

FORMULÁRIO Nº 13 – ESPECIFICAÇÃO DA DISCIPLINA/ATIVIDADE		
CONTEÚDO DE ESTUDOS		
ATUÁRIA		
NOME DA DISCIPLINA/ATIVIDADE	CÓDIGO	criação () ALTERAÇÃO: NOME () CH ()
GERÊNCIA DE RISCOS E RESERVAS TÉCNICAS	DCA 00011	
DEPARTAMENTO/COORDENAÇÃO DE EXECUÇÃO: CIÊNCIAS ATUARIAIS E FINANÇAS/CIÊNCIAS ATUARIAIS		
CARGA HORÁRIA TOTAL: 60H	TEÓRICA: 60H	PRÁTICA: ESTÁGIO:
DISCIPLINA/ATIVIDADE: OBRIGATÓRIA (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 Angelo. Gestão de risco atuarial. São Paulo: Saraiva, 2008.</p> <p>FERREIRA, Paulo Pereira; MANO, Cristina Cantanhete Amarante. Aspectos atuariais e contábeis das provisões técnicas. Rio de Janeiro: Funenseg, 2009. Disponível em: < http://www.docvirt.no-ip.com/funensegbiblioteca/home.htm >. Acesso em: 31 jan. 2018.</p> <p>DOMENEGHETTI, Valdir. Previdência complementar: gestão financeira de fundos de pensão. Ribeirão Preto: Inside Books, 2009.</p>		
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:		
<p>LEMGRUBER, Eduardo Facó; SILVA, André Luiz Carvalhal da; LEAL, Ricardo Pereira Câmara; COSTA JUNIOR, Newton Carneiro Affonso da (Org.). Gestão de risco e derivativos: aplicações no Brasil. São Paulo: Atlas, 2001.</p> <p>OLIVEIRA, Assizio. Controle interno e gestão de riscos no mercado segurador brasileiro: conceitos, regulamentos, práticas e auditoria. 2. ed. Rio de Janeiro: Funenseg, 2014. Disponível em: < http://www.docvirt.no-ip.com/funensegbiblioteca/home.htm >. Acesso em: 31 jan. 2018.</p> <p>SILVA, José Pereira da. Gestão e análise de risco de crédito. 5. ed. São Paulo: Atlas, 2006.</p>		

DATA ____/____/____

DATA ____/____/____