

Novas Tendências da Prática Atuarial

Rio de Janeiro: 1º de abril, auditório do RDC da PUC-Rio

São Paulo: 2 de abril, auditório da POLI da USP

Participe do seminário intitulado **Novas Tendências da Prática Atuarial** que contará com a palestra de quatro renomados pesquisadores internacionais que estarão discutindo o estado da arte sobre novas práticas de modelagem de riscos financeiros e atuariais. Para possibilitar o acesso ao maior número de profissionais, o evento será realizado em Rio de Janeiro (1º de abril) e São Paulo (2 de abril), em dias consecutivos, com a palestra de três destes pesquisadores em cada dia.

A organização deste evento foi possível graças a presença dos palestrantes Arthur Charpentier, Ermanno Pitacco, Ragnar Norberg e Richard Davis na **Fourth Brazilian Conference on Statistical Modelling in Insurance and Finance** a ocorrer em Maresias/SP entre os dias 4 e 8 de abril (veja o seguinte site para maiores informações: www.ime.usp.br/bcsmif).

Os temas abordados neste seminário foram escolhidos de acordo com as pesquisas recentes destes acadêmicos, mas também levando em consideração a discussão atual dos mercados financeiros de uma forma geral e dos mercados de seguros, previdência e resseguros especificamente.

Os interessados podem fazer sua inscrição através do formulário no item 'Satellite Meeting' no site www.ime.usp.br/bcsmif ou da Ficha de Inscrição em anexo.

Atenção: as palestras serão proferidas em inglês!



Arthur Charpentier

University of Rennes 1, France

Oteve seu PhD em 2006 coroadando uma vida acadêmica que se iniciou em 2002. Possui diversas publicações e um contínuo interesse no estudo de cópulas, teoria de valores extremos com aplicação em finanças e seguros, mensuração de riscos, diversificação, dentre outras.

Ermanno Pitacco

University of Trieste, Italy

Renomado pesquisador em Atuária, o prof. Ermanno Pitacco é diretor do programa de Mestrado em Seguros e Gerenciamento de Riscos da Universidade de Trieste e também editor da revista "Insurance: Mathematics and Economics", dentre outras atividades acadêmicas. Sua pesquisa abrange diversas áreas, incluindo seguro de vida e pensão.

Ragnar Norberg

London School of Economics, UK

Acadêmico há mais de 30 anos, o prof. Norberg é editor da revista "Insurance: Mathematics and Economics" e referee de outras 17. Possui inúmeras publicações em diversas áreas, incluindo tanto o ramo vida quanto o não vida, principalmente com aplicação em finanças.

Richard Davis

Columbia University, USA

Acadêmico há mais de 25 anos, o prof. Davis é co-autor do livro best-seller "Time Series: Theory and Methods", "Introduction to Time Series and Forecasting". Sua pesquisa é focada em estatística aplicada, series temporais e processos estocásticos.

Novas Tendências da Prática Atuarial

PÚBLICO ALVO

Profissionais que atuam no setor de serviços financeiros em atividades de análise de riscos.

PROGRAMA para ambas cidades/dias

08:30h às 09:00h – Inscrições
09:00h às 10:30h – Arthur Charpentier (RJ e SP)
10:30h às 11:00h – *coffee-break*
11:00h às 12:30h – Richard Davis (RJ e SP)
12:30h às 14:00h – *almoço livre*
14:00h às 15:30h – Ragnar Norberg (RJ 01/04)
14:00h às 15:30h – Ermanno Pitacco (SP 02/04)

PREÇOS

Profissionais	R\$400,00
Profissionais associados do IBA e/ou da ABE	R\$300,00
Alunos universitários (vagas limitadas)	R\$100,00

O preço inclui *coffee-break* e material, mas não inclui almoço

Após a inscrição via site ou formulário o pagamento deve ser feito através de transferência bancária para a conta do evento (Banco Santander, agência 0658, conta corrente 13006798-9).

Faça a inscrição e efetue o pagamento até **23/03/2009**. Após esta data o valor do evento receberá um acréscimo de 10%.

Também nesta data, a organização se reserva o direito de cancelar o evento e restituir as inscrições já pagas caso os inscritos não alcancem o número mínimo necessário.

Alunos universitários devem encaminhar também comprovante atualizado de matrícula quando da confirmação da inscrição. PARA TER DIREITO A INSCRIÇÃO REDUZIDA ESTE NÃO DEVE TER EMPREGO COM DEDICAÇÃO A TEMPO INTEGRAL

Arthur Charpentier

Cálculo de Reservas de Sinistros com R

Nesta palestra serão mostradas formas de cálculos de reservas de sinistros do ramo não vida utilizando o pacote estatístico gratuito R. Desta forma, variações sobre o valor escolhido da reserva poderão ser mensuradas e incluídas no cálculo de capital, conforme exigido pelos modelos de controles internos.

Ermanno Pitacco

Gestão do Risco de Longevidade em Carteiras de Vida e Aposentadorias em Fundos de Pensão

Os tópicos principais desta apresentação são os riscos para seguradoras de vida e para aposentadorias sob a perspectiva do gerenciamento destes riscos, da medição de riscos demográficos e de modelos estocásticos versus determinísticos.

Ragnar Norberg

Gestão de Riscos Financeiros e Demográficos em Seguro de Vida e em Aposentadoria: produtos com distribuição de lucros, tipo “unit-link” e securitizados.

Discussão atual sobre riscos financeiros, seguro de vida e aposentadoria.

Richard Davis

“Structural Breaks” em Séries Temporais

Serão analisadas séries temporais não estacionárias (data com mudança de média, variância ou estrutura de dependência).

MAIORES INFORMAÇÕES:

www.ime.usp.br/bcsmif – Item ‘Satellite Meeting’

Email: maresias@ime.usp.br Tel: (11) 3091 6129 (Cecília Campanha) e fax: (11) 3091 6130



Novas Tendências da Prática Atuarial

Ficha de Inscrição

Informações Básicas

Participante:

CPF:

Local de preferência: Rio de Janeiro (01/04) São Paulo (02/04)

Inscrição: Pessoa Física

Pessoa Jurídica

Nome da Empresa:

CNPJ:

NOME PARA CRACHÁ (até 20 caracteres):

Endereço

Endereço:

CEP:

Cidade:

Estado:

Telefone: ()

Fax: ()

E-mail:

Local e Data

Assinatura

Enviar o formulário preenchido para o fax (11) 3091 6130 ou o Email maresias@ime.usp.br

LOCAL DO SEMINÁRIO

Dia 01/04/2009 no Rio de Janeiro – PUC-Rio – Auditório do RDC – Rua Marquês de São Vicente, 225 – Gávea, Rio de Janeiro

Dia 02/04/2009 em São Paulo – USP – Auditório da POLI/USP (Prédio da Administração), Av. Prof. Luciano Gualberto, travessa 3, nº 380 – Cidade Universitária, São Paulo

