



Cursos de Formació

CERA

(Chartered Enterprise Risk Actuary)

MÓDULO 0 : QUANTITATIVE METHODS FOR ERM. BRIDGING AND REFRESHER COURSE.

SEPTIEMBRE 2018

Via Laietana 32 4ª planta - 08003 Barcelona - Tel: + 34 93 319 08 18 - e-mail: actuaris@actuaris.org

www.actuaris.org





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

1.- INTRODUCCIÓN.

Nos complace presentarles el seminario “**Quantitative Methods for ERM. Bridging and refresher course**” que llevará a cabo la European Actuarial Academy (EAA) en Barcelona los días 10 y 11 de diciembre de 2018, en colaboración con el Col·legi d’Actuaris de Catalunya (CAC).

La EAA fue fundada en el año 2005, por iniciativa de los colegios de actuarios de Alemania, Austria, Holanda i Suiza. En este momento es uno de los centros de estudio para actuarios de más prestigio de Europa, impartiendo formación a actuarios de todo el continente.

2.- OBJETIVOS DEL CURSO.

El seminario, de 1.5 días de duración, tiene un doble objetivo:

- Por un lado, es un curso de introducción diseñado para preparar a los actuarios con una base más cualitativa, necesaria para las posteriores partes cuantitativas de la formación CERA.
- Por otro lado, es un curso de actualización independiente, para actuarios que desean mejorar sus habilidades cuantitativas en los campos de gestión de riesgos empresariales (ERM) y matemática financiera.

3.- TEMÁTICA DEL CURSO.

El seminario comienza con una introducción a las medidas de riesgo. Se tratará del Value at Risk (VaR) y el déficit esperado y se dará una introducción a la teoría moderna de las medidas de riesgo coherente. Con el fin de preparar el análisis de los riesgos dependientes, a continuación se discutirán los conceptos básicos del modelado multivariante.

El curso continuará con una introducción a las matemáticas financieras. Se empezará con el estudio de la valoración de riesgo neutral y la cobertura de derivados en modelos discretos y se seguirá con una introducción a las matemáticas financieras en tiempo continuo.

Las materias cubiertas incluyen el método Browniano y la fórmula Ito, el modelo Black Scholes y el precio de acciones y bonos.

El seminario consiste en clases teóricas y ejercicios prácticos, que ayuden a los participantes a comprender las técnicas cualitativas y cuantitativas introducidas en las clases.

4.- PARTICIPANTES.

El seminario está abierto a todas las personas que estén interesadas en profundizar sus habilidades cuantitativas en los campos de la gestión de riesgos empresariales (ERM) y las matemáticas financieras.

Durante el seminario, no necesitará llevar ordenador portátil.

El seminario se impartirá en **inglés** y computará 11 horas a los efectos del CPD del CAC (programa de formación continuada).

Via Laietana 32 4ª planta - 08003 Barcelona - Tel: + 34 93 319 08 18 - e-mail: actuaris@actuaris.org

www.actuaris.org

MEMBRE DEL INTERNATIONAL ACTUARIAL
ASSOCIATION



International Actuarial Association
Association Actuarielle Internationale

MEMBRE DEL GROUPE CONSULTATIF
ACTUARIEL EUROPEEN





La tarifa de inscripción anticipada es de € 790,00 más el 21% de IVA y es válida hasta el 10 de octubre de 2018. A partir de esta fecha, la tarifa será de 970,00 euros más el 21% de IVA.

5.- PROGRAMA.

Monday, 10 December 2018

08:45 - 09:00 Registration
09:00 - 09:15 Introduction and welcome (EAA)
09:15 - 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

Tuesday, 11 December 2018

09:00 - 11:00 Introduction to continuous-time finance
11:00 - 11:15 Coffee Break
11:15 - 12:00 The Black Scholes Model and Applications
12:00 - 13:00 Exercise Session 4
13:00 - 14:15 Lunch

6.- INSCRIPCIONES.

Las inscripciones se realizarán directamente a través de la página web de la EAA

www.actuarial-academy.com

Para cualquier duda sobre el seminario se pueden dirigir directamente a la Sra. Susanne Kade, de la EAA contact@actuarial-academy.com

7.- CPD.

El curso computará 11 horas a efectos del Programa de Formación Continua (CPD) del Col·legi d'Actuaris de Catalunya.

Fecha de inicio: 10 de diciembre de 2018.

Fecha de final: 11 de diciembre de 2018

Dirección:

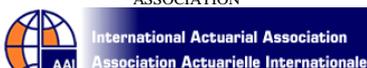
Hotel Sallés Pere IV
Calle Pallars, 128-130
08018 – Barcelona –

Barcelona, 17 de septiembre de 2018

Via Laietana 32 4ª planta - 08003 Barcelona - Tel: + 34 93 319 08 18 - e-mail: actuaris@actuaris.org

www.actuaris.org

MEMBRE DEL INTERNATIONAL ACTUARIAL
ASSOCIATION



MEMBRE DEL GROUPE CONSULTATIF
ACTUARIEL EUROPEEN

