

Taller

Pricing Vida bajo Solvencia II con Macros

12 horas

Taller sin fines de lucro, una iniciativa de:

 Actuaries

4 Sábados

8:00am a 11:00am
hora México

Ponente:
Act. Adrián Téllez

Taller Pricing Vida bajo Solvencia II con Macros (12horas)

Considerar las implicaciones de Solvencia II en el Pricing es muy relevante sobre todo para seguros de Vida, por ello la importancia de tener embedido desde el Pricing métricas de rentabilidad consistentes con los principios de Solvencia II, y sobre todo para productos que consumen mucho capital bajo este esquema regulatorio. Dicho procedimiento forma parte de las mejores prácticas durante el Pricing o Repricing así como en el monitoreo del performance del precio posterior a su tarificación.

1. Tipos de Seguros

- Prima de Riesgo y Prima de Tarifa
- Funciones biométricas y Decrementos múltiples
- Valor de Rescate
- Asset Share

2. Tarificación base

- Árboles de regresión
- Bosques Aleatorios
- GBM

3. Breve introducción a Solvencia II

- BEL y MR
- Non Hedgeable Risks
- Requerimiento de Capital de Solvencia (RCS)

4. Métricas de rentabilidad bajo Solvencia II

5. Automatización de la calibración Pricing con macros

RActuaries

www.ractuaries.com

info@ractuaries.com

  [ractuaries](#)