

# SST-Veröffentlichung

23. September 2022

## 1 Ziel

In diesem Dokument werden die Termine für die reguläre Aktualisierung der SST-Templates festgehalten, geplante Schattenrechnungen und Erneuerungen angekündigt und allfällige ausserordentliche Aktualisierungen beschrieben.

Wir empfehlen eine Registrierung unter MyFINMA<sup>1</sup>, um die Dokumente zum SST zu abonnieren (Stichwörter: Überwachung und Versicherer). Sie erhalten automatisch eine E-Mail bei Aktualisierungen der Dokumente.

Fragen, Bemerkungen und Fehlermeldungen können an folgende E-Mail-Adresse gesandt werden:

[quantitative-risk-management@finma.ch](mailto:quantitative-risk-management@finma.ch)

## 2 Reguläre Aktualisierungen

Bis zum 31. Oktober 2021: Aktualisierung aller für den SST 2022 notwendigen Dokumente (Wegleitungen und technische Beschreibungen), Templates und Hilfsmittel.

Bis zum 10. Januar 2022: Aktualisierung der Excel-Datei *SST-Inputdaten.xlsx* (Zinskurven, Wechselkurse, Inflationsraten).

Bis zum 31. Januar 2022: Aktualisierung der Excel-Dateien

1. *SST-Inputdaten.xlsx* (Volatilitäten und Korrelationsmatrix)
2. *SST-Template.xlsx* (Endversion, mit Inputdaten)
3. *SST-Life-Template.xlsx* (Endversion, mit Inputdaten)
4. *SST-Nonlife-Template.xlsm* (Endversion, mit Inputdaten)
5. *SST-Health-Template.xlsx* (Endversion, mit Inputdaten)
6. *Berechnungs-Template LZV.xlsm* (Endversion, mit Inputdaten)
7. *SST-StandRe-Template.xlsm* und *SST-StandRe-Template.xlsx* (Endversion, mit Inputdaten)
8. *SST-Captive-Template.xlsx* (Endversion, mit Inputdaten)
9. *Bonitätstool.xlsx* (Wechselkurs)

Die vorgenommenen Anpassungen sind den in den jeweiligen Templates selbst geführten Übersichten zu entnehmen.

---

<sup>1</sup> [www.finma.ch>myfinma](http://www.finma.ch/myfinma)

### 3 Ankündigungen und Hinweise

*Stresstests:* Im Laufe des Jahres 2022 werden voraussichtlich weitere Stresstests mit ausgewählten Versicherungen durchgeführt.

*Libor-Ablösung:* Im Laufe des Jahres 2022 wird es voraussichtlich im Hinblick auf den SST 2023 gewisse Neuparametrisierungen aufgrund der Libor-Ablösung geben.

*UVG-Modellierung:* Unter Federführung des BAG wird aktuell über die Ablösung des Finanzierungsmodells des Teuerungsfonds nachgedacht. Dies hat möglicherweise Implikationen auf die Modellierung des UVG-Geschäfts im Rahmen des **Standardmodells Schaden**. In diesem Fall ist eine entsprechende Schattenrechnung im Laufe des Jahres 2022 angedacht.

*Risikolose Zinskurve GBP:* Die Daten der Ticker BPSWS\*\* Curncy werden linear interpoliert und gebootstrapped.

*Korrektur Fundamental Data Sheet:* unter Datenerhebung zur SST-Berichterstattung > Standardmodelle. Ergänzung des zusätzlichen Eintrages *Effekt der LLPO (nur für das Beteiligungsmodell)* und eine erweiterte Aufteilung des Kreditrisikos. Die Datei *Informationen von Anwendern von internen Modellen (sst\_info\_im.xlsx)* unter Datenerhebung zur SST-Berichterstattung > Interne Modelle ist nicht betroffen.

### 4 Ausserordentliche Aktualisierungen

Datum	Datei	Änderung / Kommentar
31.01.2022	Vorlage für den SST-Bericht (Opt-In)	• Sprachliche Korrekturen
31.01.2022	SST-Berichtstabellen (Opt-In)	• Korrekturen, siehe Blatt "Intro"
22.02.2022	Fundamental Data	• Korrektur, siehe Datenerhebung zur SST-Berichterstattung > Standardmodelle
23.09.2022	SST Survey 2022	• Siehe Interne Modelle und Resultate > Resultate