppo Iniziative Attuariali S.r.l. (in seguito anche SIA)** con sede legale in Viale delle Milizie, 1, 00192 Roma, Titolare del trattamento, Le fornisce quindi le seguenti informazioni:

- il trattamento dei suoi dati personale è effettuato per:
 - la gestione e l'organizzazione dei corsi, per la sua iscrizione e per l'esecuzione delle attività amministrative, fiscali e contabili collegate;
 - l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
 - il trattamento sarà effettuato con strumenti automatizzati e manuali;
 - il conferimento dei dati di cui al punto a. è necessario e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di partecipare all'attività formativa; il conferimento dei dati di cui al punto b. è facoltativo e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di inviare comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
 - i dati, che non saranno diffusi, potranno essere comunicati, a soggetti terzi per l'adempimento delle finalità su menzionate, a società che si occupano di formazione e aggiornamento professionale e a soggetti cui la facoltà di accedere ai dati sia riconosciuta da disposizioni di legge e/o di normativa secondaria;
 - gli incaricati che si occupano della gestione degli iscritti potranno venire a conoscenza dei suoi dati personali esclusivamente per le finalità su menzionate;
- La informiamo, infine che potrà esercitare, i diritti contemplati dall'art. 7 del Codice privacy, tra cui quello di ottenere dal Titolare del trattamento, la conferma dell'esistenza o meno di Suoi Dati personali e di consentirLe, nel caso, la messa a disposizione scrivendo all'indirizzo e-mail info@sifa-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.

Roma, 19 dicembre 2016

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 suoi dati personali per l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi.

Data _____

Firma _____