

July 1 (Short Courses)

Program

- 09:00 Registration
- 09:30 – 10:00 Opening: Roman Adillon (*Head of Mathematics for Economics, Finance and Actuarial Sciences department*)
- 10:00 – 11:00 Carlos Vidal-Meliá (*Universidad de Valencia*)
- ALGUNOS INSTRUMENTOS PARA MEJORAR EL FUNCIONAMIENTO DE LOS SISTEMAS DE PENSIONES DE REPARTO**
- 11:00 – 11:30 Coffee Break
- 11:30 – 12:30 Clara Armengol (*Deutsche Zurich Pensiones*)
- LOS ACTUALES RETOS DE LA PREVISIÓN SOCIAL PRIVADA, TANTO EN EL ÁMBITO DE LAS EMPRESAS COMO DE LAS FAMILIAS**
- 12:30 – 13:00 Conclusions and discussion. Moderator: Manuela Bosch (*Universitat de Barcelona*)
- 13:00 – 15:00 Lunch
- 15:00 – 16:00 M. Mercè Claramunt (*Universitat de Barcelona*)
- SOLVENCIA II: VISIÓN GENERAL Y ASPECTOS TÉCNICOS**
- 16:00 – 16:30 Coffee break
- 16:30 – 17:30 Núria Casasús Magriñá (*Catalana Occidente*)
- GESTIÓN DE RIESGOS PROPIOS DE LOS PRODUCTOS DE VIDA**
- 17:30 – 18:00 Conclusions and discussion. Moderator: F. Javier Sarrasí (*Universitat de Barcelona*)

July 2 (Participant's Presentations and Poster Session)

Program

- 09:30 – 11:00 Session 1: Pensions I
- 11:00 – 11:30 Coffee break & Poster session
- 11:30 – 13:00 Session 2: Insurance
- 13:00 – 15:00 Lunch
- 15:00 – 16:30 Session 3: Pensions II
- 16:30 – 17:00 Coffee break & Poster session
- 17:00 – 18:15 Special session: Young researchers
- 18:15 – 18:30 Closing: Jesús Marín (*Vice dean of Research at the Faculty of Economics and Business*)

Sessions

09:30 – 11:00. Session 1: Pensions I (Chair: Oriol Roch)

Juan Manuel Pérez-Salamero, Marta Regúlez-Castillo, Carlos Vidal-Meliá
ANALYSIS OF THE REPRESENTATIVENESS OF THE CONTINUOUS SAMPLE OF WORKING LIVES (CSWL): THE CASE OF THE BENEFITS PROVIDED BY THE SPANISH PUBLIC PENSION SYSTEM

Juan Manuel Pérez-Salamero, Marta Regúlez- Castillo, Carlos Vidal-Meliá
SELECTION OF HIGH SIZE SUB-SAMPLES FROM THE CONTINUOUS SAMPLE OF WORKING LIVES (CSWL) REPRESENTATIVE OF THE BENEFITS PROVIDED BY THE SPANISH PUBLIC PENSION SYSTEM

Javier Pla-Porcel, Manuel Ventura Marco, Carlos Vidal-Meliá
LIFE CARE ANNUITIES (LCA) EMBEDDED IN A NOTIONAL DEFINED CONTRIBUTION (NDC) FRAMEWORK

Daniel Vilalta
PROTECCIÓN SOCIAL COMPLEMENTARIA: ASPECTOS FISCALES

11:30 – 13:00. Session 2: Insurance (Chair: Antonio Alegre)

María José Pérez-Fructuoso

TARIFICACIÓN DE BONOS SOBRE CATÁSTROFES CON DESENCADENANTES DE ÍNDICES DE PÉRDIDAS: PERFECCIONANDO EL MODELO CONTINUO BASADO EN UN PROCESO GEOMÉTRICO DE WIENER

Eva Boj, Teresa Costa

CLAIM RESERVING WITH GENERALIZED LINEAR MODELS INCLUDING RISK MARGINS

Anna Castañer, M. Mercè Claramunt

OPTIMAL JOINT SURVIVAL PROBABILITY WITH STOP-LOSS REINSURANCE

Eudald Boira, F. Javier Sarrasí, M. Àngels Pons

INFLUENCIA DEL REASEGURO EN EL RATIO DE SOLVENCIA DE UNA CARTERA DE VIDA

15:00 – 16:30. Session 3: Pensions II (Chair: Anna Castañer)

Anna Castañer-Garriga, Juan Manuel Pérez-Salamero, Carlos Vidal-Meliá

ARE THE RATES LEVIED TO COVER THE COST OF PENSIONS FOR OCCUPATIONAL INJURY AND DISEASE ACTUARIALLY FAIR? AN ANALYSIS FOR THE PERIOD 2011-2015

Oriol Roch, Manuela Bosch-Príncipe, Isabel Morillo, Daniel Vilalta

A REVISION OF THE REVALUATION INDEX OF SPANISH PENSIONS

Manuela Bosch-Príncipe, Oriol Roch, Isabel Morillo

INDICATORS TO MEASURE THE PENSION ADEQUACY

Yolanda Blasco-Martel, Manuela Bosch-Príncipe, Neus González-Monfort, Joan Pagés-Blanch, Antonio Santisteban-Fernández

LA EDUCACIÓN FINANCIERA EN ESPAÑA: PRIMERA APROXIMACIÓN AL NIVEL DE LOS ESTUDIANTES UNIVERSITARIOS

17:00 – 18:15. Session 4: Young researchers (Chair: M. Reyes Pérez)

Regina Nicola Martins

EL IMPACTO DE LAS RECIENTES REFORMAS DE LA SEGURIDAD SOCIAL SOBRE LA PRESTACIÓN PÚBLICA DE JUBILACIÓN

Alba Tadeo Megías

MODELIZACIÓN DE LA DEPENDENCIA DEL NÚMERO DE SINIESTROS. APLICACIÓN A SOLVENCIA II

Raül Martínez Buixeda

EL SESGO MUESTRAL EN LA CUANTIFICACIÓN DEL RIESGO DE LAS ESTRATEGIAS HEDGE

Toni Oliván López

LA EDUCACIÓN FINANCIERA EN PRIMARIA. PROPUESTA DE REFORMA

Emilio Gutiérrez Viñuela

OBTENCIÓN DE LA PROBABILIDAD DE QUE LAS RESERVAS DE UNA CARTERA DE SEGUROS NO VIDA ALCANCEN UNA BARRERA EN UN MODELO DE RIESGO CON INTEROCURRENCIA ERLANG (K) Y CUANTÍA ERLANG(N)

Poster session

Anna Castañer, M. Mercè Claramunt

INNOVACIÓN EN LA ASIGNATURA DE SOLVENCIA DEL MÁSTER EN CIENCIAS ACTUARIALES Y FINANCIERAS DE LA UNIVERSITAT DE BARCELONA

José Saéz Madrid, Francesc Ortí Celma

MEDIDAS DISCRETAS DE RIESGO SOBRE ACCIONES DEL ÍNDICE S&P500

Roman Adillon Boladeres, Lambert Jorba

NEW mathematical TOOL FOR DEVELOPING A NEW APPROACH FOR CALCULATIONS IN INSURANCE PROBLEMS

Laura González-Vila Puchades, Jorge de Andrés-Sánchez

VALORACIÓN DE RENTAS DE SUPERVIVENCIA MEDIANTE VARIABLES ALEATORIAS BORROSAS: EXPRESIONES ANALÍTICAS EN EL CASO DE INTERÉS TRIANGULAR

Carmen Badía Batlle, Merche Galisteo Rodríguez, Teresa Preixens Benedicto

CVA-DVA: AJUSTE POR RIESGO DE CRÉDITO DEL VALOR DE UN SWAP

Ricardo Josa-Fombellida, Jorge Navas Ródenes

STOCHASTIC PENSION FUNDING: A DYNAMIC MODEL WITH TIME INCONSISTENT PREFERENCES

Jesús Marín-Solano, Jorge Navas Ródenes, Oriol Roch Casellas

CONSUMPTION, PORTFOLIO AND LIFE INSURANCE RULES: A DYNAMIC MODEL WITH GENERAL TIME PREFERENCES

Anna Castañer, Jesús Marín-Solano, Carmen Ribas

AN INVESTMENT CONSUMPTION MODEL WITH HETEROGENEOUS AGENTS