

CURSO GESTIÓN DE ACTIVOS Y PASIVOS (ALM) EN ENTIDADES ASEGURADORAS.

JUNIO 2019

Via Laietana 32 4a planta - 08003 Barcelona - Tel + 34933190818 - actuaris@actuaris.org - www.actuaris.org

Membre de:

CURSO GESTIÓN DE ACTIVOS Y PASIVOS EN ENTIDADES ASEGURADORAS.

1.- OBJETIVOS DEL CURSO

Les presentamos el curso GESTIÓN DE ACTIVOS Y PASIVOS (ALM) EN ENTIDADES ASEGURADORAS.

El curso, de 5 horas de duración, se llevará a cabo el día 19 de junio de 2019, organizado por el Col·legi d'Actuaris de Catalunya, con la colaboración de Serfiex.

Debido al entorno de tipos de interés bajos en el que nos encontramos, prolongado durante un largo período de tiempo, una de las principales preocupaciones de las compañías de seguros es realizar una adecuada gestión ALM que permita minimizar el impacto en el cálculo de la provisión matemática bajo criterios contables y en el descuento de los flujos de pasivos BEL, que afectan al importe del excedente financiero bajo Solvencia II (*Matching Adjustment*), además de las futuras implicaciones derivadas de la puesta en marcha de la norma contable IFRS 17.

El Objetivo del curso es el de ofrecer a sus asistentes una visión general a través de ejemplos prácticos de la Gestión ALM óptima en las entidades aseguradoras, desde el punto de vista del departamento de Inversiones y del departamento Actuarial.

2.- A QUIÉN VA DIRIGIDO

El curso va dirigido a actuarios y otros profesionales del sector asegurador interesados en conocer con detalle la gestión ALM, desde una visión técnica (actuarial) y desde una visión financiera, así como los impactos de la nueva norma contable NIIF17.

El curso será impartido por profesionales de amplia experiencia, profesional y docente, en la materia, permitiendo transmitir una visión práctica y de mercado.

3.- PROGRAMA.

Día 19 de junio de 2019, de 9:00h a 14:00h

A cargo de:

- Rafael García, Consejero Delegado, de Serfiex.
- Jordi Payés, Director del Área Actuarial, de Serfiex.
- Enrique Abuín, Director del Área Financiera, de Serfiex.

En el Curso se tratarán con detalle los puntos siguientes:

- Modelización de los productos de pasivo.

- Tipología de instrumentos financieros y su funcionamiento.
- Revisión de las metodologías de cálculo de la provisión matemática bajo criterios del ROSSP y cuáles son los pasos para realizar los cálculos correctamente.
- Revisión de las alternativas de descuento y sus metodologías de cálculo bajo criterios de Solvencia II para los flujos de pasivo: curva EIOPA, Volatility Adjustment y Matching Adjustment.
- Implicaciones para IFRS 17

Se trata de un Curso eminentemente práctico, basado en ejemplos en EXCEL en el que se proporcionará material específico de seguimiento.

PROGRAMA DEL CURSO:

1.- Provisiones Técnicas.

1.1.- Modelización del Pasivo (ALM).

- Rentas.
- Productos de ahorro con prima periódica.

1.2.- Gestión ALM.

- Evolución temporal.
- Hipótesis y escenarios.
- Relación con Solvencia II e IFRS.

2.- Inversiones Financieras y ALM

2.1.- Gestión Activo y Pasivo (ALM).

- Componentes del activo: tipología de instrumentos financieros.
- Gestión ALM.
- Excedente y riesgo del excedente.

2.2.- Tipo de Interés para el cálculo de la provisión (ROSSP).

- Artículo 33.1: Tipo DGS.
- Artículo 33.2.a: Casamiento de Flujos.
- Artículo 33.2.b: Inmunización por duraciones.

2.3.- Solvencia II:

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

2.4.- Implicaciones derivadas de la aplicación de la norma contable IFRS 17

4.- MATRÍCULA

Cuota de inscripción (euros) – IVA del 21% NO INCLUIDO

Miembros Titulares y trabajadores de Miembros Protectores	Miembros Titulares en paro y estudiantes	Otros
250	125	375

El precio incluye la asistencia al curso y pausa café.

Lugar de celebración:

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

Fecha: 19 de junio de 2019

Horario: de 9:00h a 14:00h

Forma de pago:

Forma de pago: transferencia bancaria a:

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

Si desean factura a nombre de la empresa, han de indicar CIF, nombre, dirección, teléfono, persona de contacto y dirección de correo electrónico.

5.- INSCRIPCIONES

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

6.- CPD

El curso computará 5 horas a los efectos de la acreditación de la formación continuada del Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CPD).

Se exige una asistencia mínima del 80% para la obtención del **Diploma de Aprovechamiento**.

Con la colaboración de:

