



SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

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

Roma, 17 novembre 2017

Prot. n. 025/17

Cari Colleghi,

abbiamo il piacere di informarVi che il **4° corso FAC dell'anno 2017, organizzato dalla S.I.A.** in base alla Convenzione sottoscritta con il Consiglio dell'Ordine Nazionale degli Attuari e rivolto agli Attuari iscritti all'Albo, **la cui partecipazione è gratuita**, si tiene a **Roma, mercoledì 6 dicembre 2017 dalle 9.30 alle 16.30, presso Centro Congressi Cavour, via Cavour 50/a, Roma** (vicino alla Stazione Termini).

Il corso ha come titolo:

“I compiti dell'unità di Validazione della Funzione Attuariale – vita e danni”

La docenza del corso è affidata al dott. Fausto Belliscioni, alla dott.ssa Cristina Alfieri, e al dott. Simone Filesi.

In particolare il programma del corso si articola come segue:

La Funzione Attuariale nel framework Solvency II

- Cenni introduttivi: obiettivi della riforma e riferimenti normativi
- Perimetro di azione della Funzione Attuariale nel contesto del framework Solvency II: requisiti di capitale (SII Market Value Balance Sheet), governance dei rischi (ORSA), reportistica
- Governance e organigramma della Funzione Attuariale: possibili configurazioni. L'esempio di Generali Italia

L'unità di Validazione nell'ambito della Funzione Attuariale

- Coordinamento e Validazione del processo di calcolo delle technical provisions SII
- Verifica della coerenza con valutazioni di bilancio civilistico e IAS
- Analisi dell'adeguatezza e validazione dei processi, delle metodologie, dei modelli utilizzati nonché delle ipotesi e delle scelte effettuate nel calcolo delle technical provisions SII
 - controlli di data quality
 - materialità: impatti delle scelte sul volume delle technical provisions e degli own funds
 - proporzionalità: analisi qualitativa delle scelte effettuate
 - analisi dei movimenti e back-testings
 - ricalcolo indipendente
- Analisi per il contributo della Funzione Attuariale all'implementazione di un efficace sistema di gestione dei rischi
- Verifiche finalizzate a supportare il Responsabile della Funzione Attuariale nelle seguenti attività:
 - formulazione di parere indipendente sulle politiche di sottoscrizione e di riassicurazione
 - controllo delle riserve tecniche di bilancio civilistico, valutazione della loro sufficienza e redazione della corrispondente relazione tecnica



SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

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

Le fasi del processo di calcolo delle Life technical Provisions ed i relativi interventi di Validazione

- Costruzione del portafoglio mimetico (model points e tecniche di grouping)
- Costruzione ed analisi del portafoglio degli attivi a copertura
- Definizione delle ipotesi operative, di spesa e finanziarie (struttura per scadenza dei tassi risk free, transitional measures, proiezione dei prezzi degli attivi a copertura)
- Tecniche di sviluppo dei flussi di cassa (opzioni contrattuali, garanzie finanziarie, management actions, dynamic policyholder behaviour)
- Calcolo delle Best Estimate of Liabilities, delle Reinsurance Recoverables e del Risk Margin
- Analisi dei risultati (model leakage, residual assets, analisi dei movimenti, back testings)

Le fasi del processo di calcolo delle Non-Life technical Provisions ed i relativi interventi di Validazione

- Segmentazione del business ai fini delle valutazioni (linee di business, importo dei sinistri, altre categorizzazioni)
- Processo di calcolo della riserva sinistri (outstanding claims reserve):
 - definizione delle componenti di business da modellizzare ed individuazione delle passività escluse dai modelli attuariali
 - costituzione ed analisi dei dati di input (definizione di triangoli e vettori, trattazione di recuperi, trattazione delle spese)
 - analisi dei KPI ed ipotesi attuariali (definizione dei modelli, scelte effettuate nei modelli)
- Processo di calcolo della riserva premi (premium reserve):
 - riserva per premi già sottoscritti all'epoca di valutazione
 - cash-in e cash-out relativi a premi ancora da sottoscrivere per contratti in vigore (rate a scadere, contratti pluriennali, concetto di contract boundaries)
- Calcolo delle Best Estimate of Liabilities (“discounted”), delle Reinsurance Recoverables e del Market Value Margin
- Analisi dei risultati (analisi dei movimenti, back testings)

Considerazioni finali

- Possibili evoluzioni della materia e punti aperti

Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come da Regolamento della FAC, si acquisiscono 2 (due) CFP (Crediti Formativi Professionali).

La richiesta di partecipazione è individuale e deve essere inviata personalmente dal partecipante alla S.I.A. per e-mail (info@sia-attuari.it) specificando nell'oggetto "richiesta di partecipazione 4° corso FAC-SIA 2017".

La Segreteria della S.I.A. provvederà ad inviare la conferma di partecipazione in base all'ordine cronologico di arrivo delle richieste.



SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

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

Questo corso rientra tra le iniziative prese dall'Ordine degli Attuari, per consentire agli iscritti di contenere le spese di formazione dando nel contempo l'opportunità di rispondere alle esigenze di aggiornamento professionale.

Nell'auspicare la massima partecipazione, porgiamo i nostri più cordiali saluti.

Il Presidente
(Giampaolo Crenca)

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.** con sede legale in Viale delle Milizie, 1, 00192 Roma, Titolare del trattamento, Le fornisce quindi le seguenti informazioni:

1. il trattamento dei suoi dati personali è effettuato per la gestione e l'organizzazione dei corsi, per la sua iscrizione e per l'esecuzione delle attività amministrative, nonché per l'acquisizione dei crediti formativi (CFP);
2. il trattamento sarà effettuato con strumenti automatizzati e manuali;
3. il conferimento dei dati è necessario e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di partecipare all'attività formativa;
4. i dati, che non saranno diffusi, potranno essere comunicati, a soggetti terzi per l'adempimento delle finalità su menzionate, a soggetti cui la facoltà di accedere ai dati sia riconosciuta da disposizioni di legge e/o di normativa secondaria;
5. 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@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.