

CMUP CENTRO DE MATEMÁTICA da UNIVERSIDADE DO PORTO BOLSAS DE INVESTIGAÇÃO
--

O **CMUP** (Centro de Matemática da Universidade do Porto) aceita candidaturas para a atribuição de uma **Bolsa de Investigação** (em Matemática), a licenciados ou mestres, ao abrigo do programa de financiamento plurianual 2003-2005 (no âmbito dos programas operacionais Ciência Tecnologia e Inovação (POCTI) e Sociedade da Informação (POSI), comparticipados por Fundos da UE e por Fundos Nacionais do NCES.)

A bolsa será atribuídas no seguinte “**Projecto de Investigação**”:

- **Projecto:** “**Problemas de teoria da ruína para modelos com dependência**”.

Responsável: Margarida Brito (FCUP).

Área: Probabilidades e Estatística

Descrição: Pretende-se estudar os tempos de ruína para processos de risco com possível dependência entre os instantes dos pedidos de indemnização e os montantes correspondentes. O problema dos tempos de ruína já foi estudado para modelo clássico de Cramer-Lundberg (ver p.e. [1]). Em [2] é introduzido um modelo de risco onde a distribuição dos tempos entre ocorrências depende do montante da última indemnização. As transformadas de Laplace das probabilidades de sobrevivência para este modelo so obtidas em [2].

Numa primeira fase será investigado o comportamento dos tempos de ruína neste modelo considerando distribuições usuais de indemnizações. Pretende-se ainda considerar este problema sob outro tipo de estrutura de dependência.

Referências

- 1 Lin X., Willmot, G., 2000. The moments of time of ruin, the surplus before ruin, and the deficit at ruin. *Insurance: Mathematics and Economics* 27, 19-44.
- 2 Albrecher H., O. Boxma., 2004. A ruin model with dependence between claim sizes and claim intervals. *Insurance: Mathematics and Economics* 35, 245-254.

Para mais informações sobre este concurso, consultar **cmup.fc.up.pt** (Bolsas). A atribuição e o funcionamento das bolsas será feita de acordo com o “Regulamento de Bolsas de Investigação Científica” também disponível no mesmo site.

Os candidatos devem enviar uma carta ao CMUP onde indiquem qual o projecto a que se candidatam, Curriculum Vitae, duas cartas de recomendação e todas as informações relevantes para a execução do projecto pretendido.

Calendarização do processo: *Período de submissão das candidaturas:* 14 a 28 de Junho de 2005 ; *Seriação e publicação dos resultados:* 28 a 30 de Junho de 2005; *Prazo de concessão das bolsas:* 1 de Julho a 31 de Dezembro de 2005.

As candidaturas devem ser enviadas por correio azul para: CMUP; Bolsas de Investigação; Dep. Matemática Pura; Rua do Campo Alegre, 687; 4169-007 Porto

Porto, 10 de Junho de 2005

João Nuno Tavares
(Coordenador Científico do CMUP)

UNIÃO EUROPEIA - Fundos Estruturais, POCTI - Programa Operacional “Ciência, Tecnologia, Inovação”, Governo da República Portuguesa e POSI - Programa Operacional “Sociedade da Informação”.