

**PRIMERA JORNADA DE INVESTIGACIÓN
EN
SEGUROS Y FINANZAS**

**Jueves 2 de junio 2005
Aula 319 - Espai de Recerca en Economia
Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales**

Organizada por los grupos de investigación:

**AFARA (Análisis Financiero Actuarial del Riesgo y de los Seguros)
IAFI (Análisis Financiero y de la Incertidumbre)
EFO (Economía Financiera y Optima)**

**Departamento de Matemática Económica, Financiera y Actuarial
Universidad de Barcelona.**

El objetivo de la jornada es dar a conocer las investigaciones recientes de los diferentes investigadores de los grupos organizadores en los ámbitos de los seguros y las finanzas. En los distintos trabajos se desarrollan y utilizan nuevas metodologías matemáticas y económicas que permiten entender más a fondo el presente y futuro de los sectores asegurador y financiero. Se incluyen trabajos sobre cópulas, nuevas hipótesis en la teoría del riesgo, la utilización de las transformadas de Laplace, técnicas de optimización, ... entre otros.

La asistencia es abierta a investigadores en seguros y finanzas, a estudiantes interesados y a profesionales del sector. Las plazas son limitadas por lo que se ruega enviar e-mail (mmarmol@ub.edu) o fax (93-403 48 92) para indicar la asistencia.

PROGRAMA

HORA	PONENCIA
9 – 9:30	Presentación de la Jornada Dr. Antonio Alegre. Decano de la Facultat de Ciències Econòmiques i Empresariales Dr. Dídac Ramírez. Director del Departament de Matemàtica Econòmica, Financera i Actuarial
9:30 – 10	“On the distribution of dividend payments in a Sparre Andersen model with generalized Erlang(n) interclaim times” H. Albrecher, M. Mercè Claramunt y Maite Mármol
10 – 10:30	“ Ruin probabilities in the classical risk model “ Ramón Lacayo
10:30 – 11	PAUSA CAFÉ
11 – 11:30	“Análisis del momento de ruina mediante Transformadas de Laplace “ Ana Castañer, M. Mercè Claramunt, Maite Mármol
11:30 – 12	“Xarxes Neurals Artificials per al tractament de la Memòria als Mercats Financers “ Teresa Sorrosal
12 – 12:30	“Temps en Economia Financera“ David Ceballos
12:30 – 13	“On some optimal portfolio selection problems “ Jesús Marín, Carme Ribas, Oriol Roch y Manuela Bosch
13 – 15	PAUSA COMIDA
15 – 15:30	“Seguros de dependencia “ A. Alegre, M. Àngels Pons, Javier Sarrasí y Javier Varea
15:30 – 16	“Computing bonus-malus premiums under partial prior information“ Emilio Gómez, Lluís Bermúdez e Isabel Morillo
16 – 16:30	“Influencia del convenio CIDE/ASCIDE y del fichero histórico SINCO en la tarificación del seguro de automóviles en España” Eva Boj, M. Mercè Claramunt, Josep Fortiana y Angel Vegas
16:30 – 17	PAUSA CAFÉ
17 – 17:30	“A volatility-varying and jump-diffusion Merton type model of interest rate risk” Fernando Espinosa y Josep Vives
17:30 – 18	“Interactions between Government and Firms: a differential game approach” Jorge Navas y Jesús Marín-Solano
18 – 18:30	“Cópulas y dependencia en riesgos financieros” Oriol Roch