

# II WORKSHOP ON PENSIONS AND INSURANCE 2016 BARCELONA JULY 14-15

This workshop is an activity of the  
CÁTEDRA ICEA-UB DE SEGUROS  
Y FONDOS DE PENSIONES  
Director of the funded Chair: Dr. Xavier Varea.

## SCIENTIFIC COMMITTEE

Chairman:

M. Mercè Claramunt Bielsa (Universitat de Barcelona)

Mercedes Ayuso Gutiérrez (Universitat de Barcelona)  
Alejandro Balbás de la Corte (Universidad Carlos III)  
Manuela Bosch Príncipe (Universitat de Barcelona)  
José Enrique Devesa Carpio (Universitat de València)  
Rafael Moreno Ruíz (Universidad de Málaga)  
Eliseo Navarro Arribas (Universidad de Alcalá de Henares)  
Iñaki de la Peña Esteban (Universidad del País Vasco)  
Miguel Ángel Sordo Díaz (Universidad de Cádiz)  
Carlos Vidal Meliá (Universitat de València)  
José Luis Vilar Zanón (Universidad Complutense)

## ORGANIZING COMMITTEE

Carmen Badía Batlle (Universitat de Barcelona)  
Anna Castañer Garriga (Universitat de Barcelona)  
Teresa Costa Cor (Universitat de Barcelona)  
Isabel Morillo López (Universitat de Barcelona)  
Carmen Ribas Marí (Universitat de Barcelona)  
Oriol Roch Casellas (Universitat de Barcelona)



**II WORKSHOP ON PENSIONS  
AND INSURANCE 2016  
BARCELONA JULY 14-15**

**THURSDAY 14 JULY**

**09.00/09.15**

Registration

**09.15/09.30**

OPENING: ICEA

Speaker: Xavier Varea (Director Cátedra ICEA-UB)

**09.30/10.15**

Lecture

**EFFECTOS DE LAS ÚLTIMAS REFORMAS DEL SISTEMA PÚBLICO DE PENSIONES DE LA SEGURIDAD SOCIAL EN UN CONTEXTO DE ENVEJECIMIENTO DE LA POBLACIÓN**

Chair: Manuela Bosch

Speaker: Miguel Ángel García Díaz (Universidad Rey Juan Carlos)

**10.15/11.15**

Session 1: **PENSIONS I**

Chair: Manuela Bosch

**Desde las estructuras vitalicias a las temporales: una aproximación a la reforma de las pensiones de supervivencia en España**

Daniel Hernández, José E. Devesa

**A "Swedish" actuarial balance sheet for a notional defined contribution pension scheme with disability and retirement benefits**

Juan M. Pérez-Salamero, Manuel Ventura-Marco, Carlos Vidal-Meliá

**Selection of large sub-samples from the Continuous Sample of Working Lives representative of the benefits provided by the Spanish public pension system**

Juan M. Pérez-Salamero, Marta Regúlez-Castillo, Carlos Vidal-Meliá

**11.15/11.45**

Coffee Break + Poster Session

**11.45/12.45**

Session 2: **PENSIONS II**

Chair: Carlos Vidal-Meliá

**Gender inequalities in the elderly Spanish population budgets: special incidence on pensions and long term care**

Estefania Alaminos, Ramón Alemany, Mercedes Ayuso, Montserrat Guillén

**Would it work? A notional defined contribution scheme combining retirement and long-term care**

Javier Pla-Porcel, Manuel Ventura-Marco, Carlos Vidal-Meliá

**A proposal of a pension adequacy index for the EU countries**

Juan J. Alonso, José E. Devesa, Mar Devesa, Inma Domínguez, Borja Encinas, Robert Meneu

**12.45/13.30**

Lecture

**RADIOGRAFÍA DEL ENVEJECIMIENTO Y DE LAS REFORMAS DEL SISTEMA DE PENSIONES**

Chair: Carlos Vidal-Meliá

Speaker: Clara I. González (Banco de España)

**II WORKSHOP ON PENSIONS  
AND INSURANCE 2016  
BARCELONA JULY 14-15**

**THURSDAY 14 JULY**

- 
- 13.30/13.45** Presentation  
**JOURNAL "ECONOMÍA ESPAÑOLA Y PROTECCIÓN SOCIAL"**  
Speaker: Daniel Hernández
- 13.45/15.00** Lunch
- 15.00/15.45** Lecture  
**THE DBSTATS PACKAGE FOR R IN ACTUARIAL SCIENCE**  
Chair: M<sup>a</sup> Mercè Claramunt  
Speaker: Eva Boj del Val (Universitat de Barcelona)
- 15.45/16.45** Session 3: **RISK AND INSURANCE I**  
Chair: M<sup>a</sup> Mercè Claramunt
- Prediction error in logistic regression**  
Teresa Costa, Eva Boj
- A family of premium principles based on mixtures of TVaRS**  
Miguel A. Sordo, Antonia Castaño, Gema Pigueiras
- From tail to global dependence risk measures**  
Alfonso J. Bello, Miguel A. Sordo, A. Suárez-Llorens
- 16.45/17.30** Lecture  
**A BAYESIAN MODEL FOR THE CLAIM NUMBER WITH INCOMPLETE COUNT DATA**  
Chair: M<sup>a</sup> Mercè Claramunt  
Speaker: Francisco J. Vázquez Polo (Universidad de Las Palmas de Gran Canaria)
- 17.30/18.00** Award  
**I CÁTEDRA ICEA-UB INSURANCE AND PENSION AWARD TO THE BEST BACHELOR'S THESIS IN INSURANCE AND PENSIONS**  
Speaker: Francisco Javier Martínez de Albéniz. Present the award  
Marta Rodríguez (Training Director ICEA) and Javier Varea (Director Cátedra ICEA-UB)
- 20.00** Social Programme  
**GUIDED TOUR AT THE HISTORICAL BUILDING OF THE UNIVERSITAT DE BARCELONA AND SOCIAL DINNER**

09.00/10.30

Session 4: **RISK AND INSURANCE II**

Chair: Miguel A. Sordo

**Expected return and cost structure of insurance companies**

Juan J. Alonso, José E. Devesa, Mar Devesa, Inma Domínguez, Borja Encinas, Robert Meneu

**Análisis y validación de las hipótesis utilizadas en la derivación de las tasas de mortalidad. Un estimador de periodo**

Josep Lledó, José Manuel Pavía, Francisco G. Morillas

**Joint analysis of hierarchical overdispersed counts and left-truncated survival times with applications to health insurance**

Xavier Piulachs, Ramon Alemany, Dimitris Rizopoulos

**Valor razonable de un SWAP: CVA y DVA**

Carmen Badía, Merche Galisteo, Teresa Preixens

10.30/11.15

Lecture

**LOS RETOS DE SOLVENCIA II DESDE DENTRO**

Chair: José E. Devesa

Speaker: Javier Pla Porcel (International SOS)

11.15/11.45

Coffee Break + Poster Session

11.45/12.45

Session 5: **RISK AND INSURANCE III**

Chair: José E. Devesa

**An internal model for the SCR of risk of mortality**

M<sup>a</sup> Àngels Pons, F. Javier Sarrasí

**SCR de primas y reservas: análisis de la dependencia con un modelo de choque común**

Anna Castañer, M. Mercè Claramunt, Alba Tadeo, Xavier Varea

**Estudio bajo la normativa Solvencia II de la influencia del reaseguro en la solvencia y la gestión del capital**

Nuria Arbuniés, Teresa Mármol

12.45/13.30

Lecture

**EXPERIENCIA PRÁCTICA IMPLEMENTACIÓN SOLVENCIA II – PILAR II**

Chair: José E. Devesa

Speaker: M<sup>a</sup> Jesús Romero Santo-Tomás (Grupo Zurich)

**II WORKSHOP ON PENSIONS  
AND INSURANCE 2016  
BARCELONA JULY 14-15**

**FRIDAY 15 JULY**

- 
- 13.30/13.45** Presentation  
**COL·LEGI D'ACTUARIS DE CATALUNYA**  
Speaker: Miquel Viñals (Col·legi President)
- 13.45/15.00** Lunch
- 15.00/15.45** Lecture  
**BEHAVIORAL ECONOMICS. UNA EXPERIENCIA PRÁCTICA DE "SAVE MORE TOMORROW"**  
Chair: Xavier Varea  
Speaker: Jesús María García Martínez (VidaCaixa)
- 15.45/16.45** Session 6: **PENSIONS III**  
Chair: Xavier Varea
- Stress test de EIOPA de 2015: principales resultados**  
Ignacio del Barco, Mariano Jiménez, Enrique Pociello
- Salarios y pensiones**  
María Reyes Pérez
- Alternative measure of pension adequacy pension during the life cycle of retirees**  
Manuela Bosch, Oriol Roch, Isabel Morillo
- 16.45/17.00** Coffee Break
- 17.00/17.40** Session 7: **RISK AND INSURANCE IV**  
Chair: Laura González-Vila
- Pricing loss index triggered Cat Bonds. An Ornstein-Uhlenbeck process-based model**  
M<sup>a</sup> José Pérez Fructuoso
- Predicting customer churn: an insurance applied case**  
Catalina Bolancé, Montserrat Guillén, Aleamar E. Padilla-Barreto
- 17.40/18.00** CLOSING