

FORMULÁRIO Nº 13 – <i>ESPECIFICAÇÃO DA DISCIPLINA/ATIVIDADE</i>		
CONTEÚDO DE ESTUDOS		
MATEMÁTICA ATUARIAL		
NOME DA DISCIPLINA/ATIVIDADE	CÓDIGO	criação () ALTERAÇÃO: NOME () CH ()
MATEMÁTICA ATUARIAL III	DCA00016 ANTIGO: STC00137	
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>Permitir que o aluno adquira os conhecimentos necessários para o desenvolvimento de aplicações com a utilização da matemática atuarial, especialmente nos segmentos do seguro, resseguro e da previdência.</p>		
DESCRIBÇÃO DA EMENTA:		
<p>Modelagem atuarial. Risco: Teoria individual, teoria da ruína e teoria da credibilidade de flutuação Limitada. Teoria de sobrevivência aplicada à ciência atuarial: Definição das variáveis aleatórias discreta e contínua representantes do “tempo até a falha”. Probabilidades de sobrevivência e morte. Força de mortalidade. Função de densidade de mortalidade para uma vida na idade x. O valor segurado como variável aleatória. O valor presente atuarial como valor esperado, variância e covariância de valores presentes. Anuidades por sobrevivência individuais. Prêmios puros. Reservas matemáticas de prêmios puros nivelados. Teoria dos Prêmios comerciais e despesas. Noções de resseguro.</p>		
BIBLIOGRAFIA BÁSICA:		
<p>RODRIGUES, J. <i>A.Gestão de risco atuarial</i>. São Paulo: Saraiva, 2009. FERREIRA, P.P. <i>Modelos de precificação e ruína para seguros de curto prazo</i>. Rio de Janeiro: Funenseg, 2002. AZEVEDO, G.H.W. <i>Matemática Financeira e atuarial: noções aplicadas ao seguro</i>. Rio de Janeiro: Funenseg, 2005. CORDEIRO FILHO, A. <i>Cálculo Atuarial Aplicado: teoria e aplicações</i>. São Paulo: Atlas, 2009. VERAS, L. L. <i>Matemática Financeira</i>, 4. Ed. São Paulo: Atlas, 2001</p>		
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:		
<p>HART, D.G.; BUCHANAN, R.A.; HOWE, B.A. <i>The actuarial practice of general insurance</i>. 5 ed. Sydney, Australia: Institute of Actuaries of Australia, 1996. BOWERS, N.L.; GERBER, H.U.; HICKMAN, J.C.; JONES, D.A.; NESBITT, C.J. <i>Actuarial Mathematics</i>. Illinois, USA: The Society of Actuaries, 1986 ANDERSON, A.W. <i>Pension Mathematics for actuaries</i>. Illinois, USA: The Society Of Actuaries; Actex Publications, 1992 IYER, S. <i>Matemática atuarial de sistemas de previdência social</i>. Brasília: Ministério da Previdência Social, 2002. (trad. “Actuarial mathematics of social security pensions”. Disponível em: <http://www.previdenciasocial.gov.br/arquivos/office/3_081014-111358-623.pdf></p>		

COORDENADOR

CHEFE DE DEPTO/COORDENADOR

DATA ____/____/____

DATA ____/____/____

Março/13