

Optimierungspotenzial im narrativen Berichtswesen

Die Berichtspflicht unter Solvency II schafft Markttransparenz, aber auch erhebliche prozessuale und technische Herausforderungen. Die Ausarbeitung der Berichte unter starkem Zeitdruck und mit dem Ziel, hohe Qualitätsansprüche zu erfüllen, stellt eine umfangreiche administrative Aufgabe für viele Versicherer dar. Lassen Sie sich über Möglichkeiten der Prozessoptimierung sowie individueller Unterstützung beraten.

Inhaltsverzeichnis

Berichtsflut unter Solvency II.....	2
Milliman-Berichtsprozess: Effizient und revisionssicher.....	2
Disclosure-Management-Tool (DMT)	3
Milliman-Automatisierungstool	3
Expertise von Milliman und unser Angebot.....	3



Gegründet 1947 ist unser Unternehmen weltweiter Marktführer in der unabhängigen aktuariellen Beratung mit Niederlassungen auf allen Kontinenten.

Unser Düsseldorfer Büro verfügt über Spezialisten in den Bereichen Risikomodellierung, risiko- und wertorientierte Steuerung, Automatisierung, Produktentwicklung, Migration, Interimsmanagement, M&A sowie in Solvency II und IFRS 17.

de.milliman.com

KONTAKTIEREN SIE UNS:



Dr. Björn Medeke
Practice Leader
Düsseldorf, DE
bjoern.medeke@milliman.com
Mobil: +49 151 46 73 86 71

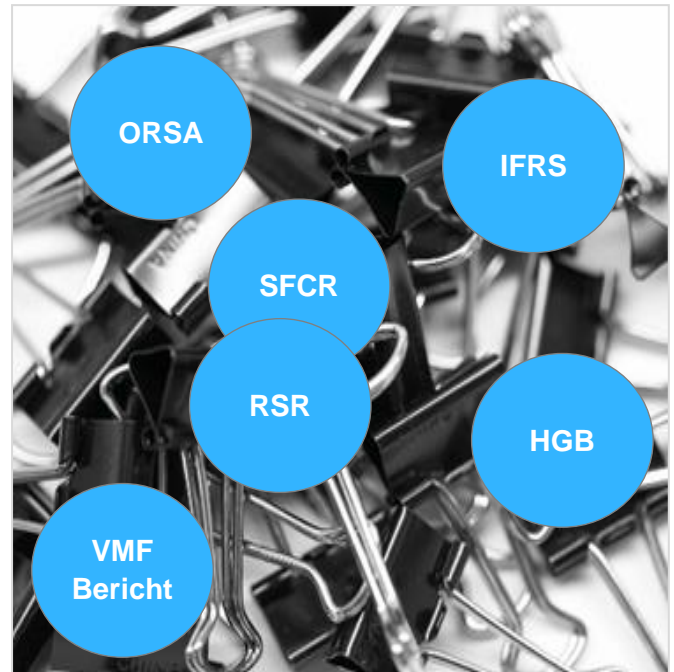


Dr. Sven Wagner
Manager
Düsseldorf, DE
sven.wagner@milliman.com
Mobil: +49 151 74 12 57 57

Gerne erstellen wir Ihnen ein auf Ihr Unternehmen zugeschnittenes Angebot!

Berichtsflut unter Solvency II

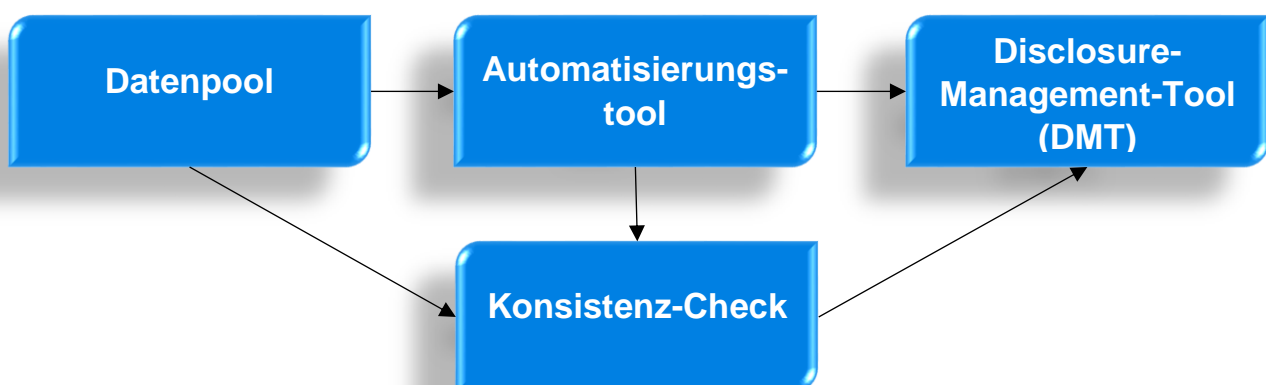
Unter Solvency II ist periodisch wiederkehrend neben dem zentralen ORSA-Bericht und zusätzlich zu bereits bestehenden Berichten (z.B. Geschäftsbericht) eine Vielzahl weiterer Berichte (z.B. SFCR, RSR, VMF-Bericht) zu erstellen. Diese „Berichtsflut“ mündet für die Unternehmen - neben anspruchsvollen inhaltlichen Fragestellungen - in immense prozessuale und technische Herausforderungen. Grundsätzlich zeigt sich, dass für die termingerechte, konsistente und ressourceneffiziente Erstellung der diversen Berichtsformate - unabhängig von der Unternehmensgröße - die Standardisierung und die Automatisierung von Berichtsprozessen inklusive der zugehörigen Berechnungen essenziell sind.



Milliman-Berichtsprozess: Effizient und revisionssicher

Der Milliman-Berichtsprozess bietet hierfür den optimalen Rahmen und erlaubt nach erfolgreicher Implementierung und Synergieanalyse beispielsweise, den vollständigen ORSA-Berichtsprozess innerhalb einer Arbeitswoche abzuschließen. Kernelemente bilden das Milliman-Automatisierungstool für Berechnungsläufe sowie ein Disclosure-Management-Tool nach Wahl des Kunden, die an einen bestehenden Datenpool angebunden werden. Die einheitliche Datengrundlage, die automatisierte Datenverarbeitung sowie die prozessimmanenten Konsistenzprüfungen sichern dabei sowohl die Qualität innerhalb eines Berichtsformats als auch die berichtsübergreifende Konsistenz und bilden die Basis für einen revisionssicheren Berichtsprozess.

Der komplette ORSA-Berichtsprozess in einer Woche! Wie lange brauchen Sie?



Milliman-Automatisierungstool

Das Automatisierungstool bietet speziell für folgende Anwendungen viele Vorteile:

- Vollautomatische Berechnung verschiedener Solvency-II-Kennziffern (z.B. ALM-Projektionen, Neugeschäftsbewertungen)
- Vollständige ORSA-Projektionen für unterschiedliche Stresse und Anzahl an Projektionsjahren
- Automatisierte Erstellung der BSM-Inputs (z.B. vt. Cashflows, KA-Werte) anhand von vorgegebenen Planzahlen oder Bestandsentwicklungen
- Integrierte Konsistenzchecks und Abgleiche sorgen für hohe Qualität der Simulationsergebnisse

Mit dem Milliman-Automatisierungstool vermeiden Sie die vielen manuellen, sich stetig wiederholenden Arbeitsschritte, wie das Befüllen und Starten der Modelle, und sparen dadurch nicht nur viel Zeit, sondern eliminieren auch typische Fehlerquellen. Nutzen Sie die gewonnene Berechnungszeit für weitere Analysen!

Disclosure-Management-Tool (DMT)

Ein DMT verwaltet (inklusive Versionierung von Änderungen) Textbausteine zu diversen Themen, die nach einmaliger Abstimmung und Qualitätssicherung konsistent in verschiedene Berichtsformate und bei deskriptiven Passagen periodisch wiederkehrend integriert werden können. Zudem besteht die Möglichkeit, das Zahlenwerk automatisiert aus dem Datenpool und dem Automatisierungstool abzugreifen. Nach einer Auswahl- und unternehmensindividuellen Implementierungsphase trägt ein DMT erheblich zur Hebung von Synergien bei Überschneidungen in Berichtsformaten, zur Prozessbeschleunigung und zur Qualität der Berichte bei.

Durch einschlägige Projekterfahrung ist Milliman mit den marktüblichen DMTs vertraut und berät seine Kunden unabhängig bei der Auswahl, Initialisierung und Strukturierung eines geeigneten DMT.

Expertise von Milliman und unser Angebot

Milliman hat diverse Projekte zur Optimierung von Berichtsprozessen und -inhalten für verschiedene Kunden umgesetzt. Unser Spektrum der Dienstleistungen umfasst insbesondere folgende Punkte, bei denen wir Sie gerne kosteneffizient und unkompliziert unterstützen:

- Unterstützung bei der individuellen Konzeption und Umsetzung des Berichtswesens in Ihrem Haus
- Unabhängige Beratung bei der Auswahl eines Disclosure-Management-Tools (DMT) und bei der Koordination der Implementierung des DMTs in Ihrem Haus
- Anbindung des Milliman Automatisierungstools an Ihren Datenpool und/oder Ihr DMT

Mit dem Milliman-Berichtsprozess erhalten Sie einen revisionssicheren Prozess, der eine termingerechte, konsistente sowie zeit- und ressourceneffiziente Erstellung der regulatorisch geforderten Berichtsformate gewährleistet. Vergleichen Sie dies mit der Dauer des Prozesses in Ihrem Haus!

© 2019 Milliman, Inc. Alle Rechte vorbehalten. Die Inhalte dieses Dokuments stellen Informationen allgemeiner Natur dar. Sie enthalten keine spezifische Beratung für individuelle Sachverhalte. Milliman übernimmt daher keine Gewähr für den Inhalt und dessen Nutzung. Die Nutzung der Inhalte erfolgt auf eigene Gefahr. Leser sollten daher qualifizierte Fachleute konsultieren, bevor sie bestimmte Maßnahmen ergreifen. Das Dokument und dessen Inhalt dürfen nicht ohne ausdrückliche Zustimmung von Milliman reproduziert werden.