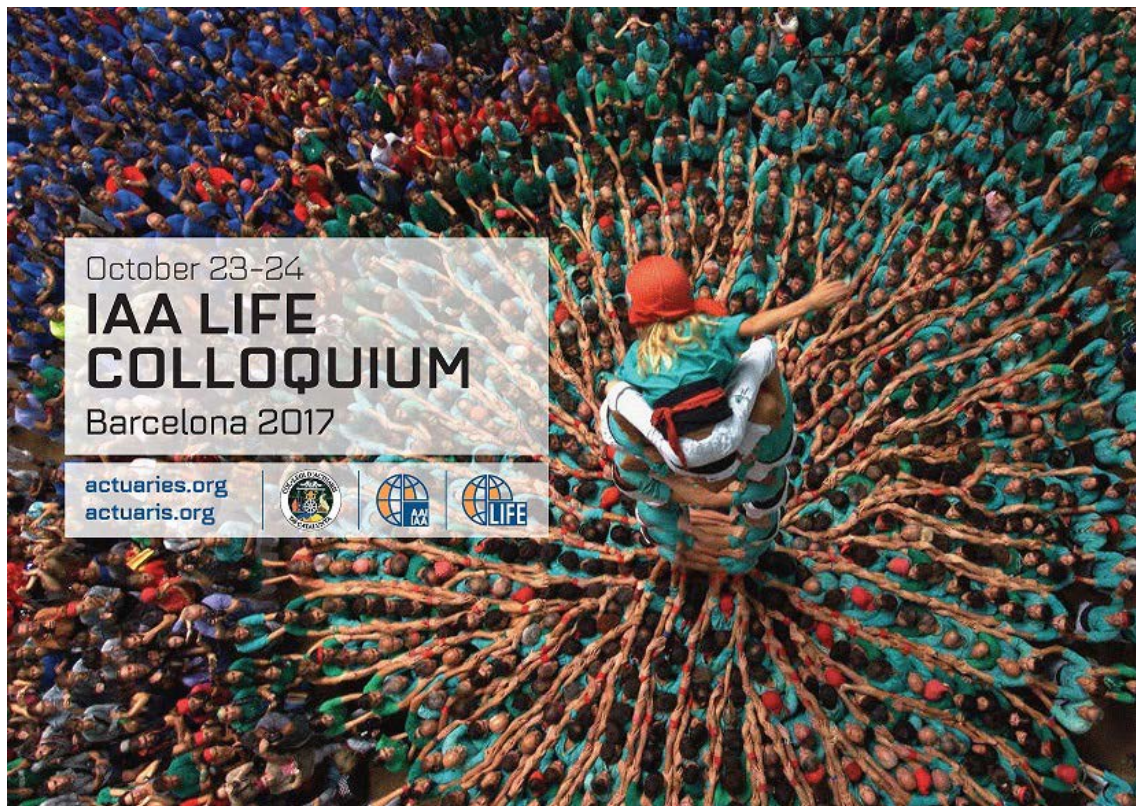


IAALS COLLOQUIUM
BARCELONA
23 – 24 OCTUBRE 2017



COL·LEGI D'ACTUARIS DE CATALUNYA



PRESENTACIÓ



Benvolguts companys,

Desitjo donar-los la benvinguda al Colloquium de la International Actuarial Association- Life Section - (IAALS) "**Long-Term Saving in an Ageing World**", que es celebrarà a Barcelona els dies 23 i 24 d'octubre de 2017, organitzat pel Col·legi d'Actuaris de Catalunya.

El creixement de l'esperança de vida i l'augment de la longevitat provoca efectes molt notables en els sistemes sanitaris i en els serveis socials a tot el món.

El que sens dubte és una gran notícia per a la Humanitat planteja, no obstant això, un gran desafiament, entre altres, per als sistemes de pensions públics i privats, per a la indústria de les assegurances de vida en el seu conjunt i, també per a la professió actuarial.

En el Colloquium "**Long-Term Saving in an Ageing World**" examinarem de prop aquesta problemàtica i les repercussions que implica.

Per a això tenim el privilegi de comptar amb la participació d'alguns dels millors especialistes en la matèria, que compartiran amb nosaltres els seus coneixements i punts de vista. El Dr. Nicholas Barr, professor de la London School of Economics, el Dr. Stéphane Loisel, Professor a la Universitat de Lió i el Dr. Jens Perch Nielsen, professor de Ciències Actuarials en la City University de Londres.

Estem convençuts que el Colloquium també oferirà als participants una oportunitat ideal per descobrir la ciutat de Barcelona, una de les ciutats més visitades del món, amb un ampli ventall d'excel·lents esdeveniments culturals, d'oci i de plaers gastronòmics.

Esperem veure'ls a Barcelona a l'octubre del 2017.

Miquel Viñals

President del Col·legi d'Actuaris de Catalunya

PROGRAMA

LLOC DE CELEBRACIÓ

COSMOCAIXA.

Adreça: Isaac Newton, 26 - 08022 Barcelona, Espanya [Google maps](#)



Les sessions del congrés tindran lloc a la seu de CosmoCaixa, a Barcelona.

La història de l'edifici va començar fa més d'un segle, en 1904, quan l'arquitecte Josep Domènech i Estapà va utilitzar l'estil modernista de l'època per construir la institució Amparo de Santa Lucía, en funcionament durant 75 anys.

L'any 1979, la Fundació "la Caixa" va encarregar als arquitectes Jordi Garcés i Enric Sòria la remodelació i ampliació de l'edifici per albergar el Museu de les Ciències, convertint-se en el primer museu interactiu d'Espanya dedicat a temes científics. La reforma posterior per transformar el museu en CosmoCaixa va ser dissenyada pels arquitectes Robert i Esteve Terradas i el nou centre va obrir les seves portes el 25 de setembre de 2004. El complex s'ha convertit en el museu de les ciències de referència a Catalunya.

PROGRAMA

DIUMENGE 22 D'OCTUBRE

18:00 – 21:00

RECEPCIÓ I SOPAR DE BENVINGUDA

L'AQUARIUM.

Adreça: Moll d'Espanya del Port Vell, s/n 08039 Barcelona

[Google Maps](#)



El diumenge 22 d'octubre tindrà lloc la Recepció i Sopar de Benvinguda als assistents al congrés, a l'**Aquàrium de Barcelona**, un espai singular i destacat de la ciutat, situat a les ribes del mar Mediterrani, un espai on admirar els més d'11.000 animals que allí s'estudien. Serà el punt d'inici per a uns dies en els quals esperem, gaudeixin de la ciutat.

Codi de vestimenta: Smart Casual

DILLUNS 23 D'OCTUBRE

8:00 – 17:30

SESSIONS DEL COLLOQUIUM

	AUDITORI	SALA ALFA	SALA BETA	SALA GAMMA	SALA TAU
8:00 – 9:00	REGISTRATION				
9:00 – 9:45	WELCOMING CEREMONY				
9:45 – 11:00	CONFERENCE 1 – NICHOLAS BARR -				
11:00 – 11:30	COFFEE BREAK				
11:30 – 13:30	PARALLEL SESSIONS				
11:30 – 12:30		Papers 7, 14	Papers 16, 27, 30	Papers 8, 10, 11	
12:30 – 13:30		Papers 7, 14	Papers 16, 27, 30	Papers 8, 10, 11	
13:30 – 14:30	LUNCH				
14:30 – 16:30	PARALLEL SESSIONS				
14:30 - 15:30		Papers 21, 23, 6	Papers 31, 5	Papers 13, 4, 19	
15:30 - 16:30		Papers 21, 23, 6	Papers 31, 5	Papers 13, 4, 19	
16:30 – 17:00	Presentation by Mr. Ermanno Pitacco.				
17:00 – 18:15	CONFERENCE 2 - STEPHANE LOISEL -				

Nº PAPER

AUTHOR / AUTHORS

4	Long-Term Care Models and Dependence Probability Tables by Acuity Level: New Empirical Evidence from Switzerland	Joël Wagner and Michel Fuino
5	How a Cause-of-death Reduction can be Compensated in Presence of Heterogeneity? A Population Dynamics Approach.	Héloïse Labit Hardy, Sarah Kaakai, Séverine Arnold and Nicole El Karoui
6	Solvency Requirement in a Unisex Stochastic Mortality Model	Montse Guillen, An Chen and Elena Vigna
7	Behavioral Patterns of Long Term Saving: Predictive Analysis of Adverse Behaviours on a Saving Portfolio	Babacar Sow and Thomas Behar
8	Addressing Longevity Heterogeneity in Pension Scheme Design and Reform	Mercedes Ayuso, Jorge Miguel Bravo and Robert Holzmann
10	Basis Risk in Index Based Longevity Hedges: A Guide for Longevity Hedges	Andrew Cairns and Ghali El Boukfaoui
11	It Takes Two: Why Mortality Modelling is more than modelling one Mortality Trend	Johanne Schupp, Matthias Börger and Jochen Russ

Nº	PAPER	AUTHOR / AUTHORS
13	A Class of Random Field Memory Models for Mortality Forecasting	Yahia Salhi, P. Doukhan, D. Pommeret and J. Rynkiewicz
14	One Size Fits All? Drawdown Structures in Australia and The Netherlands: A Utility Study for Heterogenous Income Levels	Jennifer Alonso García and Michael Sherris
16	Collective Defined Contribution Plans - Backtesting Based on German Capital Market Data 1955 - 2015	Oskar Goecke
19	Marital Status, Mortality and Pensions: The Special Case of Being an Unmarried Elderly Woman in Spain	Estefanía Alaminos and Mercedes Ayuso
21	Using Fuzzy Set Theory to Evaluate Medically Underwritten Life Annuities	Laura González-Vila, Jorge de Andrés and Aihua Zhang
23	Nonfinancial Defined Contribution Pension Schemes: Construction of Annuity Divisors Using the Direct Method	Poontavika Naka, Carmen Boado-Penas, Jacques Janssen and Raimondo Manca
27	Alternative Measure of the (In)Adequacy of Public Pensions During Retirement	Manuela Bosch Princep and Oriol Roch
30	Distributing Long-Term Saving Policies in a Low-Saving Environment: Lessons from South Africa	Rob Rusconi
31	A Cross-Country Study of Saving and Spending in Retirement	Hazel Bateman, Jennifer Alonso-García, Johan Bonekamp, Arthur van Soest and Ralph Stevens

21:00 – 23:30

SOPAR DE GALA

L'ESFÈRIC.

Adreça: Plaça Dante. Montjuïc - Jardins Joan Brossa Barcelona 08038 [Google Maps](#)

El dilluns, 23 d'octubre, el sopar de gala tindrà lloc a l'Esfèric, edifici únic de 1929 amb una notable arquitectura i antecedents. Situat dins d'un bonic parc urbà, Montjuïc, envoltat de zones verdes i amb vistes de Barcelona.



Durant el sopar de gala es farà lliurament dels premis als millors treballs, segons el criteri del comitè científic.

- **Copa de cava** (accés lliure)

- **Exhibició de Castellers** (accés lliure): Els castells són una de les manifestacions culturals més genuïnes i singulars d'Europa. Sota el tradicional lema identificatiu "força, equilibri, valor i seny", els castells constitueixen una excel·lent targeta de presentació de Catalunya al món. El 16 de novembre de 2010, a Nairobi (Kenya), la Unesco va aprovar la inclusió dels castells en la llista representativa del Patrimoni Cultural Immaterial, atorgant així un reconeixement universal a aquest element. La declaració de la Unesco assenyalava: "Els castells són reconeguts pels catalans com una part integral de la seva identitat cultural, transmesa de generació en generació proporcionant als membres de la comunitat un sentiment de continuïtat, cohesió social i solidaritat."



- **Sopar de Gala**

Codi de vestimenta: business formal

Hi haurà servei de bus.

DIMARTS 24 D'OCTUBRE

8:00 – 17:30

SESSIONS DEL COLLOQUIUM

	AUDITORI	SALA BETA	SALA GAMMA	SALA TAU
9:00 – 9:30	REGISTRATION			
9:30 - 10:45	CONFERENCE 3 – JENS PER NIELSEN -			
10:45 – 11:00	Presentation ICA Congress 2018 - Berlin -			
11:00 – 11:30	COFFEE BREAK			
11:30 – 13:30	PARALLEL SESSIONS			
11:15 – 12:15		Papers 2, 3, 9	Papers 1, 24, 26	Papers 18, 25, 15
12:15 – 13:15		Papers 2, 3, 9	Papers 1, 24, 26	Papers 18, 25, 15
13:30 – 14:30	LUNCH			
14:30 – 16:30	PARALLEL SESSIONS			
14:30 – 15:30		Papers 12, 22	Papers 28, 29, 17	
15:30 – 16:30		Papers 12, 22	Papers 28, 29, 17	
16:30 – 18:00	CLOSING EVENTS			

Nº PAPER

AUTHOR / AUTHORS

1	Why the Deferred Annuity Makes Sense	Steven Haberman, Stephen Thomas and Anran Chen
2	Around the Life-Cycle: Deterministic Consumption-Investment Strategies	Mogens Steffensen and Marcus C. Christiansen
3	The Life Cycle Model with Recursive Utility: Defined Benefit vs Defined Contribution	Knut Aase
9	Self-Selection of Financial Risk	Munir Hiabu, Jens Perch Nielsen, Russell Gerrard and Ioannis Kyriakou
12	Rising Interest Rates and Lapse Risk for Life Insurers	Elia Berdin, Helmut Grundl and Christian Kubitzka
15	Adapting to Changes in Life Expectancy in the Finnish Earnings-Related Pension Scheme	Kaarlo Reipas and Mikko Sankala
17	Reviewing Dependencies Among Longevity and Mortality Risks in Standard Solvency Capital Requirements	Jaume Belles Sampera, Miguel Santolino and Antonio Rubio Pallarés
18	Who Wants to Live Forever? An Analysis of the Maximum Lifespan in the US	Martin Genz, Jan Feifel and Markus Pauly

Nº	PAPER	AUTHOR / AUTHORS
22	Nudging Long-Term Savings. Might the “Save More Tomorrow” Approach Work in Spain?	Jesús María García Martínez and José Vila
24	A Non-Homogeneous Semi-Markov Approach for the Calculation of the Balance Sheet of a Health Fund	Guglielmo D’Amico, Fulvio Gismondi, Montserrat Guillen, Jacques Janssen, Raimondo Manca and Ernesto Volpe di Prignano
25	Extension, Compression, and Beyond – A Unique Classification System for Mortality Evolution Patterns	Martin Genz, Matthias Börger and Jochen Russ
26	Lapse Tables for Lapse Risk Management: A Competing Risks Approach	Xavier Milhaud and Christophe Dutangy
28	The Life Insurance on Several Heads: Sensitivity Analysis to Increases in Life Expectancy	Armando Nieto Ranero
29	A Short Discussion on a Simplified Approach of Model Risk Assessment Associated with the "Stochastic" Models of the Prospective Mortality Tables	Anani A. Olympio, Anne Eyreaud-Loisel and Baptiste Dieltiens

SOBRE EL COLLOQUIUM

Al Colloquium d'Assegurances de Vida de la International Actuarial Association (IAALS) "Long-Term Saving in an Ageing World" s'abordaran alguns d'aquests temes:

- Longevitat i envelliment,
- Límits a la vida humana,
- Mortalitat en edats avançades i tendències relacionades,
- Models estocàstics de longevitat,
- Risc de longevitat,
- Bons de longevitat,
- Protecció contra la longevitat,
- Actius financers i reals per cobrir passius a llarg termini,
- Rendes anuals, reemborsaments programats, altres reemborsaments,
- Assegurances de dependència,
- Patrons conductuals en l'estalvi a llarg termini,
- Obstacles a l'estalvi,
- Tipus d'interès: com sobreviure en un entorn de baixa taxa d'interès,
- Les pensions públiques i la necessitat de complementar-les.

Els temes aquí exposats, i altres, seran debatuts al llarg de Sessions Paraleles en les quals es presentaran 30 treballs prèviament relacionats pel Comitè Científic, elaborats per actuaris d' Espanya, Regne Unit, Noruega, Austràlia, Estats Units, Bèlgica, Dinamarca, Alemanya, entre altres països.

El Comitè Científic està format per 10 personalitats del món acadèmic i professional, nacionals i estrangeres, presidit pel Sr. Diego Valero, un dels millors especialistes en matèria de pensions al nostre país, membre del grup assessor de Pacte de Toledo.

El Comitè Científic premiarà els millors treballs en les següents categories:

- **Contribucions teòriques:** Per a la millor recerca acadèmica.
- **Contribucions pràctiques:** Per al millor assaig o presentació del treball aplicat.

Els premis (1.000 dòlars cada premi) seran lliurats durant el sopar de gala del dilluns 23 d'octubre, que tindrà lloc en el Paraninfo de l'edifici històric de la Universitat de Barcelona.

CONFERÈNCIES



Dr. Nicholas Barr. És Màster en Economia per la London School of Economics i Doctor per la Universitat de Berkeley - Califòrnia. És professor d'Economia Pública en la London School of Economics (LSE). És autor de nombrosos articles, i autor o editor de més de vint llibres. La seva obra és una exploració de com les deficiències del mercat poden explicar i justificar l'existència de l'estat de benestar. És un dels grans especialistes mundials en matèria de pensions.



Dr. Stéphane Loisel. És Doctor en Matemàtica Aplicada per la Universitat de Lió, Màster en Ciències Actuarials i Finances, i membre del Institute d' Actuaire. Professor a ISFA, Université Lió 1, i investigador associat de la CMAP, Ecole Polytechnique. Editor Associat de diverses revistes, és un gran especialista en el risc de longevitat.



Dr. Jens Perch Nielsen. És Professor de Ciències Actuarials a la City University Londres. Actuari per la Universitat de Copenhaguen i Estadístic per UC-Berkeley. Va ser director de recerca de RSA. És coautor de més de 100 articles científics en revistes de ciència actuarial, economia, econometria i estadística, així com d'un llibre sobre modelització quantitativa del risc operacional. És editor associat de Digital Finance.

COMITÈS

COMITÈ ORGANITZADOR

Junta de Govern del Col·legi d'Actuaris de Catalunya

Miquel Viñals , President del Col·legi d'Actuaris de Catalunya
Julia Soler , Vicepresidenta del Col·legi d'Actuaris de Catalunya
Emilio Vicente , Secretari
Francisco Durán , Tresorer
Marc Arias , Vocal de Relacions Institucionals
Lluís Bermúdez , Vocal de Formació i Investigació
Xavier Plana , Vocal de la Secció Professional.

COMITÈ CIENTÍFIC

Diego Valero , (President), Universitat de Barcelona
Jan Dhaene , Universitat de Leuven
Abraham Hernández , Vitalis México
José Antonio Iglesias , Vidacaixa
Ermanno Pitacco , Universitat de Trieste
Carne Ribas , Universitat de Barcelona
María Jesús Romero , Zurich
Antonio Rubio , Catalana Occidente
Miguel Santolino , Universitat de Barcelona
Mogens Steffensen , Universitat de Copenhague

REGISTRE

QUOTES D'INSCRIPCIÓ

Quotes			
	Col·legiats CAC i treballadors de Membres Protectors	Acadèmics i estudiants	Altres
Colloquium (sessions)	300	300	350
Sopar de Benvinguda	100	100	125
Sopar de Gala	100	100	125
TOTAL	500	500	600
Corporatiu (3-5 participants)	15% descompte		
Corporatiu (+5 participants)	25% descompte		

(Tots els imports són expressats en €uro. IVA incl.)

INSCRIPCIONS (MODALITATS)

La inscripció al IAALS Colloquium Barcelona 2017 permet registrar-se a les activitats que més els interessi, tenint en compte la següent **informació important**:

El Colloquium (sessions) inclou:

- Assistència als dos dies de Colloquium (totes les seves conferències i sessions paral·leles)
- Coffee Break i dinar dels dos dies de Colloquium

El Sopar de Benvinguda inclou:

- Sopar de recepció de benvinguda al Aquàrium de Barcelona

El Sopar de Gala inclou:

- Sopar de gala en el Paranimf de l'edifici històric de la Universitat de Barcelona

INSCRIPCIONS

Inscripcions a través de actuaris@actuaris.org, indicant: nom i cognom de l'assistent, correu electrònic i dades per fer la factura (si és necessari).

INFORMACIÓ

Web: <http://www.actuaries.org/barcelona2017/index.cfm>

En aquesta pàgina web trobaran tota la informació actualitzada i necessària.

HOTELS

Per facilitar la vostra reserva d'hotel, us oferim aquesta agència de viatges:

EL CORTE INGLES – AGÈNCIA DE VIATGES.

Informació de contacte:

Telèfon (+34) 933 635 760

Adreça: Carrer Bolívia, 234-236

08020 Barcelona

Email: congresosbcn@viajeseci.es

Cal indicar que assisteix al IAALS Colloquium Barcelona 2017.

Comitè Organitzador

Si us plau, contactin amb el Comitè Organitzador per qualsevol dubte o pregunta.

Sr. Joaquim Celma

info.iaals.barcelona2017@actuaris.org

actuaris@actuaris.org

**Estarem encantats de comptar amb vostè a Barcelona els
pròxims 23 i 24 d'octubre**

PATROCINADORS

SPONSORS



IN COLLABORATION WITH

