



DENOMINACIÓN ASIGNATURA: Análisis avanzado de operaciones de seguro de vida		
POSTGRADO: MÁSTER UNIVERSITARIO EN CIENCIAS ACTUARIALES Profesor/a: José Manuel, Castro Juan	ECTS:	CUATRIMESTRE: PRIMERO

CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA (versión detallada)								
SEMANA	SESIÓN	DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN	GRUPO (marcar X)		Indicar espacio Necesario distinto aula (aula informática, audiovisual, etc..)	TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA		
			1	2		DESCRIPCIÓN	HORAS PRESENCIALES	HORAS TRABAJO Semana Máximo 7 H
Primera	Teórica Práctica	Introducción a Market Value Liabilities, componentes (Financial component liabilities , Margen de riesgo) y curvas de descuento Derivación de hipótesis de mortalidad/longevidad Derivación de hipótesis de persistencia (rescates, liberaciones..)					3	
Segunda	Práctica	Profit testing: product o de riesgo, anual renovable.				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2
Tercera	Teórica Práctica	Introducción a Market Consistent Embedded Value MCEV: Principios de CFO Forum Profit testing: Producto de ahorro.				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2
Cuarta	Teórica Práctica	Market consistent embedded value y análisis de movimiento. Ejemplo de valoración de MCEV mediante la aplicación de los principios de CFO Forum. Profit testing: product Unit Linked con y sin garantías (variable annuity)				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2



Quinta	Teórica Práctica	Valoración bajo enfoque de balance de mercado: Market value balance sheet (MVBS). Valoración de pasivos y activos a valor de mercado y cálculo de margen de riesgo.				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2
Sexta	Teórica y práctica Práctica	Reconciliación de MCEV y MVBS Aplicación de sensibilidades de Mercado y no Mercado a la valoración bajo MCEV y MVBS.				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2
Séptima	Teórica y práctica Práctica	Introducción a la nueva norma de IFRS 17 para valoración de contratos de seguro.				Realizar ejercicio práctico de profit testing.	3	2
TOTAL HORAS								