COL·LEGI D'ACTUARIS DE CATALUNYA

CURSO
ESCENARIOS ECONOMICOS ESTOCASTICOS: USOS EN LAS ENTIDADES ASEGURADORAS.

ABRIL 2024

Via Laietana 32 4a planta - 08003 Barcelona - Tel + 34933190818 - actuaris@actuaris.org - www.actuaris.org

Membre de:

International Actuarial Association
Association Actuarielle Internationale

actuarial association of europe

CURSO ESCENARIOS ECONOMICOS ESTOCASTICOS Y SUS USOS EN LAS ENTIDADES ASEGURADORAS.

1.- OBJETIVOS DEL CURSO

Les presentamos el curso Escenarios Económicos Estocásticos y sus usos en las entidades aseguradoras.

El curso, en modalidad online, de 6 horas de duración, se llevará a cabo los días 9, 10 y 11 de abril de 2024**,** en horario de 18:00h a 20:00h, organizado por el Col·legi d'Actuaris de Catalunya, con la colaboración de Willis Towers Watson (WTW).

El objetivo principal del curso es proporcionar los conocimientos necesarios para entender el uso de los escenarios económicos estocásticos en el marco regulatorio actual, así como en la gestión de riesgos de las entidades aseguradoras y planes de pensiones.

2.- A QUIÉN VA DIRIGIDO

El curso va dirigido a actuarios y otros profesionales interesados en conocer con más detalle desde cómo se generan los escenarios económicos estocásticos hasta su uso en Solvencia II / IFRS 17 y en la gestión de riesgos de las entidades aseguradoras y planes de pensiones.

En el Curso se tratarán con detalle los puntos siguientes:

- Introducción a los conceptos básicos.
- Las herramientas de generación de escenarios económicos estocásticos, denominados *ESG* por sus siglas en inglés, *Economic Scenario Generator*, y las principales metodologías aplicables por clases de activos e indicadores macroeconómicos.
- Tipología de escenarios según su uso, en este caso escenarios *Real-World* y escenarios *Risk-Neutral*.
- Los usos obligatorios en Solvencia II / IFRS 17, los requerimientos regulatorios específicos, así como el proceso de validación escenarios.
- Los usos en los seguros generales, *ALM*, Gestión de carteras de activos, *Embedded Value*, Capital Económico, Planificación de Capital, Presupuestación, *Early Indicators*, *M&A*, *Pricing /Profit testing* y gestión del riesgo en general.
- Casos prácticos, entre otros, la valoración de la participación en beneficios, *ORSA* y *policyholder behaviour*.

3.- PONENTES.

El curso será impartido por profesionales de amplia experiencia, profesional y docente, en la materia, permitiendo transmitir una visión práctica y de mercado.

- **Ateno Villar**, Director en WTW
- **Miguel Romo**, Director en WTW

- **José Trujillano**, Director Adjunto en WTW
- **Héctor Coronado**, Director Adjunto en WTW
- **José Gabriel Gasco**, Actuario Senior en WTW
- **Juan Marín**, Actuario Senior en WTW

4.- PROGRAMA.

1. Conceptos generales
2. La necesidad de utilizar un generador de escenarios económicos (*ESG*)
3. El rol de los *ESG* en satisfacer los requerimientos regulatorios
4. Aplicaciones de los *ESG* en la industria aseguradora y de pensiones
5. Cuáles son las características esenciales de un buen *ESG*
6. Consideraciones generales de los modelos *ESG*
7. Proceso de calibración de los modelos y parametrización
8. Validación de los modelos
9. Consideraciones en los modelos *Arbitrage-Free*
10. El rol de los escenarios *Risk-Neutral*
11. Modelos de curvas de tipos de interés libre de riesgo
12. Modelos de Bonos Corporativos
13. Modelos sobre índices
14. Consideraciones en modelos internacionales
15. Casos prácticos
    - 15.1. Participación en beneficios
    - 15.2. *ORSA* en seguros generales
    - *15.3. Policyholder behaviour*

5.- MATRÍCULA

Cuota de inscripción (euros) – **IVA del 21% NO INCLUIDO**

Miembros Titulares y trabajadores de Miembros Protectores	Miembros Titulares en paro y estudiantes	Otros
250	125	500

El precio incluye la asistencia al curso online y los materiales del curso.

Forma de pago:
transferencia bancaria a nombre del Col·legi d'Actuaris de Catalunya
IBAN: ES40 0081 0057 3100 0118 8927

Si desean factura a nombre de una empresa deberán indicar CIF, nombre, dirección, teléfono, persona de contacto y dirección de correo electrónico.

6.- SEGUIMIENTO DEL CURSO ONLINE

El curso se hará en streaming mediante el sistema Cisco Webex Meetings©. Antes del inicio del curso, el CAC enviará un correo electrónico a todos los participantes con el enlace para acceder.

Entrar en un Webex Meetings

El asistente al curso se ha de asegurar que su conexión a internet funciona correctamente.

Se aconseja conectarse al curso 10 minutos antes (a las 17:50h) para asegurarse de que se dispone de una buena conexión antes del inicio.

El curso online comenzará cada día a las 18:00h y finalizará a las 20:00h (2h de duración). Al final de la exposición, los asistentes al curso podrán intervenir y hacer algunas preguntas y/o solicitar aclaraciones al profesor. No está previsto que los participantes intervengan mientras dure la clase, por lo que el CAC silenciará los micrófonos de los asistentes.

En cualquier caso, los asistentes al curso podrán hacer otras preguntas/comentarios, que deberán enviar al CAC por correo electrónico.

7.- INSCRIPCIONES

Col·legi d'Actuaris de Catalunya
Teléfono: 93.319.08.18
actuaris@actuaris.org
www.actuaris.org

La inscripción se puede formalizar hasta 48 horas antes a la fecha de inicio del curso online.

Al formalizar la inscripción deberán indicar la dirección de correo electrónico de todas las personas inscritas.

8.- CPD

El curso computará 6 horas a los efectos de la acreditación de la formación continuada del Col·legi d'Actuaris de Catalunya (CPD).

Con la colaboración de: