

Sprawozdanie z działalności merytorycznej Polskiego Stowarzyszenia Aktuariuszy za rok 2016.

I. Działalność statutowa

I. PSA na forum międzynarodowym

1. Współpraca z IAA i AAE.

- Przedstawiciele PSA brali udział w spotkaniu AAE w Londynie i Barcelonie. Łukasz Delong uczestniczył w pracach Komitetu ds. Edukacji (Londyn, Barcelona), Anna Kwiecińska w pracach Komitetu ds. Ubezpieczeń Emerytalnych (Londyn), Marcin Zwara w pracach Komitetu ds. Ryzyka (Londyn).
- Jacek Skwierczyński brał udział w zjeździe IAA w St. Petersburgu.
- W sprawie głosowania za przyjęciem nowego sylabusu IAA, wstrzymaliśmy się od głosu z uzasadnieniem, że wymóg procentowy dostosowania egzaminów do sylabusu jest zbyt wysoki oraz że nowy sylabus IAA kładzie zbyt duży nacisk na aspekty finansowe i ekonomiczne. Nowy sylabus edukacyjny został przyjęty przez IAA w Cape Town i ma wejść w życie w latach 2020-tych. 75% stowarzyszeń wypowiedziało się na tak. Podstawowe zgłoszone zastrzeżenia, to: część inwestycyjna zbyt szeroka i niewłaściwa dla wszystkich rynków, czas implementacji sylabusu powinien być rozłożony na wiele lat. Będą kontynuowane prace nad sylabusem IAA w kierunku, który ma być satysfakcjonujący dla wszystkich stowarzyszeń.
- Spotkania Komitetu Edukacji AAE dotyczyły planów rewizji sylabusu edukacyjnego dla stowarzyszeń europejskich, która powinna nastąpić po tym jak IAA wprowadziło nowy sylabus edukacyjny.

2. Europejski Kongres Aktuarialny w Brukseli

W dniach 21-22 kwietnia 2016 r. został zorganizowany drugi Europejski Kongres Aktuarialny ECA. Sławomir Sadowski brał udział w Kongresie. W trakcie kongresu odbyło się wiele sesji plenarnych, a także sesji równoległych, w których wystąpiło 35 prelegentów. Głównymi tematami prezentacji były aspekty nowych wyzwań i możliwości zawodu aktuarusza wynikające ze zmieniającego się otoczenia, w szczególności nowych technologii, wielkich baz danych, nowych ryzyk (cyber risk, environmental risks) a także zmieniających się regulacji prawnych (Solvency II).

3. Spotkanie Prezesów Stowarzyszeń w Brukseli

Na spotkaniu prezesów europejskich stowarzyszeń aktuarialnych omawiane były strategiczne cele AAE, zwracano uwagę na dublowanie się strategii IAA i AAE, sugerowano by AAE zajmowało się głównie kwestiami szczególnymi dotyczącymi Europy pozostawiając kwestie światowe dla IAA. Sugerowano, że stowarzyszenia działają reaktywnie w stosunku do zmian legislacyjnych i sugerowano nawiązanie bezpośrednich kontaktów z europarlamentarzystami. Dwa stowarzyszenia: niemieckie i brytyjskie podnosiły kwestię stałej obecności ich przedstawiciela w zarządzie AAE (niemieckie) lub liczby głosów (brytyjskie). W kulkarach omawiane było ryzyko (m. in. Finansowe) dla AAE wynikające z brexitu – decyzji brytyjskiego stowarzyszenia dotyczącej pozostania w 2 organizacjach: IAA i AAE. Jacek Skwierczyński sugerował rozpatrzenie zmiany formuły liczby głosów w AAE – analogicznie do formuły stosowanej w IAA.

4. Współpraca z EAJ Association

Sławomir Sadowski uczestniczył w spotkaniu Zarządu European Actuarial Journal w Brukseli (w zastępstwie Łukasza Delonga). Łukasz Delong został zaakceptowany jako członek Zarządu EAJ Association. Łukasz w ramach Zarządu jest współodpowiedzialny za organizację konferencji EAJ. Spotkania Zarządu EAJ odbywają się w formie telekonferencji. W październiku Łukasz Delong brał udział w telekonferencji. Podczas telekonferencji jako główny problem wskazano słaby marketing i jako kluczowy cel strategiczny obrano propagowanie czasopisma w branży aktuarialnej i środowisku naukowym. Składka PSA na rzecz Zarządu EAJ Association wynosi 100 EUR.

5. Organizacja Konferencji ASTIN

Jacek Skwierczyński otrzymał zapytanie od Agnieszki Bergel czy PSA byłoby zainteresowane zorganizowaniem konferencji ASTIN w Polsce w 2020. Konferencja ASTIN jest jedną z dwóch najważniejszych i największych konferencji aktuarialnych skierowanych do praktykujących aktuariuszy i pracowników naukowych na świecie. Zarząd wyraził chęć pomocy w organizacji konferencji, jednak bez ponoszenia kosztów finansowych i partycypacji w zyskach (forma co-sponsoringu proponowana przez ASTIN)

II. Działalność PSA w kraju

1. Nowe Egzaminy Aktuarialne KNF

Po wielu próbach kontaktu z KNF w sprawie nowych egzaminów aktuarialnych i ich zakresu, w październiku 2016 r. Łukasz Delong spotkał się z Lesławem Gajkiem i Beatą Balutą. Podczas spotkania został dopracowany ostateczny zakres egzaminów aktuarialnych. Egzamin składać się będzie z 9 części: 7 części testowych i 2 opisowych. Zakres nowego egzaminu KNF będzie bardzo bliski wymogów AAE i IAA, co pozwoli nam spełnić wymogi edukacyjne AAE i IAA. Niestety KNF nie podjął się jeszcze organizacji nowych egzaminów i powołania nowej komisji egzaminacyjnej. Zarząd wyraża chęć współpracy w przygotowaniu przykładowych egzaminów.

2. Letnia Szkoła Nauk Aktuarialnych

W dniach 8-15 września odbyła się 27 edycja Letniej Szkoły Nauk Aktuarialnych. Program składał się z trzech kursów: „Modele wewnętrzne”, „Rezerwy majątkowe” oraz „Metody Analizy Przeżyć”. Największym zainteresowaniem cieszył się pierwszy wykład. Oceny uczestników z ankiet były pozytywne. W tym roku członkom PSA, którzy zgłosili się na wykłady, udzielono 10% zniżki w opłacie.

3. Spotkania PSA

- Walne Zebranie odbyło się 18 kwietnia.
- 13 grudnia odbyło się spotkanie świąteczne członków PSA, podczas którego wygłoszono referat „IFRS 17: Closer than it appears”.
- 25 stycznia 2017 styczniu odbyło się spotkanie PSA, podczas którego Ewa Dylewska wygłosiła referat nt. swoich prac w Komitecie ds. Śmiertelności w IAA

4. Szkolenia dla sędziów

Zostało wysłane pismo do Krajowej Szkoły Sądownictwa i Prokuratury z ofertą poprowadzenia szkolenia nt. konstrukcji produktów ubezpieczeniowych. Nasza propozycja została odrzucona.

5. Zmiany w statucie PSA

- Wprowadzenie obowiązku CPD jedynie dla członków rzeczywistych, dla innych kategorii członków na zasadzie dobrowolności;
- Ograniczenie wymagań CPD do poziomu niższego niż w pierwotnej rekomendacji;
- Zobowiązanie Zarządu PSA do zapewnienia szkoleń bezpłatnych dla członków w ilości (łącznie z letnią szkołą nauk aktuarialnych) w wysokości co najmniej 1,5 razy wymaganie CPD w okresie rozliczeniowym CPD.
- Wyłącznie ilościowych wymagań CPD z treści statutu do osobnego dokumentu przyjmowanego uchwałą Zarządu. Konieczne jest stopniowe zwiększanie wymogów ilościowych, by członkowie mogli je spełnić. Wśród proponowanych wielkości dyskutowano wielkości od 5 godzin rocznie do 20 godzin w okresie 2 lat.
- Wersja ostateczna proponowanych zmian została zaaprobowana przez Zarząd, przedstawiona Członkom i podlegać będzie jedynie weryfikacji pod względem prawnym.

6. Stanowisko w sprawie tematów zgłoszonych na Radę Rozwoju Rynków Finansowych

Uzgodniono, że PSA będzie rekomendowało Radzie Rozwoju Rynków Finansowych następujące inicjatywy:

- Inicjatywę 17 - Dokonanie przeglądu skutków wprowadzenia podatku od niektórych instytucji finansowych dla polskiego sektora finansowego, konsumentów i gospodarki narodowej oraz przygotowanie ewentualnych propozycji zmian legislacyjnych w zakresie tego podatku.
- Inicjatywę 19 - Wprowadzenie działań edukacyjnych w zakresie funkcjonowania rynku finansowego.
- Inicjatywę 25 - Działania na rzecz stworzenia w Polsce regionalnego centrum innowacji finansowej (FinTech) w Europie Środkowo-Wschodniej.

Rekomendacje są odpowiedzią na pismo Ministerstwa Finansów przesłane do wszystkich członków RRRF zgodnie z ustaleniami podjętymi podczas posiedzenia Rady w dniu 25 kwietnia 2016.

Przedstawicielami PSA w grupie roboczej dotyczącej działań edukacyjnych zostali Paweł Miś i Jakub Kolecki. Propozycje tematów edukacyjnych zostaną przesłane do dnia 18 04 2017.

7. Sprawy różne

- W czerwcu 2016 zakończył się wykład „Wybrane techniki aktuarialne”. Kurs prowadzili Adam Pasternak-Winiarski oraz Łukasz Delong. Obaj prowadzący dostali bardzo wysokie oceny od słuchaczy. W wykładzie wzięło udział ok. 50 osób.
- W październiku 2016 rozpoczął się 30 godzinny kurs z Mikroekonomii dla osób, którzy chcą zostać członkami rzeczywistymi PSA. Wykład prowadził dr hab. Mariusz Próchniak, prof. SGH. W wykładzie wzięło udział ok. 50 osób.
- Jacek Skwierczyński spotkał się z Kolem Naukowym Prawnym w Białymstoku.
- PSA oficjalnie zmieniło swoją siedzibę. Od dnia 2016-10-15 siedziba PSA jest adres Deloitte: Warszawa ul. Jana Pawła II 22, 00-133 Warszawa.

Sprawozdanie z działalności merytorycznej PSA za rok 2016

Warszawa 18 kwietnia 2017 roku

.....
Jacek Skwierczyński
Prezes

.....
Renata Onisk
Skarbnik

.....
Łukasz Delong
Sekretarz

.....
Jacek Wiśniewski
Członek

.....
Witold Florczak
Członek

.....
Sławomir Sadowski
Członek

.....
Wojciech Mojżuk
Członek