

Cursos de Formació

CERA

(Chartered Enterprise Risk Actuary)

MÒDUL B: TAXONOMY, MODELLING AND MITIGATION OF RISKS.

Maig de 2019

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

www.actuaris.org

MÒDUL B: TAXONOMY, MODELLING AND MITIGATION OF RISKS.

1.- INTRODUCCIÓ.

Ens complau presentar-vos el seminari "**MÒDUL B: TAXONOMY, MODELLING AND MITIGATION OF RISKS.**" Que portarà a terme l'European Actuarial Academy (EAA) a Barcelona els dies 2, 3, 4, 5 i 6 de setembre de 2019, en col·laboració amb el Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CAC).

El seminari forma part de la formació necessària per a l'acreditació CERA (Chartered Enterprise Risk Actuary), que consta de 4 mòduls (A, B, C i D), amb els seus exàmens respectius.

La EAA va ser fundada el 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 a Europa, impartint formació a actuaris de tot el continent.

2.- TEMÀTICA DEL CURS.

El seminari, de 5 dies de durada i 33 hores lectives, se centrarà en les anàlisis quantitatives dels riscos financers i no financers d'una companyia d'assegurances i l'efecte i les possibles aplicacions de les tècniques de mitigació de riscos.

Després d'una introducció a la valoració econòmica d'una companyia d'assegurances, inclosos els models de valoració estocàstica, de les tècniques d'aproximació per a les companyies d'assegurances de vida i dels components del seu balanç econòmic, s'analitzaran les mesures de risc i els requisits reglamentaris pertinents de Solvència II. També es presentaran diferents conceptes de modelització de riscos que abasten des d'una fórmula estàndard fins als models interns.

Després d'una immersió profunda en la classificació de riscos, s'aborden els riscos estratègics, de reputació i operatius. Posteriorment, es presentaran en detall els mètodes per modelar els riscos de mercat, crèdit i subscripció.

La discussió de cada risc comença amb la seva definició, com pot identificar-se i distingir-se d'altres riscos, i la seva classificació d'acord amb Solvència II.

La taxonomia és seguida per enfocaments de valoració qualitatiu i quantitatiu, que inclouen anàlisi d'escenaris, proves d'estrès, avaluacions deterministes, estocàstiques i quantificacions d'acord amb la fórmula estàndard i un model intern. A més, es discuteixen els aspectes crucials de qualsevol model, com ara supòsits, distribucions, calibratge i validació, així com les limitacions i criteris per a la idoneïtat d'un model per a resoldre un problema donat.

Havent introduït i discutit el model de risc, es discutiran les eines i tècniques que estan disponibles en el negoci d'assegurances per mitigar aquests riscos. Això inclou la discussió sobre les implicacions de la reassegurança i la titularització, així com la gestió de la cartera. També presentarem el que poden fer les companyies d'assegurances de vida subjectes als negocis tradicionals per cobrir les seves principals riscos.

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

www.actuaris.org

Tots dos elements, el model i el mesurament del risc, així com la mitigació del risc, estan estretament relacionats i interactuen entre si, el que es reflectirà en els temes presentats i l'estructura del seminari.

La visió consolidada sobre els riscos en una empresa i una perspectiva sobre els models del Grup tanquen el curs.

El curs ha estat dissenyat per a professionals amb experiència que utilitzen resultats de models en la pràctica i busquen orientació per a les decisions de gestió. Per tant, no se centra en els detalls tècnics, sinó en la comprensió dels models de risc i els seus resultats, i en la derivació de les accions de gestió.

Els exemples i els estudis de cas són un component central del seminari.

3.- PARTICIPANTS.

Durant el seminari, no es necessitarà portar ordinador portàtil.

El seminari s'impartirà en **anglès** i computarà **33 hores** a l'efecte del CPD del CAC (programa de formació continuada).

La tarifa d'inscripció anticipada és de 1.830 euros, més el 21% d'IVA.

4.- PROGRAMA

Dilluns, 2 de setembre de 2019

09:00-09:15 Registration
09:15-09:30 Welcome & Introduction
09:30-11:00 Approaches and Models for Economic Valuation & Quantifying of Risks (Part I)
11:00-11:30 Coffee Break
11:30-13:00 Approaches and Models for Economic Valuation & Quantifying of Risks (Part II)
13:00-14:00 Lunch
14:00-15:30 Corporate Models and Proxy Modelling in Life Insurance
15:30-16:00 Coffee Break
16:00-17:30 Risk Taxonomy; Strategic, Reputational and Liquidity Risk

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

www.actuaris.org

Dimarts, 3 de setembre de 2019

09:00-11:00 Operational Risk (incl. Legal Risk)
11:00-11:30 Coffee Break
11:30-13:00 Introduction to Market Risk, Equity Risk (Part I)
13:00-14:00 Lunch
14:00-15:15 Introduction to Market Risk, Equity Risk (Part II)
15:15-15:45 Coffee Break
15:45-17:15 Property Risk and Currency Risk

Dimecres, 4 de setembre de 2019

09:00-11:00 Interest Rate Risk (Part I)
11:00-11:30 Coffee Break
11:30-00:30 Interest Rate Risk (Part II)
12:30-13:30 Credit Risk (Part I)
13:30-14:30 Lunch
14:30-16:00 Credit Risk (Part II)
16:00-16:30 Coffee Break
16:30-18:30 Variable Annuities

Dijous, 5 de setembre de 2019

09:00-10:45 Premium Risk (Part I)
10:45-11:15 Coffee Break
11:15-13:00 Premium Risk (Part II)
13:00-14:00 Lunch
14:00-15:30 Reserve Risk
15:30-16:00 Coffee Break
16:00-18:00 Risk Transfer and Risk Analysis

Divendres, 6 de setembre de 2019

09:00-11:00 Underwriting Risk in Life and Health Insurance
11:00-11:30 Coffee Break
11:30-13:30 Risk Management for Traditional Life Insurance business
13:30-14:30 Lunch
14:30-15:30 Concentration Risk and Risk Aggregation (Part I)
15:30-16:00 Coffee Break
16:00-17:00 Concentration Risk and Risk Aggregation (Part II)

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

www.actuaris.org

5.- EXÀMENS.

Els exàmens CERA els organitza i porta a terme la Deutsche Aktuarvereinigung (Associació d'Actuaris Alemanya), i es podran fer en alemany o en anglès.

Properament es determinarà la data i lloc per a la realització de l'examen del CERA Mòdul B: TAXONOMY, MODELLING AND MITIGATION OF RISKS.

L'examen té un cost que ha de pagar l'alumne.

6.- INSCRIPCIONS.

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

www.actuarial-academy.com

Podeu trobar informació completa sobre el seminari, incloent el detall dels professors del mateix, a:

<https://actuarial-academy.com/cera/seminar?No=E0145>

Per a qualsevol dubte sobre el seminari poden dirigir-se al Col·legi d'Actuaris de Catalunya, a l'atenció del Sr. Joaquim Celma (jcelma@actuaris.org), Gerent del CAC.

Data d'inici: 2 de setembre de 2019.

Data de final: 6 de setembre de 2019.

Adreça:

Gallery Hotel
Carrer del Rosselló, 249
08008 Barcelona

Barcelona 10 maig 2019.