

Temas de Matemática Actuarial: Gestión de Riesgos Actuariales

1 - Teoría del riesgo individual y reaseguro.

1. Teoría del riesgo individual.
 - Aplicaciones del teorema central del límite.
 - Cálculo del VaR y del recargo de seguridad.
 - Simulación de Monte Carlo.
2. Reaseguro.
 - Modalidades.
 - Cálculo de primas.
 - El reaseguro como activo derivado.

2 - Reaseguro óptimo y sistema bonus - malus.

1. Reaseguro óptimo.
 - Reaseguro óptimo cuota – parte.
 - Reaseguro óptimo *stop – loss*.
 - Reaseguro óptimo general.
2. Sistema Bonus – Malus.
 - Distribuciones conjugadas básicas.
 - Gamma - Poisson – Gamma.
 - Beta - Binomial – Beta.
 - Distribuciones conjugadas discretas.

3 - Solvencia II.

1. Tipos de riesgo y y correlación entre los mismos.
2. Algunas cópulas no gaussianas.
3. VaR y CVaR para cópulas gaussianas y no gaussianas.
4. Reservas y requerimientos de capital. Estimaciones SCR y MCR.
5. Métodos internos.
6. Técnicas básicas de estimación de provisiones IBNR.

A5: Aplicaciones actuariales usando Excel/VBA II. Profesor Alejandro Balbás de la Corte
Experto UCM en Programación VBA con Excel Aplicada a CC. Actuariales y Financieras - Curso 2012-2013
Universidad Complutense de Madrid