



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

<b>CRONOGRAMA DE LA ASIGNATURA (versión detallada)</b>								
<b>SEMANA</b>	<b>SESIÓN</b>	<b>DESCRIPCIÓN DEL CONTENIDO DE LA SESIÓN</b>	<b>GRUPO (marcar X)</b>		<b>Indicar espacio Necesario distinto aula (aula informática, audiovisual, etc..)</b>	<b>TRABAJO DEL ALUMNO DURANTE LA SEMANA</b>		
			<b>1</b>	<b>2</b>		<b>DESCRIPCIÓN</b>	<b>HORAS PRESENCIALES</b>	<b>HORAS TRABAJO Semana Máximo 7 H</b>
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
<b>TOTAL HORAS</b>								