Investigación en Ciencias Actuariales

Curso Académico: (2018 / 2019) **Fecha de revisión: 09-05-2018**

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Economía de la Empresa

Coordinador/a: BALBAS DE LA CORTE, ALEJANDRO

Tipo: Optativa Créditos ECTS : 5.0

Curso : 2 Cuatrimestre : 1

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Conocimientos habituales de análisis matemático, cálculo de probabilidades, economía financiera, tarificación de seguros (vida y no vida).

OBJETIVOS

Técnicas de investigación actuarial en problemas de vida, no vida, y gestión de riesgos.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

- Modelos de ruina con teoría de fluidos

- Modelos de longevidad estocásticos

- Modelos integrados de gestión de riesgos financieros-actuariales.

- Metodología de cálculo de IBNR estocástico

- Tarificación con técnicas bayesianas.

- Estudio de planes de pensiones y sistemas de previsión público/privados

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

Clases magistrales
Ejercicios
Estudio y debate sobre artículos de investigación

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Examen final (60%)
Ejercicios (20%)
Artículos de investigación (20%)

Peso porcentual del Examen Final:	60
Peso porcentual del resto de la evaluación:	40