



---

# Cursos de Formació

## CERA

(Chartered Enterprise Risk Actuary)

### **MÒDUL 0 : QUANTITATIVE METHODS FOR ERM. BRIDGING AND REFRESHER COURSE.**

SETEMBRE 2018

---

Via Laietana 32 4a planta - 08003 Barcelona - Tel: + 34 93 319 18 ago - e-mail: [actuaris@actuaris.org](mailto:actuaris@actuaris.org)

[www.actuaris.org](http://www.actuaris.org)

CP LOCALITAT DE L'INTERNATIONAL  
ACTUARIAL ASSOCIATION



International Actuarial Association  
Association Actuarielle Internationale

CP LOCALITAT DE L'GROUPE consultatif  
ACTUARIEL Européen



---

## **MÒDUL 0: QUANTITATIVE METHODS FOR ERM. BRIDGING AND REFRESHER COURSE.**

### **1.- INTRODUCCIÓ.**

Ens complau presentar-vos el seminari "**Quantitative Methods for ERM. Bridging and Refresher course**" que portarà a terme l'European Actuarial Academy (EAA) a Barcelona els dies 10 i 11 de desembre de 2018, en col·laboració amb el Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CAC).

L'EAA va ser fundada l'any 2005, per iniciativa dels col·legis d'actuaris d'Alemanya, Àustria, Holanda i Suïssa. En aquest moment és un dels centres d'estudi per actuaris de més prestigi d'Europa, impartint formació a actuaris de tot el continent.

### **2.- OBJECTIUS DEL CURS.**

El seminari, de 1.5 dies de durada, té un doble objectiu:

- D'una banda, és un curs d'introducció dissenyat per preparar els actuaris amb una base més qualitativa, necessària per a les posteriors parts quantitatives de la formació CERA.
- D'altra banda, és un curs d'actualització independent, per actuaris que volen millorar les seves habilitats quantitatives en els camps de gestió de riscos empresarials (ERM) i matemàtica financera.

### **3.- TEMÀTICA DEL CURS.**

El seminari comença amb una introducció a les mesures de risc. Es tractarà del Value at Risk (VaR) i el dèficit esperat i es donarà una introducció a la teoria moderna de les mesures de risc coherent. Per tal de preparar l'anàlisi dels riscos dependents, a continuació es discutiran els conceptes bàsics del modelatge multivariant.

El curs continuarà amb una introducció a les matemàtiques financeres. Es començarà amb l'estudi de la valoració de risc neutral i la cobertura de derivats en models discrets i se seguirà amb una introducció a les matemàtiques financeres en temps continu.

Les matèries cobertes inclouen el mètode Brownià i la fórmula Ito, el model Black Scholes i el preu d'accions i bons.

El seminari consisteix en classes teòriques i exercicis pràctics, que ajudin els participants a comprendre les tècniques qualitatives i quantitatives introduïdes a les classes.

### **4.- PARTICIPANTS.**

El seminari està obert a totes les persones que estiguin interessades a aprofundir les seves habilitats quantitatives en els camps de la gestió de riscos empresarials (ERM) i les matemàtiques financeres.

Durant el seminari, no necessitarà portar ordinador portàtil.

El seminari s'impartirà en **anglès** i computarà 11 hores a l'efecte del CPD del CAC (programa de formació continuada).



La tarifa d'inscripció anticipada és de € 790,00 més el 21% d'IVA i és vàlida fins al 10 d'octubre de 2018. A partir d'aquesta data, la tarifa serà de 970,00 euros més el 21% d'IVA.

## **5.- PROGRAMA.**

### Dilluns, 10 desembre 2018

8:45-09:00	Registration
9:00-09:15	Introduction and welcome (EAA)
9:15-10:45	Introduction to Risk Measures
10:45-11:00	Coffee Break
11:00-11:45	Exercise Session 1
11:45-13:00	Basics of Multivariate Modelling
13:00-14:15	Lunch
14:15-14:45	Exercise Session 2
14:45-15:45	Risk Neutral Valuation
15:45-16:00	Coffee Break
16:00-16:30	Risk Neutral Valuation
16:30-17:30	Exercise Session 3

### Dimarts, 11 desembre 2018

9:00-11:00	Introduction to continuous-time finance
11:00-11:15	Coffee Break
11:15-00:00	The Black Scholes Model and Applications
12:00-13:00	Exercise Session 4
13:00-14:15	Lunch

## **6.- INSCRIPCIONS.**

Les inscripcions es realitzaran directament a través de la pàgina web de l'EAA

[www.actuarial-academy.com](http://www.actuarial-academy.com)

Per a qualsevol dubte sobre el seminari es poden adreçar al Col·legi d'Actuaris de Catalunya, a l'atenció del Sr. Joaquim Celma ([jcelma@actuaris.org](mailto:jcelma@actuaris.org)), gerent del CAC

## **7.- CPD.**

El curs computarà 11 hores als efectes del Programa de Formació Continuada (CPD) del Col·legi d'Actuaris de Catalunya.

Data d'inici: 10 desembre 2018.

Data de final: 11 de desembre de 2018

Adreça:

Hotel Sallés Pere IV  
Carrer Pallars, 128-130  
08018 - Barcelona -

Barcelona 17 de setembre de 2018

Via Laietana 32 4a planta - 08003 Barcelona - Tel: + 34 93 319 18 ago - e-mail: [actuaris@actuaris.org](mailto:actuaris@actuaris.org)

[www.actuaris.org](http://www.actuaris.org)

