

Solvency II

Des données exhaustives pour optimiser votre gestion des risques et votre reporting.

Le secteur européen de l'assurance est confronté à un défi réglementaire sans précédent, la mise en application de la directive Solvabilité II. Cette directive complexe, sera un moteur essentiel du développement et de la mise en œuvre d'une approche basée sur les risques des entreprises.

Afin d'aider nos clients, SIX Financial Information a ajouté des données spécifiques de conformité à notre couverture de données sur les actifs et les entités, tout en garantissant une offre d'options et de services évolutifs afin de soutenir les assureurs, les dépositaires et les gérants de fortune dans leurs calcul du capital de solvabilité requis (SCR) en vertu du pilier 1 et dans les reportings en vertu du pilier 3 de la directive.

A propos de Solvabilité II

Solvabilité II est une réglementation européenne pour le secteur de l'assurance dont la mise en place est prévue pour 2016. Elle vise à renforcer la protection des titulaires de polices d'assurance et à réduire les risques de perte des consommateurs ou de perturbation des marchés grâce à un renforcement des exigences en fonds propres, de gouvernance et de gestion des risques. Solvabilité II, qui viendra remplacer les normes locales en vigueur dans l'ensemble de l'UE en vertu de la directive initiale sur la Solvabilité, bénéficiera aux compagnies d'assurance et devrait renforcer l'accès au marché européen.

Le respect des obligations et du reporting selon Solvabilité II nécessite l'utilisation d'une large gamme d'informations, des données sur les instruments aux données sur les entités, les notations, l'examen des fonds, etc.

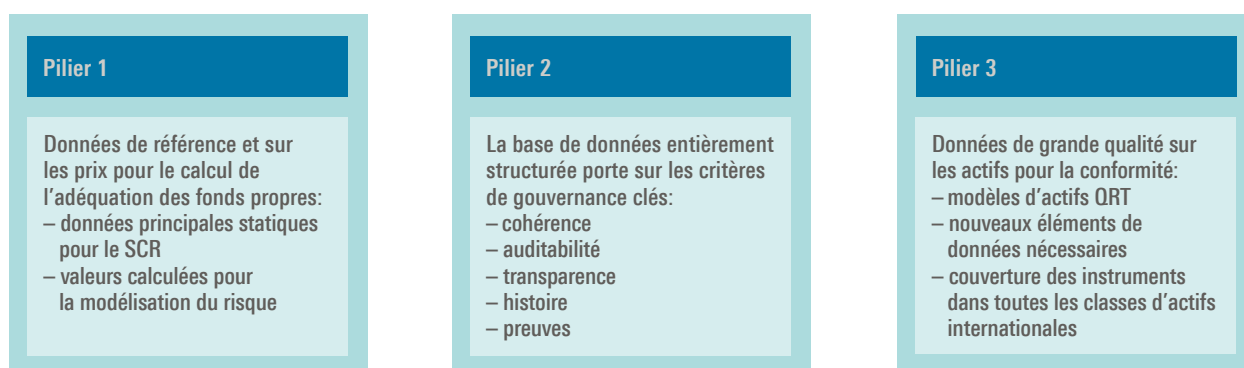
Service de données sur Solvabilité II de SIX Financial Information

En sa qualité de principal fournisseur de prix et de valorisations, de données de référence et de données de marché pour des millions d'instruments, SIX Financial Information offre des données sur les actifs de qualité permettant aux sociétés de satisfaire aux calculs d'exigences de fonds propres en vertu du pilier 1 et aux obligations de communication et de reporting en vertu du pilier 3. Notre base de données centrale, assure la cohérence et la transparence des données qui sous-tendent les trois piliers.

Principaux avantages :

- Des solutions durables qui limitent les efforts de mise en œuvre et assurent un respect permanent des obligations.
- Des données de référence détaillées, cohérentes et de grande qualité, fournies automatiquement et en quasi-temps réel.
- Une capacité d'examen des chiffres clés, de la stratégie et des directives d'investissement des fonds.

Données sur la gouvernance de Solvabilité II



Solvabilité II est structurée en trois piliers, régissant chacun un aspect différent des objectifs réglementaires.

Données sur la gouvernance de SIX Financial Information

Complementary Identification Code indicatif	Mapping des entités groupe/société-mère	Classifications et notations intégrées	Valorisations obligataires	Examen des fonds	Données de référence et sur les prix de millions d'instruments
<p>Schéma de classification des actifs</p> <ul style="list-style-type: none"> – Spécifique à Solvabilité II – Données de référence sous-jacente pour «prouver» les valeurs 	<ul style="list-style-type: none"> – Mapping complet selon LEI: ISO 17442 – Mapping complet selon la hiérarchie des entités D-U-N-S® – Mapping complet selon le fichier principal de titres 	<p>Classification des secteurs:</p> <ul style="list-style-type: none"> – NACE Rev. 2 – MSCI GICS® – SIC – NAICS – ICB <p>Notations de crédit:</p> <ul style="list-style-type: none"> – S&P – Moody's – Fitch Ratings 	<ul style="list-style-type: none"> – Valorisations entièrement transparentes pour les instruments illiquides – Sensibilités associées (durée, convexité, etc.) – Respect des Normes internationales d'information financière 	<ul style="list-style-type: none"> – Les positions complètes des fonds par Morningstar incluent: <ul style="list-style-type: none"> – la composition et la pondération des fonds – le CIC intégré par composante 	<ul style="list-style-type: none"> – Couverture des classes d'actifs mondiales – Conditions – Fichier principal de titres – Identificateurs des références croisées

Nos données de référence entièrement structurées offrent cohérence, auditabilité et transparence au profit d'une politique de gouvernance des données efficace.

Accent sur la qualité et la cohérence de Solvabilité II

Conformément aux exigences de fonds propres et de transparence en vertu des piliers 1 et 3, SIX offre un large éventail de données sur les titres et les entités.

– Complementary Identification Code (CIC):

Système spécifique de classification des niveaux des instruments pour Solvabilité II. Notre CIC est basé sur une logique commerciale transparente et provient d'ensembles de données de référence sous-jacentes détaillées.

- CIC générés au niveau des instruments (plateforme de négoce la plus liquide) et introduction en Bourse individuelles.

– Legal Entity Identifier (LEI)/ISO 17442:

Le recoupage des liens entre les sociétés-mères par rapport au fichier principal de titres permet l'agrégation de l'exposition aux risques de la société-mère ultime.

- Intégration complète de LEI dans notre base et mapping à notre fichier principal d'entités.
- Données sur la hiérarchie des entités de D&B, y compris les numéros D-U-N-S®.

– Classification sectorielle et notations de crédit

La classification des secteurs et les notations de crédit font partie intégrante du processus d'identification des risques de chocs par rapport aux actifs individuels et des niveaux de concentration ainsi que de l'évaluation de la probabilité de défaut.

- Classification sectorielle de NACE; GICS®, SIC, NAICS, ICB
- Notations S&P, Moody's et Fitch Ratings

– Evaluation des prix obligataires

Une évaluation, complète et entièrement indépendante, des prix obligataires constitue un élément essentiel d'une évaluation des instruments appropriée et conforme au marché (obligations, dérivés,

titres complexes et difficiles à évaluer).

– Examen des fonds

Composition ligne par ligne et pondération correspondante de plus de 400 000 fonds de Morningstar. Les données incluent la date effective des données sur la composition, établissent un lien entre les ensembles de données de référence des composantes sous-jacentes et soutiennent la génération automatique de CIC pour les titres constitutifs individuels

– Données de référence et sur les prix

Modèle de données structuré et données entièrement encodées qui fournissent les données complètes de référence et sur les prix nécessaires pour assurer l'exhaustivité et l'exactitude de votre propre fichier principal de titres – une condition indispensable aux processus critiques qui sous-tendent vos efforts en vue du respect des obligations.

- Simplification de la gestion et optimisation des données grâce à une approche cohérente.

Votre fournisseur de données

SIX Financial Information fournit des données sur les titres, pertinentes et exhaustives, normalisées et structurées de façon à éliminer toute ambiguïté, réduire les coûts et gagner du temps grâce au STP (Straight-Through-Processing). Nos clients bénéficient de notre approche basée sur les solutions, qui nous permet de mettre en place des formats de livraison flexibles grâce à des solutions standards ou sur mesure pouvant être facilement intégrées. En étroite collaboration avec nos clients, nos spécialistes peuvent exploiter notre large univers de données pour élaborer des solutions sur mesure qui répondent aux besoins en données spécifiques dans le cadre de Solvabilité II ou d'autres réglementations.

N'hésitez pas à contacter votre Ingénieur Commercial SIX Financial Information pour de plus amples informations sur ce service.

SIX Financial Information
 Hardturmstrasse 201
 P.O. Box
 CH - 8021 Zurich
 T +41 58 399 5111

Allemagne +49 69 717 000
 Belgique +32 2 790 0500
 Espagne +34 91 577 5500
 France +33 1 5300 0100
 Irlande +353 1 213 0722

Italie +39 02 764 5631
 Luxembourg +352 261 161
 Maroc +212 522 276 410
 Monaco +377 97 977 161
 Pays-Bas +31 20 301 2888

UK +44 20 7550 5000
 USA +1 203 353 8100

sales.global@six-financial-information.com
 www.six-financial-information.com