



Wstęp

Z przyjemnością przekazujemy Państwu szósty numer naszego Newslettera. Jednym z wydarzeń, o których informujemy były obchody XX lecia Polskiego Stowarzyszenia Aktuariuszy.

Chcielibyśmy gorąco zachęcić wszystkich członków PSA i odbiorców Newslettera do przesyłania swoich wypowiedzi oraz komentarzy, dotyczących zarówno bieżącej treści naszej publikacji jak również spraw, które mogą zaciekać nasze środowisko, a o których czy to zapomnieliśmy czy też z braku informacji nie mogliśmy napisać. Wszystkie Wasze głosy przedstawimy chętnie w kolejnej publikacji Newslettera.

Życzymy miłej lektury!

Charles Levi, Jacek Skwierczyński

I. PSA na forum międzynarodowym

1. Współpraca z IAA (Międzynarodowym Stowarzyszeniem Aktuariuszy)

W spotkaniu IAA w Zagrzebiu uczestniczył Charles Levi. Zanotowano rekordową liczbę 250 uczestników.

Charles Levi uczestniczył w pracach komitetu Reasekuracja i komitetu ERM. Został wybrany na członka grupy roboczej wypracowującej standardy dotyczące ERM.

W ramach President's Forum odbyła się dyskusja na temat głównych celów strategicznych:

- supranational relations: kontakty z międzynarodowymi organizacjami jak OECD
- share of skills: biblioteka internetowa, webinary
- profesjonalizm i standardy zawodu, włączając CPD; (ciekawe pytanie, gdzie nie ma obowiązkowego CPD? Odpowiedź na końcu Newslettera).

Wymieniono informacje na temat governance of associations; struktury związków i sposobu podejmowania decyzji. Zostały przedstawione 2 prezentacje na temat etyki Aktuariusza

W radzie było reprezentowane 41 stowarzyszeń przez swoich Prezesów/Wice Prezesów lub Sekretarzy.

Omówiono następujące sprawy

- Kwestia pracy trans-granicznej aktuariuszy (potrzeba wytycznych).
- Tim Bishop (OECD) przedstawił prezentację nt. współpracy OECD-IAA
- Zasady profesjonalizmu dla Aktuariuszy
- Wytyczne do CPD

Desmond Smith z RPA został wybrany Prezydentem IAA na rok 2012 r., Kurt Wolfsdorf z Niemiec został IAA Prezydentem-elektem.

Następne spotkanie odbędzie się w Los Angeles 23-26 maja 2012 r.

2. Współpraca z Groupe Consultatif

Piotr Szlenk i Łukasz Delong reprezentowali PSA na Zjeździe Groupe Consultatif w Pradze w dniach 20-21 października 2011.

- Standardy

Groupe Consultatif opracuje standardy aktuarialne. W tym celu działa grupa robocza SPT (Standards Project Team). Stowarzyszenia mogą (i będą) wprowadzać swoje standardy. Standardy GC powinny być traktowane jako „benchmark”.

GC nie będzie duplikować ani być w sprzeczności ze standardami EIOPA. Dodatkowo, również IAA wprowadza swoje standardy i GC również nie chce ich powielać.

Standardy, na których skupić się chce GC to standardy dotyczące jakości pracy aktuarialisty oraz standardy raportowania przez „funkcję aktuarialną”.

- Członkostwo w Groupe Consultatif

Będzie wdrażany proces sprawdzania czy stowarzyszenia spełniają warunki członkostwa w GC.

Stowarzyszenia mają być oceniane co roku na podstawie prostego kwestionariusza oraz co 5 lat na podstawie bardziej szczegółowego kwestionariusza. Ocena GC ma zastąpić ocenę IAA.

Stowarzyszenia, które zostaną pozytywnie ocenione przez GC będą automatycznie uznawane przez IAA.

- Kwestie strategiczne

Dzięki przeniesienia siedziby GC do Brukseli, GC będzie bardziej aktywna w Brukseli.

Zatrudniono specjalistę ds. PA (Public Affairs).

Kontakty z CEA (Europejskie „PIU”) zostaną wzmożone.

- Sylabus

Został zaakceptowany nowy sylabus wskazujący zakres tematów niezbędnych w edukacji aktuarialnej. Edukacja aktuarialna członków stowarzyszenia powinna się kończyć wybraniem specjalizacji w obrębie nauk aktuarialnych. Stowarzyszenia mają się wypowiedzieć ile czasu będą potrzebować, aby dokonać zmian w programach nauczania. Następnie zostanie uzgodniony termin wprowadzenia i egzekwowania nowych wymagań edukacyjnych. GC zwróci się do IAA z postulatem, aby IAA automatycznie akceptowało program nauczania stowarzyszenia jeżeli ten program spełnia wymogi GC.

- Szkoły letnie

Część stowarzyszeń wyraziła potrzebę, żeby letnie szkoły aktuarialne organizowane przez te stowarzyszenie odbywały się pod patronatem GC. Potrzeba certyfikowanie letnich szkół oraz warsztatów aktuarialnych przez GC będzie dyskutowana na kolejnych spotkaniach.

- W czerwcu 2012 roku odbędzie się w Brukseli Pierwszy Kongres Aktuarialny.

3. Spotkanie z Zarządem Niemieckiego Stowarzyszenia Aktuarialistów (DAV) w Kolonii w dniu 29 lipca 2011

W dniu 29 lipca 2011 r. delegacja PSA w składzie: Piotr Szlenk, Piotr Borowski, Wojciech Mojżuk oraz Marcin Łuczyński spotkała się z przedstawicielami niemieckiego stowarzyszenia aktuarialnego DAV. Ze strony Stowarzyszenia DAV w spotkaniu wzięło udział 5 osób: Johannes Lörper, Rainer Fürhaupter, Kurt Wolfsdorf, Michael Steinmetz, Birgit Kaiser. Tematem rozmów była głównie wymiana informacji na temat stowarzyszeń DAV oraz PSA.

Kolejne spotkanie PSA z DAV zostało zaplanowane na lato 2012.

II. Działalność w kraju.

1. XX-lecie PSA

W środę 7 grudnia w warszawskim Teatrze Kamienica odbył się uroczysty jubileusz 20-lecia Polskiego Stowarzyszenia Aktuariuszy (PSA).

Przybyło ponad 100 osób. Wśród gości, poza licznie reprezentowanymi członkami Stowarzyszenia, znaleźli się między innymi: Jan Grzegorz Prądyński – prezes Polskiej Izby Ubezpieczeń, Adam Sankowski – prezes Polskiej Izby Pośredników Ubezpieczeniowych i Finansowych oraz przedstawiciele Ministerstwa Finansów, Zakładu Ubezpieczeń Społecznych i Towarzystw ubezpieczeniowych. Wieczór uświetniła również obecność profesora Eugeniusza Stroińskiego oraz innych wybitnych przedstawicieli polskich uczelni wyższych. Uroczystość prowadził prezes PSA Piotr Szlenk.

Podczas gali wręczono nagrody dla najbardziej zasłużonych członków PSA:

Pierwszy Zarząd PSA: Krzysztof Stroiński (Prezes) Agnieszka Piotrowska (Sekretarz) Olga Doan (Skarbnik)

Pozostali założyciele PSA z którymi udało skontaktować się: Profesor dr habilitowany Eugeniusz Stroiński, Danuta Wałcerz, Hanna Zalewska, Ryszard Sitarski, Juliusz Bieńkowski, Krzysztof Galas, Anna Plucińska, prof. Stanisław Wieteska, Tomasz Klimkiewicz, Ilona Kramarska i Jadwiga Dydycz

Drugi Prezes PSA (1996-2001): Michał Górski

Wyróżniono także Renatę Onisk: Skarbnika i członka zarządu PSA za nadzór nad finansową sprawozdawczością Stowarzyszenia i Piotra Szlenka Prezesa PSA za jego wkład w rozwoju Stowarzyszenia.



Po części oficjalnej wystąpił Emilian Kamiński w monodramie „W obronie jaskiniowca”. Wieczór zakończył się kolacją, która była okazją do snucia wspomnień, wymiany doświadczeń i odświeżenia wzajemnych relacji.

W związku z obchodami XX-lecia PSA pokazany został film nt. powstania i rozwoju stowarzyszenia oraz historii aktuariatu w Polsce. Film jest dostępny na stronie internetowej PSA

2. Wykład Techniki Aktuarialne

Wykład jest prowadzony przez Łukasza Delonga, Andrzeja Kwasowa i Marcina Zwarę.

Wykład rozpoczął się w połowie października 2011 roku i składa się z cyklu 15 spotkań 8-godzinnych w kolejne soboty.

Na wykład zgłosiło się 50 uczestników.

3. Spotkanie PSA.

Trzecie tegoroczne spotkanie odbyło się 26 września. W pierwszej części Pan Bradleya Smith z firmy aktuarialnej Milliman wygłosił prelekcję na temat „Managing Enterprise Risk”. Druga część spotkania poświęcona była prezentacji Eda Morgana z tej samej firmy na temat „Financial modelling in Solvency 2”.

4. Nowi członkowie PSA

Z przyjemnością informujemy, że do grona PSA dołączyli (stan na 14 grudnia 2011 roku):

Wiktor Bandkowski, Członek Stowarzyszony

Emil Durski, Członek Rzeczywisty

Jacek Korytkowski, Członek Stowarzyszony

Paweł Miś, Członek Stowarzyszony
Andrzej Smoliński, Członek Rzeczywisty
Michał Stańczuk, Członek Stowarzyszony
Michał Suchan, Członek Rzeczywisty
Ruzica Walkiewicz, Członek Aspirant

Gratulujemy!

5. List do Ministra Finansów w sprawie tzw. dualizmu rezerw techniczno – ubezpieczeniowych

Zagadnienie to jest związane z trwającymi pracami nad wdrożeniem dyrektywy *Wypłacalność II* do polskich regulacji prawnych. W ramach tych prac wystąpił problem rezerw techniczno – ubezpieczeniowych. W jednym z obecnych projektów nastąpiła próba zamiany dotychczasowych rezerw techniczno-ubezpieczeniowych funkcjonujących w standardach zasad rachunkowości przez rezerw w myśl definicji takiej jaka występuje w Dyrektywie Parlamentu Europejskiego i Rady tzw. *Wypłacalność II*.

W trakcie prac m.in. grupy roboczej PSA ds. Solwency II opracowano stanowisko dotyczące tzw. dualizmu rezerw, w myśl, którego inne rezerwy będą rezerwami obowiązującym w ramach zasad rachunkowości, a inne w ramach wypłacalności.

Pismo w tej sprawie zostało przekazane Ministerstwu Finansów na początku października.

6. Izba Aktuarialna działania PR

W związku z planowaną akcją promocji Izby Aktuarialnej oraz środowiska aktuariuszy, Zarząd podpisał umowę o świadczenie usług PR z firmą Synergy Concepts.

Działania promujące Izbę Aktuarialną wśród masowego przekazu zaczęły się na połowie listopada.

7. Aktuariusz Krajowy.

Piotr Szlenk reprezentował stanowisko PSA z zastrzeżeniem przedstawienia różnicy zdań wśród członków na spotkaniu dotyczącym Aktuariusza Krajowego w Kancelarii Prezydenta 19 października.

W listopadzie sporządzono uwagi do projektu ustawy powołującej Aktuariusza Krajowego. Przesłano do Biura Polityki Społecznej. Są to m.in. następujące uwagi:

- Aktuariusz Krajowy powinien podlegać Prezydentowi,
- Aktuariusz Krajowy powinien być licencjonowanym aktuariuszem,
- Rada nadzorująca działania Aktuariusza Krajowego powinna zawierać niezależnego eksperta specjalizującego się w naukach aktuarialnych.

8. Udział w konferencjach naukowych

Członkowie PSA wygłosili referaty na następujących konferencjach naukowych:

- Insurance: Mathematics and Economics, Triest, czerwiec 2011

Dr Łukasz Delong, "No-good-deal, local mean variance and ambiguity risk pricing and hedging for an insurance payment process"

Dr Przemysław Klusik, "Quantile hedging of derivatives contingent on non-tradable asset".

- Konferencja naukowa: zagadnienia aktuarialna, Warszawa, czerwiec 2011

Dr Grzegorz Darkiewicz: „Stopy dyskonta w rynkowej wycenie pasywów: najnowsze trendy w Solvency II i MCEV” (referat plenarny)

Prof. dr hab. Wojciech Otto: „Pomiar ryzyka odchylenia od benchmarku w warunkach zmiennej w czasie strategii inwestycyjnej”

- Konferencja Matematyki Ubezpieczeń i Inwestycji, Łódź, październik 2011

Prof. dr hab. Wojciech Otto: „Jaki będzie kształt świadczeń emerytalnych ze środków gromadzonych w OFE” (wykład plenarny)

Polskie Stowarzyszenie Aktuariuszy objęło patronat honorowy nad Konferencją Matematyki Ubezpieczeń i Inwestycji, która odbyła się w październiku w Łodzi.

9. Wyróżnienia

Łukasz Delong, w związku ze swoją pracą naukową w zakresie matematyki ubezpieczeniowej i finansowej, otrzymał nagrodę Ministra Nauki i Szkolnictwa Wyższego dla wybitnych młodych naukowców.

10. Sprawy różne

Kalendarz planowanych wydarzeń w drugiej połowie 2011 roku:

- Walne Zgromadzenie w drugiej połowie marca 2012 roku
- Kolejny numer Newslettera planowany jest na początku lipca 2012 roku.