

Tijden dag 1	Programmaonderdeel
09.00 – 09.30	Inloop
09.30 – 10.45	Financiële opzet van een pensioenfonds en FTK <ul style="list-style-type: none"> • Balansopstelling en solvabiliteit <ul style="list-style-type: none"> o Technische voorzieningen o Solvabiliteitsbuffer o Waarderingsgrondslagen • Resultatenrekening en sturingsinstrumenten <ul style="list-style-type: none"> o Financiering, grondslagen en reservering o Premie, indexatie, pensioenopbouwpercentage, beleggingsstrategie • Beleidskader en vastlegging beleid <ul style="list-style-type: none"> o Financieel Toezichtkader o Vereist eigen vermogen o ABTN functie o Herstelplan/financieel crisisplan o Minimaal vereiste dekkinggraad o Evenwichtige belangenafweging o Besluitvormingsproces o Rol van ALM
10.45 – 11.00	Pauze
11.00 – 12.45	Financiële opzet van een pensioenfonds – vervolg
12.45 – 13.45	Lunch
13.45 – 15.15	ALM voor DB en DC <ul style="list-style-type: none"> • Risicohouding • Rendementstoerekening
15.15 – 15.30	Pauze
15.30 - 17.00	ALM voor DB en DC - vervolg
17.00 – 17.30	Snack
17.30 - 19.00	Beleggingsproces <ul style="list-style-type: none"> • 5 stappen op hoofdlijnen • Rendementsdoel/beleggingsdoel • Risicotolerantie
19.30	Diner



Tijden dag 2	Programmaonderdeel
09.00 – 10.00	Strategisch beleggingsbeleid <ul style="list-style-type: none"> • Investment beliefs <ul style="list-style-type: none"> o Actief/Passief beheer
10.00 – 10.15	Pauze
10.15 – 11.30	Strategisch beleggingsbeleid – vervolg <ul style="list-style-type: none"> • Maatschappelijk verantwoord beleggen
11.30 – 11.45	Pauze
11.45 – 13.00	Strategisch beleggingsbeleid - vervolg <ul style="list-style-type: none"> • Strategisch Asset Allocatie <ul style="list-style-type: none"> o Toepassing van beleggingscategorieën in de portefeuille
13.00 – 14.00	Lunch
14.00 – 15.15	Strategisch beleggingsbeleid - vervolg <ul style="list-style-type: none"> • Renterisico <ul style="list-style-type: none"> o Risicomanagement en belangrijke financiële risico's op balans o Risicobudgettering o Strategievorming o Stress scenario's en risicobudget o Instabiliteit van economie o Expliciet en realistisch beleid
15.15 – 15.30	Pauze
15.30 – 17.30	Balansrisicomanagement en gebruik van derivaten <ul style="list-style-type: none"> • Welke balansrisico's kunnen ontstaan? • Waarom risico's afdekken? • Wat zijn derivaten? • Wat zijn wettelijke regels voor derivaten? • Tegenpartijrisico • Afdekken van valuta en renterisico
17.30 – 17.45	Snack
17.45 - 19.30	Balansrisicomanagement en gebruik van derivaten - vervolg
20.00	Diner



<i>Tijden dag 3</i>	<i>Programmaonderdeel</i>
09.00 – 10.30	Implementatie beleggingsbeleid <ul style="list-style-type: none">• Uitbesteding• Managers selectie
10.30 – 10.45	Pauze
10.45 – 12.00	Implementatie beleggingsbeleid – vervolg
12.00 – 13.00	Lunch
13.00 – 14.00	Evaluatie beleggingsbeleid en uitbesteding <ul style="list-style-type: none">• Rapportage en monitoring
14.00 – 14.30	Pauze
14.30 – 16.30	Pensioen Sim

