

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Matrícula: 1803236 Nome: ADRIAN HERINGER PIZZINGA

Classe: PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR - ADJUNTO

Nível 603

Titulação DOUTORADO-ENGENHARIA ELÉTRICA |

Reg. Trabalho Semanal DE

Assinatura : _____

Aprovado na reunião do Departamento de 4 de 4 de 2016

Assinatura do Chefe do Departamento Ana Maria Lima de Farias

Visto do Diretor da Unidade Celso Costa

ANA MARIA LIMA DE FARIAS
 Chefe-Dept Estatística
 SIAPE 0311506

Professor Celso Costa
 Diretor do Instituto de
 Matemática e Estatística
 SIAPE 030744

Administração

Função ou Atividade	Tipo	Orgão	Matrícula de Designação	CH
PROFESSOR	REUNIÃO - DEPARTAMENTO, CONSELHOS, ETC	GET	null	14
PROFESSOR	COMISSAO PERMANENTE	GET	null	100

Aula

Período	Disciplina	Turma	Nível	Cod.Emec/Num Alunos	Carga Horária Anual			
					Teórica	Prática	Estagi	Acess.
1/2015	ESTATÍSTICA BÁSICA APLICADA ÀS CIÊNCIAS HUMANAS	A1	GRA	12686-4 312686-17 312703-1	80	0	0	160
1/2015	PROBABILIDADE E ESTATÍSTICA	A1	GRA	12710-14	68	0	0	136
2/2015	ESTATÍSTICA BÁSICA PARA ENGENHARIA	B1	GRA	12718-18 12720-4	60	0	0	120
2/2015	ESTATÍSTICA BÁSICA PARA ENGENHARIA	F1	GRA	12719-4 12720-10 12721-14	60	0	0	120

Especial

Descrição	Instituição	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
PARTICIPACAO EM BANCA DE DEFESA DE TESE DE DOUTORADO DE CESAR NEVES	PONTIFÍCIA UNIVERSIDADE CATÓLICA DO RIO DE JANEIRO	3	50
ESTE DOCENTE REALIZOU ATIVIDADES RELACIONADAS A CONFECCAO E PULICAO DE UM ARTIGO CIENTIFICO. OS DETALHES ESTAO LISTADOS NA SECAO DE PRODUTOS.	UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE	200	0

Orientação

Aluno	Semestre	Tipo	Nível	Orgão	Curso
-------	----------	------	-------	-------	-------

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Orientação

Aluno	Semestre	Tipo	Nível	Órgão	Curso
THALITA PAULA MONTEIRO	1/2015	TRABALHO FINAL DE CURSO	GRADUAÇÃO	GET	ESTATÍSTICA
TOTAL DE HORAS DE ORIENTAÇÃO					150

Produto(s)

Produto : 1

Departamento:	DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA	Perfil	Participante
Projeto:			
Título do produto:	Modeling and predicting IBNR reserve: extended chain ladder and heteroscedastic regression analysis		
Idioma	INGLÊS		
País:	ESTADOS UNIDOS(USA)		
Tipo de produto:	ARTIGO EM PERIÓDICO INTERNACIONAL COM CORPO EDITORIAL		
Ano de publicação:	2015		
Área de	ESTATISTICA		
Referência	<p>[1] R. Atherino, A. Pizzinga, and C. Fernandes, A row-wise stacking of the runoff triangle: State space alternatives for IBNR reserve prediction, <i>Astin Bull.</i> 40(2) (2010), pp. 917-946.</p> <p>[2] S. Christofides, Regression models based on log-incremental payments, in <i>Claims Reserving Manual</i>, Vol. 2, Institute of Actuaries, 1990.</p> <p>[3] P.D. England, and R.J. Verrall, Standard errors of prediction in claims reserving: A comparison of methods, in <i>General Insurance Convention & Astin Colloquium</i>, Vol. 1, Institute of Actuaries, 1998, pp. 459-478.</p> <p>[4] P.D. England and R.J. Verrall, A flexible framework for stochastic claims reserving, <i>Casualty Actuar. Soc.</i> 88 (2001), pp. 1-38.</p> <p>[5] P.D. England and R.J. Verrall, Stochastic claims reserving in general insurance, <i>J. Inst. Actuar.</i> 129 (2002), pp. 1-76.</p> <p>[6] W.H. Greene, <i>Econometric Analysis</i>, 5th ed., MacMillan, New York, 2003.</p> <p>[7] J. Johnston and J. E. DiNardo, <i>Econometric Methods</i>, 4ª edição., McGraw-Hill Pub. Co., New York, 1997.</p> <p>[8] P. de Jong, Forecasting runoff triangles, <i>N. Am. Actuar. J.</i> 10(2) (2006), pp. 28-38.</p> <p>[9] P. de Jong and G.Z. Heller, <i>Generalized Linear Models for Insurance Data</i>, Cambridge University Press, Cambridge, 2008.</p> <p>[10] P. de Jong and B. Zehnwirth, Claims reserving, state-space models and the Kalman filter, <i>J. Inst. Actuar.</i> 110 (1983), pp. 157-181.</p> <p>[11] R. Kaas, M. Goovaerts, J. Dhaene, and M. Denuit, <i>Modern Actuarial Risk Theory: Using R</i>, 2nd ed., Springer, New York, 2009.</p> <p>[12] E. Kremer, IBNR claims and the two-way model of ANOVA, <i>Scand. Actuar. J.</i> 1982(1) (1982), pp. 47-55.</p> <p>[13] T. Mack, Measuring the variability of chain ladder reserve estimates, in <i>Casualty Actuarial Society Spring Forum</i>, 1993, pp. 101-182.</p> <p>[14] T. Mack, Which stochastic model is underlying the chain ladder method? <i>Insurance Math. Econom.</i> 15 (1994), pp. 133-138.</p> <p>[15] A.E. Renshaw and R.J. Verrall, A stochastic model underlying the chain-ladder technique, <i>Br. Actuar. J.</i> 4(IV). 4 (1998), pp. 903-923.</p> <p>[16] G. Taylor, <i>Loss Reserving: An Actuarial Perspective</i>, Springer, New York, 2000.</p> <p>[17] G.C. Taylor and F.R. Ashe, Second moments of estimates of outstanding claims, <i>J. Econometrics.</i> 23</p>		

Produto(s)

- (1983), pp.
37 e 61.
- [18] R. Verrall, A state space representation of the chain ladder linear model, J. Inst. Actuar. 116 (1989), pp. 589 e 609.
- [19] R. Verrall, Statistical methods for the chain ladder technique, Casualty Actuar. Soc. Spring Forum. (1994), pp. 393 e 445.
- [20] R.J. Verrall, An investigation into stochastic claims reserving and the chain-ladder technique, Insurance Math. Econom. 26 (2000), pp. 91 e 99.
- [21] H. White, A heteroscedasticity-consistent covariance matrix estimator and a direct test for heteroscedasticity, Econometrica. 48 (1980), pp. 817 e 838.
- [22] J.M. Wooldridge, Introductory Econometrics: A Modern Approach, 2nd ed., South-Western College Publishing, Australia, 2000.
- [23] M.V. Wüthrich and M. Merz, Stochastic Claims Reserving Methods in Insurance, Wiley Finance, New York, 2008.
Downloaded