

CURS GESTIÓ D'ACTIUS I PASSIUS (ALM) A ENTITATS ASSEGURADORES.

JUNY 2019

CURS GESTIÓ D'ACTIUS I PASSIUS EN ENTITATS ASSEGURADORES.

1.- OBJECTIUS DEL CURS

Els presentem el curs GESTIÓ D'ACTIUS I PASSIUS (ALM) A ENTITATS ASSEGURADORES.

El curs, de 5 hores de durada, es durà a terme el dia 19 de juny de 2019, organitzat pel Col·legi d'Actuaris de Catalunya, amb la col·laboració de Serfiex.

A causa de l'entorn de tipus d'interès baixos en què ens trobem, perllongat durant un llarg període de temps, una de les principals preocupacions de les companyies d'assegurances és realitzar una adequada gestió ALM que permeti minimitzar l'impacte en el càlcul de la provisió matemàtica sota criteris comptables i en el descompte dels fluxos de passius BEL, que afecten a l'import de l'excedent financer sota Solvència II (*Matching Adjustment*), a més de les futures implicacions derivades de la posada en marxa de la norma comptable IFRS 17.

L'Objectiu del curs és el d'oferir als seus assistents una visió general a través d'exemples pràctics de la Gestió ALM òptima en les entitats asseguradores, des del punt de vista del departament d'Inversions i del departament Actuarial.

2.- A QUI VA DIRIGIT

El curs va dirigit a actuaris i altres professionals del sector assegurador interessats a conèixer amb detall la gestió ALM, des d'una visió tècnica (actuarial) i des d'una visió financera, així com els impactes de la nova norma comptable NIIF17.

El curs serà impartit per professionals d'àmplia experiència, professional i docent, en la matèria, permetent transmetre una visió pràctica i de mercat.

3.- PROGRAMA.

Dia 19 de juny de 2019, de 9:00h a 14:00h

A càrrec de:

- Rafael García, Conseller Delegat, de Serfiex.
- Jordi Pagès, Director de l'Àrea Actuarial, de Serfiex.
- Enrique Abuín, Director de l'Àrea Financera, de Serfiex.

En el Curs es tractaran amb detall els punts següents:

- Modelització dels productes de passiu.

- Tipologia d'instruments financers i el seu funcionament.
- Revisió de les metodologies de càlcul de la provisió matemàtica sota criteris del ROSSP i quins són els passos per fer els càlculs correctament.
- Revisió de les alternatives de descompte i les seves metodologies de càlcul sota criteris de Solvència II per als fluxos de passiu: corba EIOPA, Volatility Adjustment i Matching Adjustment.
- Implicacions per IFRS 17

Es tracta d'un Curs eminentment pràctic, basat en exemples en EXCEL en el qual es proporcionarà material específic de seguiment.

PROGRAMA DEL CURS:

1.- Provisions Tècniques.

1.1.- Modelització del Passiu (ALM).

- Rendes.
- Productes d'estalvi amb prima periòdica.

1.2.- Gestió ALM.

- Evolució temporal.
- Hipòtesi i escenaris.
- Relació amb Solvència II i IFRS.

2.- Inversions Financeres i ALM

2.1.- Gestió Actiu i Passiu (ALM).

- Components de l'actiu: tipologia d'instruments financers.
- Gestió ALM.
- Excedent i risc de l'excedent.

2.2.- Tipus d'Interès per al càlcul de la provisió (ROSSP).

- Article 33.1: Tipus DGS.
- Article 33.2.a: Casament de Fluxos.
- Article 33.2.b: Immunització per durades.

2.3.- Solvència II:

- Risk free curve (EIOPA).
- Volatility Adjustment.
- Matching Adjustment.

2.4.- Implicacions derivades de l'aplicació de la norma comptable IFRS 17

4.- MATRÍCULA

Quota d'inscripció (Euros) - IVA del 21% NO INCLÒS

Membres Titulars i treballadors de Membres Protectors	Membres Titulars en atur i estudiants	Altres
250	125	375

El preu inclou l'assistència al curs i pausa cafè.

Lloc de celebració:

Foment Formació - Av. Francesc Cambó, 10 - AULA 27 - Barcelona 08003

Data: 19 juny 2019

Horari: de 9: 00h a 14: 00h

Forma de pagament:

Forma de pagament: transferència bancària a:

- Titular: Col·legi d'Actuaris de Catalunya
- IBAN: ES40 0081 0057 3100 0118 8927

Si desitgen factura a nom de l'empresa, han d'indicar CIF, nom, adreça, telèfon, persona de contacte i adreça de correu electrònic.

5.- INSCRIPCIONS

Col·legi d'Actuaris de Catalunya - Telèfon: 93.319.08.18 - actuaris@actuaris.org - www.actuaris.org

6.- CPD

El curs computarà 5 hores a l'efecte de l'acreditació de la formació continuada del Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CPD).

S'exigeix una assistència mínima del 80% per a l'obtenció del Diploma d'Aprofitament.

Amb la col·laboració de:

