

**Planos de Ensino – ADE – Ciências Atuariais**

<b>Nome da Unidade Curricular: Gerência financeira das reservas técnicas</b>	
<b>Departamento Responsável: Ciências Atuariais</b>	
<b>Curso: Ciências Atuariais</b>	
<b>Professor(a) Responsável (% CH):</b> Humberto Gallucci Netto <b>Professor(a) Colaborador (% CH):</b> -	
<b>Ano Letivo:</b> 2020	<b>Semestre:</b> 7º/9º
<b>Termo:</b> I/N	<b>Categorial da UC:</b>
<b>Dia da semana e horário: segunda-feira (integral e noturno)</b>	
<b>Atividades Síncronas: abaixo</b>	
<b>METODOLOGIA DE ENSINO</b> A unidade curricular será ministrada em modo ADE em ambiente virtual: Moodle e Zoom. Todo o material necessário para o acompanhamento da disciplina será postado no Moodle. Atividades: aulas síncronas e assíncronas gravadas disponibilizadas no ambiente virtual (16h); dúvidas e resoluções de exercícios (16h); exercícios e material extra (20h). 8 horas de aula presencial realizadas em março. Total 60 horas  Será disponibilizado material extra (vídeos e artigos científicos para discussão) com conteúdo relevante e complementar para assimilação dos conceitos discutidos.	
<b>METODOLOGIA DE AVALIAÇÃO</b> O aluno será avaliado do seguinte modo: a) Três trabalhos em grupo (70% da nota) b) Entrega de exercícios semanais (30% da nota)  A presença do aluno será contabilizada com a entrega de exercícios semanais no Moodle.	
<b>O conceito final da unidade curricular "cumprido/não cumprido".</b>	
<b>REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS</b> Lei Complementar 108/109/2001 Resolução 3792/2009 do Conselho Monetário Nacional. Resolução 321/2015 do Conselho de Seguros Privados. Instruções Previc 01/2013, 07/2013, 12/2014, 18/2014, 19/201, 23/2015, 32/2016. Comitê de Pronunciamentos Contábeis n.14 (CPC 14). Guia Previc de Melhores Práticas Atuariais. Coletânea de Normas de Fundos de Pensão.	

Assaf Neto, Alexandre. Mercado Financeiro 12<sup>a</sup>. Edição, Editora Atlas, 2012.

Bodie Zvi; Kane, Ales; Marcus, Alan. Investimentos. 8ed. McGraw-Hill.

Brealey, Richard A; Myers, Stewart C; Allen, Franklin. Princípios de finanças corporativas. São Paulo, SP: McGraw-Hill, 2012

Fabozzi, Franco. Capital Markets: institutions, instruments, and risk management. 5ed. MIT Press.

Hull, John C. Options, futures and other derivatives. 7 ed. Pearson.

Swensen, David F. Pioneering portfolio management. 2ed. Free Press.

### **Cronograma de aulas semanais**

<b>Semana</b>		<b>Conteúdo programático</b>
1	06 - 11 de julho	Modelos: carteira de renda variável (videoaula e atividades)
2	13 - 18 de julho	Congresso Acadêmico
3	20 -25 de julho	Modelos: carteira de renda fixa (videoaula e atividades)
4	27 de julho - 01 de agosto	Modelos: opções, contrato futuro, contrato a termo e swap (videoaula e atividades)
5	03-08 de agosto	Modelos com restrições (videoaula e atividades)
7	10-15 de agosto	ALM e LAT (videoaula e atividades)
8	17 -22 de agosto	ALM e LAT (videoaula e atividades)
9	24 -29 de agosto	Precificação e desempenho (videoaula e atividades)
10	31 de agosto - 05 de setembro	Análise de risco (videoaula e atividades)
11	07-12 de setembro	Análise de risco (videoaula e atividades)
*12	14 -19 de setembro	Classes de ativos alternativos (videoaula e atividades)
13	21 -26 de setembro	Classes de ativos alternativos (videoaula e atividades)
14	28 de setembro-03 de outubro	Processo de investimento (videoaula e atividades)
15	05 -10 de outubro	
16	12 -17 de outubro	
Exame	19 -26 de outubro	