

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

CURS GESTIÓ D'ACTIUS I PASSIUS EN ENTITATS ASSEGURADORES

1.- Objectius del curs

El curs, de **4 hores** de durada, en modalitat online, es durà a terme els **dies 29 i 30 de gener de 2025**, de 18.00 a 20.00 hores, organitzat pel Col·legi d'Actuaris de Catalunya, amb la col·laboració de **Serfiex**.

A causa dels moviments de tipus d'interès que s'estan produint durant els darrers anys i després de diversos anys amb tipus d'interès molt reduïts, una de les principals preocupacions de les companyies d'assegurances és fer una gestió ALM adequada que permeti controlar el càlcul de la provisió matemàtica sota criteris comptables i en el descompte dels fluxos de passius BEL, que afecten l'import de l'excedent financer sota Solvència II (Volatility Adjustment i Matching Adjustment), a més de les implicacions derivades de la posada en marxa de la norma comptable IFRS 17.

L'Objectiu del curs és oferir als assistents una visió general a través d'exemples pràctics de la gestió ALM òptima a 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 detalladament la gestió ALM, des d'una visió tècnica (actuarial) i des d'una visió financera, així com els impactes de la nova norma comptable IFRS 17.

Al Curs es tractaran amb detall els punts següents:

- Modelització dels productes de passiu.
- Tipologia d'instruments financers i 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 seues metodologies de càlcul sota criteris de Solvència II per als fluxos de passiu: corba Eiopa, Volatility Adjustment i Matching Adjustment.
- Implicacions per a IFRS 17.

Es tracta d'un curs eminentment pràctic, basat en exemples a EXCEL en què es proporcionarà material específic de seguiment.

3.- Ponents

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

- **Jordi Payés**, Director de l'Àrea Actuarial de Serfiex.
- **Enrique Abuín**, Director de l'Àrea Financera de Serfiex.

4.- Programa

1.- Provisions Tècniques.

1.1.- Modelització del Passiu (ALM).

- Rendes.
- Productes d'estalvi amb prima periòdica.
- Opcions i garanties (determinista vs estocàstic)

1.2.- Gestió ALM.

- Evolució temporal.
- Hipòtesis 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 DGSFP.
- 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.- IFRS 17 i IFRS 9

- Càlcul de la provisió actual vs IFRS 17.
- Corbes de descompte: Corba Risk Free, Metodologia Top-Down, Metodologia Bottom-Up.
- Càlcul de l'Expected Credit Loss (ECL).

5.- Matrícula

Quota d'inscripció (euros) – IVA del 21% NO INCLÒS

Membres Titulars i treballadors de Membres Protectors	Membres Titulars a l'atur i estudiants	Altres
175	90	350




El preu inclou l'assistència al curs en línia i els materials del curs.

Forma de pagament:

Transferència bancària al Col·legi d'Actuaris de Catalunya
IBAN: ES40 0081 0057 3100 0118 8927

Si voleu factura a nom d'una empresa heu d'indicar CIF, nom, adreça, telèfon, persona de contacte i adreça de correu electrònic.

6.- Requeriments Tècnics

-  Sistema: [Cisco Webex Meetings](#).
-  Accés: Enllaç enviat prèviament per correu electrònic.
-  Connexió: Assegureu-vos d'una connexió a internet estable.

7.- Inscripcions

Inscripció abans del 27 de gener de 2025 a través de:

 www.actuaris.org

 actuaris@actuaris.org

Les persones inscrites rebran una invitació per correu electrònic abans del dia del webinar.

8.- CPD

El curs computarà **4 hores** als efectes de l'acreditació de la formació continuada del Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CPD).

Amb la col·laboració de:

The logo for serfieX, featuring the word "serfie" in a dark red serif font and "X" in a lighter red sans-serif font, with a thin grey line extending from the top of the "X" to the right.