



Roma, 23 ottobre 2018

A tutti gli Iscritti all'Albo

Circolare CNA n° 10/2018 Prot. n° 067/2018

Circolare ONA n° 09/2018 Prot. n° 109/2018

Oggetto:

Caro/a collega,

L'Ordine degli Attuari ha predisposto un Questionario, al fine di monitorare le attività che ciascun Attuario svolge nel proprio ambito lavorativo.

Tali attività riguardano principalmente il contesto del Risk Management, della Funzione Attuariale, del Calcolo delle Riserve e del Principio Contabile IFRS17.

Le risposte fornite da tutti i colleghi saranno statisticamente analizzate nel più breve tempo possibile e forniranno preziosi dati all'Ordine sia per finalità descrittive dello stato del coinvolgimento degli Attuari sulle tematiche lavorative che attualmente permeano il mercato, che per indirizzare opportunamente eventuali corsi di formazione.

Le risposte contenute nel questionario saranno ricevute in forma anonima, elaborate esclusivamente con le finalità statistiche sopra menzionate, nel rispetto della normativa sulla privacy (D. Lgs. 196/2003 e GDPR 679/2016).

Il Questionario in oggetto, richiede pochi minuti del tuo tempo per la compilazione, ti preghiamo pertanto di compilarlo ed inviarlo entro e non oltre il **5 novembre 2018**, cliccando sul seguente link:

<https://goo.gl/forms/jiIC2UJkbep2MLso2>

Potrai compilare il questionario una sola volta, potrai comunque visualizzarlo e modificarlo successivamente al suo invio entro e non oltre il **5 novembre 2018** sempre cliccando sul precedente link.

Grazie per la collaborazione.

Giampaolo Crenca
(Presidente CNA)

Fausto Belliscioni
(Presidente ONA)



Di seguito si forniscono chiarimenti in merito alla compilazione di alcune risposte del Questionario:

4) Società/Ente presso cui lavori

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Compagnia di assicurazione
- Società di riassicurazione
- Fondo pensione/Cassa di previdenza/Cassa sanitaria
- Banca/Istituto di credito/Società di investimento
- Ente pubblico (INPS, INAIL, ...)
- Associazione di categoria (ANIA, Assoprevidenza, Assofondipensione, ...)
- Autorità di vigilanza (IVASS, COVIP, ...)
- Società di consulenza/Libero professionista
- Altro

5) In che area aziendale lavori?

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Consiglio di amministrazione/Alta direzione
- Risk management
- Funzione attuariale (unità di validazione)
- Calcolo delle riserve (unità di calcolo)
- Pricing/costruzione/sottoscrizione/intermediazione prodotti (anche relativamente alla riassicurazione attiva, ad esempio attuari che lavorano in una Società di riassicurazione collocando i propri trattati)
- Liquidazioni
- Contabilità
- Riassicurazione (passiva e/o retrocessione di riassicurazione attiva)
- Finanza/Asset management
- Analisi dati (big data, data mining, machine learning, ...) anche in ambito Tariffazione e Riservazione (in tali casi seleziona anche le relative caselle)
- Attività attuariale legata alla revisione contabile (solo per chi alla domanda n. 4) ha risposto "Società di consulenza o Libero professionista")
- Altro



6) Sei responsabile di qualche Funzione di Controllo?

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Risk management di singola compagnia o di gruppo
- Funzione attuariale (unità di validazione) di singola compagnia o di gruppo
- Altro
- No, non sono responsabile di alcuna Funzione di Controllo

7.1) Relativamente alle attività svolte nell'area di Risk Management, che livello di esperienza ritieni di aver maturato nei seguenti ambiti?

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Catalogazione dei rischi, individuazione dei rischi emergenti e Risk mapping
- Valutazione/quantificazione dei rischi di mercato
- Valutazione/quantificazione dei rischi di sottoscrizione vita
- Valutazione/quantificazione dei rischi di sottoscrizione danni
- Valutazione/quantificazione dei rischi di controparte
- Valutazione/quantificazione dei rischi operativi
- Valutazione/quantificazione delle LAC DT
- Valutazioni/quantificazioni ORSA
- Risk Appetite Framework e politica di gestione del capitale
- Gestione e assessment del rischio di liquidità
- Gestione e assessment dei rischi qualitativi (appartenenza al gruppo, compliance, reputazionale e strategico)
- Definizione dei piani di emergenza

Per quanto riguarda invece l'esperienza maturata i vari livelli riportati sinteticamente nel Questionario possono essere considerati in modalità estesa come:

- Non me ne sono occupato
- Livello base → ci sono notevoli spazi di miglioramento
- Livello intermedio → alcuni aspetti potrebbero essere migliorati
- Livello avanzato → tutti gli aspetti sono stati sufficientemente approfonditi

8.1) Relativamente alle attività svolte nell'area della Funzione Attuariale (unità di validazione), che livello di esperienza ritieni di aver maturato nei seguenti ambiti?



Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Coordinamento del calcolo delle riserve tecniche Solvency II (definizione processo)
- Valutazione adeguatezza delle metodologie, dei modelli e delle ipotesi
- Data quality
- Backtesting delle ipotesi
- Parere sulla politica di sottoscrizione
- Parere sulla politica di riassicurazione
- Contribuzione al sistema di gestione dei rischi (mappatura rischi, ORSA, USP, LAC DT, ...)
- Redazione Actuarial Function Report
- Presidio e disclosure sugli Expert Judgement

Per quanto riguarda invece l'esperienza maturata i vari livelli riportati sinteticamente nel Questionario possono essere considerati in modalità estesa come:

- Non me ne sono occupato
- Livello base → ci sono notevoli spazi di miglioramento
- Livello intermedio → alcuni aspetti potrebbero essere migliorati
- Livello avanzato → tutti gli aspetti sono stati sufficientemente approfonditi

9.1) Relativamente alle attività svolte nell'area del Calcolo delle riserve, che livello di esperienza ritieni di aver maturato nei seguenti ambiti?

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Valutazione/quantificazione delle Riserve tecniche Local GAAP
- Valutazione/quantificazione delle Riserve tecniche IFRS
- Valutazione/quantificazione delle Best estimate Solvency II
- Valutazione/quantificazione del Risk Margin
- Quantificazione/definizione delle ipotesi di valutazione

Per quanto riguarda invece l'esperienza maturata i vari livelli riportati sinteticamente nel Questionario possono essere considerati in modalità estesa come:

- Non me ne sono occupato
- Livello base → ci sono notevoli spazi di miglioramento
- Livello intermedio → alcuni aspetti potrebbero essere migliorati
- Livello avanzato → tutti gli aspetti sono stati sufficientemente approfonditi



10.1) Relativamente al Principio Contabile IFRS17, che livello di esperienza ritieni di aver maturato nei seguenti ambiti?

Di seguito si fornisce la lista con la descrizione estesa delle opzioni di scelta che per motivi di spazio è stata riportata sinteticamente nel testo del Questionario:

- Interpretazione del principio contabile
- Predisposizione documenti metodologici
- Disegno del modello operativo
- Supporto nella software selection
- Implementazione dei sistemi di calcolo
- Impatti contabili dell'applicazione del principio (emersione dell'utile a conto economico, interazioni con IFRS9, ecc.)
- Supporto nella definizione del piano dei conti

Per quanto riguarda invece l'esperienza maturata i vari livelli riportati sinteticamente nel Questionario possono essere considerati in modalità estesa come:

- Non me ne sono occupato
- Livello base → ci sono notevoli spazi di miglioramento
- Livello intermedio → alcuni aspetti potrebbero essere migliorati
- Livello avanzato → tutti gli aspetti sono stati sufficientemente approfonditi