

FORMULÁRIO Nº 13 – <i>ESPECIFICAÇÃO DA DISCIPLINA/ATIVIDADE</i>		
CONTEÚDO DE ESTUDOS		
ATUÁRIA		
NOME DA DISCIPLINA/ATIVIDADE	CÓDIGO	criação () ALTERAÇÃO: NOME () CH ()
GERÊNCIA DE RISCOS E RESERVAS TÉCNICAS	DCA00011 ANTIGO: STC00130	
DEPARTAMENTO/COORDENAÇÃO DE EXECUÇÃO: CONTABILIDADE/CIÊNCIAS ATUARIAIS		
CARGA HORÁRIA TOTAL: 60H	TEÓRICA: 60H	PRÁTICA: ESTÁGIO:
DISCIPLINA/ATIVIDADE: OBRIGATORIA (x)	OPTATIVA ()	AC ()
OBJETIVOS DA DISCIPLINA/ATIVIDADE:		
<p>Proporcionar ao aluno os conhecimentos necessários para identificação e gestão das questões que envolvam riscos sejam estes financeiros ou de outras áreas de atuação do atuário, bem como conhecer os princípios que norteiam o estabelecimento das reservas técnicas.</p>		
DESCRIÇÃO DA EMENTA:		
<p>Intermediação financeira. Mercado Bancário. Mercado de Câmbio. Mercado de Ouro. Mercados Futuros. Mercado de Opções. Aspecto probabilístico do risco. Processo de risco do número de reclamantes. Tempo operacional. Teorema de Cramér-Lundberg. Prêmio de risco e de credibilidade. Retenções e reservas. Problema de estabilidade. Teoria do Risco (Individual e Coletivo) Modelo do Risco Individual Anual, Modelo do Risco Coletivo Anual, Distribuição da Variável Aleatória “Valor de 1 Sinistro”, Distribuições para o Número de Sinistros, Distribuições para o Sinistro Agregado, Fórmula Recursiva de Panjer, Processo de Ruína – Período Finito, Processo de Ruína – Período Infinito, Teoria da Credibilidade, Aplicações em Resseguro, Aplicações Diversas.</p>		
BIBLIOGRAFIA BÁSICA:		
<p>RODRIGUES, José Ângelo. <i>Gestão de risco atuarial</i>. 1. ed. São Paulo: Saraiva, 2009.</p> <p>MARINS, André. <i>Mercados Derivativos e Análise de Risco: posições lineares</i>. v.1. São Paulo: MAS, 2009.</p> <p>MARINS, André. <i>Mercados Derivativos e Análise de Risco: posições não-lineares</i>. v.2. São Paulo: MAS, 2009.</p>		
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:		
<p>RESTI, Andrea. <i>Gestão do risco na atividade bancária e geração de valor para o acionista</i>. Rio de Janeiro: Qualitymark, 2010.</p> <p>DUARTE JUNIOR, Antonio Marcos. <i>Gestão de riscos para fundos de investimentos</i>. São Paulo: Prentice Hall Brasil, 2005.</p> <p>FERREIRA, P.P. <i>Modelos de Precificação e Ruína para Seguros de Curto Prazo</i>. Rio de Janeiro: Funenseg, 2002.</p>		

COORDENADOR

CHEFE DE DEPTO/COORDENADOR

DATA ____/____/____

DATA ____/____/____

Março/13