



Universidad de Buenos Aires  
Facultad de Ciencias Económicas



# Decimoséptimas Jornadas Nacionales y Latinoamericanas Actuariales Jornada del Seminario de Integración y Aplicación Actuarial

Buenos Aires, 9, 10 y 11 de Noviembre de 2016

**UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES**  
**Facultad de Ciencias Económicas**

Presidente de las Jornadas:

**Prof. Dr. César Humberto Albornoz**

Comité Académico

Presidente: **Prof. Emérita Dra. María Teresa Casparri**

Vocales: **Prof. Act. María Alejandra Metelli, Prof. Dr. Eduardo Melinsky**

Comité Ejecutivo:

**Sub Dir CMA, Prof. Dr. Javier García Fronti**

**Sub Dir CS, Prof. Act. Daniel Aníbal Sarto**

**Sub Dir Mat, Prof Act. Juan Ramón Garnica Hervás, Prof. Dra. María José Bianco**

**Sub Director Carrera Act. Prof. Act. Alejandro Simón**

**Secretarios Prof. Act. Liliana N. Silva, Prof. Ing. Roberto García**

Colabora: **Alejandro Moirano.**

Organizan:

**Departamento Pedagógico de Matemática**

**Carrera de Actuario**

**Centro de Investigaciones del Seguro**

**Centro de Investigación en Métodos Cuantitativos Aplicados a la Economía y la Gestión (CMA - IADCOM)**

Tel.: (011) 5285-6539 e-mail: [cma@fce.uba.ar](mailto:cma@fce.uba.ar)

Tel.: (011) 5285-6609 e-mail: [dpm@fce.uba.ar](mailto:dpm@fce.uba.ar)

Entrada Libre y Gratuita

Salón de usos múltiples (SUM), Primer Piso

Ciudad Autónoma de Buenos Aires

Córdoba 2122 - 1120AAQ

**CMA** | CENTRO DE INVESTIGACIÓN  
EN MÉTODOS CUANTITATIVOS  
APLICADOS A LA ECONOMÍA  
Y LA GESTIÓN

Departamento Pedagógico de Matemática  
Centro de Investigaciones del Seguro

## **Miércoles 9**

### **15.00 – Acreditación**

### **15.30 – Conferencia Inaugural: Eduardo Melinsky: “Profesión y Planificación de la Formación Actuarial”**

### **16.00 – Complementos Metodológicos y Estadísticos**

- Javier García Fronti: “*Dependencia heterogénea entre colas de distribución: aplicación a la gestión de portafolios de créditos*”
- Simón Pristupín: “*Una introducción a la Gramática distributiva*”
- Enzo Di Muro y Silvia Svirtz: “*La biblioteca digital de la Facultad de Ciencias Económicas a un año de su puesta en producción*”
- Rodrigo Del Rosso: “*Un análisis del riesgo de mercado mediante la utilización de R*”

### **17.30 – Intervalo Café**

### **18.00 – Aspectos de Práctica Actuarial**

- Pablo Caviezel: “*Muertes violentas vs. Muertes naturales: hacia un esquema de decremento doble*”
- Cristian Sperandini: “*Técnicas heurísticas: Aplicación a una canasta de Activos*”
- Gerardo Totah: “*Introducción al Crédito Default Swap y Synthetic CDO*”

## **Jueves 10**

### **8.30 – Acreditación**

### **9.00 – Mesa: La Gestión del Riesgo como Ejercicio Profesional**

- Javier Aparicio: “*La función actuarial en un entorno de Solvencia*”
- Hugues Bertin: “*Dirija, apoye y beneficie de una estrategia basada en riesgos*”
- Carla Parodi: “*Aplicativos actuariales para la gestión de riesgo*”

### **10.15 – Intervalo Café**

### **10.30 – Mesa: Actuación Profesional Actuarial en Entidades Financieras**

- Carolina Castro y Delia Novello: “*La normativa de Basilea II-III aplicada en Agustina*”
- Hernán Pérez Raffo: “*La valuación de riesgos operacionales y de mercado*”
- Fernando Martucci: “*La valuación de Riesgo de Crédito*”

### **11.45 – Educación Actuarial y Profesionalismo**

- Luisa Kuklinski: “*Comenzando a conocer la Sociedad de Actuarios*”

### **13.00 – Intervalo Almuerzo**

### **15.00 – Mesa: Plan de Estudios de Actuarios**

- Lisa Kuklinski (SOA): “*Visión del Actuario en el Mundo Moderno*”
- María Alejandra Metelli: “*La Formación Estadística*”
- Daniel Aníbal Sarto: “*Cálculo Financiero en la formación actuarial*”
- Leonardo Berinstein: “*Los Requerimientos Profesionales de las Entidades Aseguradoras*”
- Hernán Pérez Raffo: “*Profesionalidad: Enfoque Local e Internacional*”
- Eduardo Melinsky: “*Modelización de la Gestión Institucional*”

### **16.30 – Intervalo Café**

### **17.00 – Mesa: Actuación Profesional Actuarial en la Seguridad Social**

- *Enfoque Multiprofesional:* Agata Mazzara, Jorge García Rapp, Alberto Muller
- *Tesinas y Experiencia:*
- Valentina San Martino: “*Sistema Previsional: adaptación del estudio de Peter Diamond y Nicholas Barr a la Argentina*”
- Federico Martín: “*Proyección de la situación financiera y sostenibilidad del Sistema Integrado Previsional Argentino (SIPA)*”
- Agustín Alonso: “*Equilibrio Puro en el Sistema de Reparto: ajuste en la edad de jubilación*”

## **Viernes 11**

### **8.30 – Acreditación**

### **9.00 – Exposición de Tesinas**

### **10.30 – Intervalo Café**

### **11.00 – Exposición de Tesinas**

### **13.00 – ACTO DE CIERRE**

### **Palabras a cargo del Decano Profesor Dr. César Humberto Albornoz**

### **ENTREGA DE PREMIOS Y DIPLOMAS**