

César da Rocha Neves

Doutor em Engenharia
Atuário

[linkedin.com/in/césar-neves-526645101](https://www.linkedin.com/in/césar-neves-526645101)

I. Formação:

. Doutor em Engenharia; Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro – PUC-Rio (2012 - 2015).

Tese: Essays on Dynamic Modeling in Life Insurance and Private Pension: Longevity, Surrender and Embedded Options.

. Mestre em Engenharia; Universidade Federal do Rio de Janeiro – COPPE/UFRJ (2002-2004).

. MBA em Finanças; Universidade Federal do Rio de Janeiro – COPPEAD/UFRJ (2007).

. MBA em Engenharia Financeira e Econômica; Universidade Federal Fluminense (2000-2001).

. Graduação com *Cum Laude* em Ciências Atuariais; Universidade Federal do Rio de Janeiro (1996-1999).

. Formação para Conselheiros de Administração no Instituto Brasileiro de Governança Corporativa - IBGC (outubro de 2023 – fevereiro de 2024).

II. Experiências Profissionais:

1. Superintendência de Seguros Privados (desde agosto de 2001)

. **Posição atual:** Diretor de Supervisão Prudencial e de Resseguros: desde de 29 de abril de 2026

- . Supervisão prudencial, inclusive no que se refere às práticas de governança, gestão de riscos, controles internos e prevenção à lavagem de dinheiro e ao financiamento do terrorismo.
- . Supervisão das operações de resseguro e retrocessão.

. Coordenador-Geral de Regulação Prudencial e Contabilidade: de 1º a 29 de abril de 2026:

- Regulação de:
 - . Capital e provisão técnica.
 - . Gestão de risco, controles internos e governança.

- . Contabilidade e auditoria.
- . Sustentabilidade / ASG.
- . Investimento.
- . Cooperativas de seguros.
- . Proteção patrimonial mutualista.
- . Lavagem de dinheiro e prevenção e combate ao financiamento ao terrorismo.

. Presidente do Comitê Técnico da Susep: de novembro de 2021 até novembro de 2022, e de novembro de 2024 até a novembro de 2025.

- Comitê deliberativo formado pelos Coordenadores-Gerais para análise de atos normativos propostos pela Susep.

. Membro do Conselho Gestor do Comitê Interinstitucional da Taxonomia Sustentável Brasileira (CITSB): desde de abril de 2024 até abril de 2026

. Representante da Susep no Comitê Brasileiro de Pronunciamentos de Sustentabilidade (CBPS): desde de novembro de 2022 até abril de 2026

. Coordenador-Geral de Regulação Prudencial, Societária e de Governança: desde maio de 2024 de abril de 2026

- Regulação de:
 - . Capital e provisão técnica.
 - . Gestão de risco, controles internos e governança.
 - . Contabilidade e auditoria.
 - . Sustentabilidade / ASG.
 - . Investimento.
 - . Regimes especiais e regimes repressivos.
 - . Atos societários e autorizações e licenciamento de empresas.
 - . Cooperativas de seguros.
 - . Proteção patrimonial mutualista.
 - . Registro de apólices.
 - . Lavagem de dinheiro e prevenção e combate ao financiamento ao terrorismo.
 - . Open Insurance.

. Coordenador-Geral de Regulação Prudencial: agosto de 2019 até maio de 2024:

- Regulação de:
 - . Gestão de risco, controles internos e governança.
 - . Contabilidade e auditoria.
 - . Sustentabilidade / ASG.
 - . Capital e Provisão.
 - . Investimento.
 - . Registro de apólices.
 - . Lavagem de dinheiro e prevenção e combate ao financiamento ao terrorismo.

. Open Insurance.

. Coordenador-Geral de Monitoramento de Conduta: fevereiro de 2017 até agosto de 2019:

- Regulação de seguros, previdência, resseguro e capitalização.
- Desenvolvimento de novos produtos.
- Monitoramento de conduta e práticas de mercado.
- Aprovação e monitoramento de produtos de seguros, previdência e capitalização.

. Coordenador de Análise e Práticas de Mercado: 2016 – 2017:

- Monitoramento de ramos de seguros.
- Análise de práticas de mercado.
- Estruturação da matriz de risco de conduta de mercado.
- Assessoria à diretoria.

. Coordenador de Monitoramento de Risco: 2009 – 2011:

- Regulação de riscos e de capitais baseado em risco dos mercados de seguro, previdência, resseguro e capitalização.
- Desenvolvimento das fórmulas padrão para os capitais baseados em risco de subscrição de vida e previdência, de subscrição de capitalização, de risco de mercado, de risco de crédito e de risco operacional.
- Programação estocástica e simulação de Monte Carlo para mensuração de risco.
- Monitoramento dos capitais baseado em risco.

. Coordenador Técnico de Estudos Atuariais: 2003 – 2009:

- Regulação e análise de seguro rural.
- Avaliação atuarial dos seguros DPVAT e DPEM.
- Precificação.
- Avaliação atuarial do seguro habitacional dentro do SFH.

. Analista da Divisão de Seguro de Vida: 2001-2003:

- Desenvolvimento da nota técnica atuarial do PGBL e VGBL.
- Regulação de seguro de pessoas.
- Análise de planos de seguro.

2. Universidade do Estado do Rio de Janeiro (desde 2006):

- **Professor Associado de Ciências Atuariais**: Práticas Atuariais em Previdência, Tópicos Especiais em Atuária, Matemática Atuarial I, Matemática Atuarial II, Teoria do Risco, Finanças Comportamentais e Introdução à Atuária.
- **Coordenador do Curso de Ciências Atuariais**: 2022-2023.

3. Universidade Federal do Rio de Janeiro (desde 2017):

- **Professor de Pós-graduação de Ciências Atuariais:** Matemática Atuarial em Seguro de Vida e Previdência.

4. Revista Brasileira de Risco (desde 2016): Membro do Conselho Editorial

5. Membro Colaborador da Comissão Especial de Previdência Privada da OAB/SP (desde de 2022)

6. Icatu Hartford Seguradora: 2000-2001

- Atuário em previdência complementar aberta e fechada, e seguros de vida

III. Prêmios:

. Vencedor do Concurso Internacional Ayudas a la investigación Ignacio H. Larramendi de 2013 da Fundación Mapfre:

Livro: *Opções embutidas em planos unit-linkeds brasileiros: avaliação sob a medida de probabilidade real.*

. Vencedor do Concurso Internacional Ayudas a la investigación Ignacio H. Larramendi de 2015 da Fundación Mapfre:

Livro: *Modelo Interno: Otimização Simultânea do Capital Baseado em Risco e da Carteira Ótima de Ativos.*

. Vencedor do Prêmio Especial na Categoria Regulação do Mercado do Concurso ENS/PUC-Rio de Artigos Acadêmicos em Seguros de 2022.

Artigo: *Direct Approach to Assess Risk Adjustment under IFRS 17.*

IV. Outras Informações:

. Membro da Academia Central da Casualty Actuarial Society (CAS) dos EUA.

. Membro do Conselho Editorial da Revista Brasileira de Risco e Seguros.

. Membro Colaborador da Comissão Especial de Previdência Privada da OAB/SP.

. Projeto: Modelagem das fórmulas padrão de capital baseado em risco de subscrição de operadoras de saúde para a Agência Nacional de Saúde Suplementar (ANS). O modelo é utilizado pelas operadoras de saúde por força de regulamentação da ANS. Contratado pela Pan American Health Organization (PAHO) / World Health Organization (WHO), de setembro de 2017 a junho de 2018.

VI. Produções Acadêmicas: 26 artigos completos, 6 livros publicados, 1 livro organizado e 13 capítulos em livros.

Artigos Internacionais:

- . Extrapolating Long-Run Yield Curves: An Innovative and Consistent Approach. North American Actuarial Journal, v. 26, p. 1-21, 2022.
- . Five different distributions for the Lee-Carter model of mortality forecasting: A comparison using GAS models. Insurance. Mathematics & Economics, v. 75, p. 48-57-57, 2017.
- . Evaluating the Technical Provisions for Traditional Brazilian Annuity Plans: Continuous-Time Stochastic Approach Based on Solvency Principles. North American Actuarial Journal, v.20, p.1 - 17, 2016.
- . Forecasting longevity gains for a population with short time series using a structural SUTSE model: an application to Brazilian annuity plans. North American Actuarial Journal, v.20, p.37 - 56, 2016.
- . Forecasting longevity gains using a seemingly unrelated time series model. Journal of Forecasting, v.34, p.661 - 674, 2015.
- . Forecasting Surrender Rates Using Elliptical Copulas and Financial Variables. North American Actuarial Journal, v.18, p.343 - 362, 2014.
- . Bayesian Graduation of Mortality Rates: an application to reserve evaluation. Insurance. Mathematics & Economics, v.40, p.424 - 434, 2006.

Principais Artigos Nacionais:

- . Abordagem direta para avaliar o ajuste de risco de acordo com a IFRS 17. Revista Brasileira de Contabilidade, v. 33, p. e1646, 2022.
- . Transferência de Risco de Longevidade. Revista Brasileira de Risco e Seguro (Online), v. 12, p. 1-26, 2016.
- . Mensuração do Risco de Sorteio em Títulos de Capitalização. Revista Brasileira de Finanças (Impresso), v. 10, p. 197-2013, 2012.
- . A estrutura a termo de taxas de juros no Brasil: modelos, estimação e testes. Economia Aplicada (Impresso), v. 16, p. 255-290, 2012.

Livros publicados/organizados

- . Risco de subscrição no mercado de saúde suplementar brasileiro: uma nova regulamentação. 1. ed. Brasília: Organização Pan-Americana da Saúde (OPAS), 2021. v. 1. 146p.
- . Otimização conjunta do capital baseado em risco e da carteira de ativos: técnicas de otimização robusta para um modelo interno parcial de uma companhia seguradora. 1. ed. Madri: Fundación Mapfre, 2018. v. 1. 76p .
- . Ensaio sobre Modelagem Dinâmica em Seguro de Vida e Previdência Privada: Longevidade, Cancelamento e Opções Embutidas. 1. ed. , 2016. v. 1. 171p.

- . Opções embutidas em planos unit-linked brasileiros: avaliação sob a medida de probabilidade real. 1. ed. Madri - Espanha: Fundación Mapfre, 2015. v. 1. 62 .
 - . Solvência no Mercado de Seguros e Previdência. 1. ed. Rio de Janeiro: Escola Nacional de Seguros - Funenseg, 2012. v. 1. 391p.
 - . El Mercado de Seguros en el Sector Agropecuario de los Países del Consejo Agropecuario del Sur (CAS) 2003/2004. Montevideo, Uruguai: Instituto Interamericano de Cooperacion para la Agricultura (IICA), 2006. 32p.
 - . Graduação Bayesiana de Taxas de Mortalidade. 1. ed. Rio de Janeiro: Funenseg - Fundação Escola Nacional de Seguros, 2005. v. 500. 136p.
- Currículo completo, com coautores e todos artigos em <http://lattes.cnpq.br/3991722612313432>

César da Rocha Neves