



SST-Veröffentlichung

23 septembre 2022

1 But

Ce document décrit les échéances de l'actualisation ordinaire des *templates* SST ainsi que les calculs à blanc et les nouveautés prévues. Il décrit également d'éventuelles actualisations extraordinaires.

Nous recommandons une inscription à MyFINMA¹ qui permet de s'abonner aux documents relatifs au SST (mots-clés : surveillance et assureur). Vous recevrez ainsi automatiquement un courriel en cas d'actualisation des documents.

Vous pouvez envoyer vos questions, remarques et annonces d'erreur à l'adresse électronique suivante :

quantitative-risk-management@finma.ch

2 Actualisations ordinaires

Jusqu'au 31 octobre 2021 : actualisation de tous les documents (guides pratiques et descriptions techniques), *templates* et documents d'aide nécessaires pour le SST 2022

Jusqu'au 10 janvier 2022 : actualisation du fichier Excel SST-Inputdaten.xlsx (courbes de taux, cours de change et taux d'inflation)

Jusqu'au 31 janvier 2022 : actualisation des fichiers Excel

1. *SST-Inputdaten.xlsx* (volatilités et matrice de corrélations)
2. *SST-Template.xlsx* (version finale, avec inputs)
3. *SST-Life-Template.xlsx* (version finale, avec inputs)
4. *SST-Nonlife-Template.xlsm* (version finale, avec inputs)
5. *SST-Health-Template.xlsx* (version finale, avec inputs)
6. *Berechnungs-Template LZV.xlsm* (version finale, avec inputs)
7. *SST-StandRe-Template.xlsm* et *SST-StandRe-Template.xlsx* (version finale, avec inputs)
8. *SST-Captive-Template.xlsx* (version finale, avec inputs)
9. *Bonitätstool.xlsx* (cours de change)

Les adaptations effectuées sont indiquées de manière autonome dans les vues d'ensemble des *templates* correspondants.

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

3 Annonces et remarques

Tests de résistance: Au cours de l'année 2022, d'autres tests de résistance seront probablement effectués avec une sélection d'assurances.

Abandon du LIBOR: Au cours de l'année 2022, de nouveaux paramétrages devraient s'imposer en vue du SST 2023 en raison de l'abandon du LIBOR.

Modélisation LAA: Un abandon du modèle de financement du fonds de renchérissement est actuellement étudié sous la direction de l'OFSP. Cela pourrait avoir des conséquences pour la modélisation des affaires LAA dans le cadre du **modèle standard assurance dommage**. Dans ce cas, un calcul à blanc est envisagé au cours de l'année 2022.

Courbe de taux sans risque GBP: Les données du ticker BPSWS** Curncy sont interpolées de façon linéaire et déterminées par bootstrap.

Corrections Fundamental Data Sheet: Voir Récolte de données pour la soumission du rapport SST > Modèles standards. Ajout de l'entrée supplémentaire *Effekt der LLPO (nur für das Beteiligungsmodell)* et élargissement de la répartition du risque de crédit. Le fichier *Informationen von Anwendern von internen Modellen (sst_info_im.xlsx)* voir Récolte de données pour la soumission du rapport SST > Modèles internes n'est pas concerné.

4 Actualisations extraordinaires

Date	Fichier	Modification / Commentaire
31.01.2022	Document pour le rapport SST (Opt-In)	<ul style="list-style-type: none">• Corrections linguistiques
31.01.2022	SST-Berichtstabellen (Opt-In)	<ul style="list-style-type: none">• Corrections, voir feuille "Intro"
22.02.2022	Fundamental Data	<ul style="list-style-type: none">• Corrections, voir Récolte de données pour la soumission du rapport SST > Modèles standards
23.09.2022	SST Survey 2022	<ul style="list-style-type: none">• Cf. Modèles internes et résultats > Résultats