

ESAME DI STATO PER L'ABILITAZIONE ALLA PROFESSIONE DI ATTUARIO
IUNIOR

ANNO 2018 – I SESSIONE

PROVA PRATICA

Esatto

COMPITO 1

Prodotti Finanziari

Data l'operazione finanziaria di importi $(-12.000, b, 2.000, b, 4.000, 5.000)$ con scadenze $(0,1,3,5,7,8)$ determinare il valore positivo di b che realizza per l'operazione considerata un tasso interno del 10% e con tale tasso scomporre gli importi in quota capitale e in quota interesse (capitalizzazione composta).

Prodotti Assicurativi e Previdenziali

Analisi della redditività di una prestazione differita in caso morte.

Base di dati

Il candidato partendo da una legge di sopravvivenza per contemporanei a tempo 0, $l_{h,0} = 100000 - 1000h$ per $h = 0,1,\dots,100$ produca una tavola proiettata $l_{h,k}$ per $k = 1,2,3,4,5$ in cui si ipotizza una riduzione dei tassi annui di mortalità di quelli dei contemporanei pari a $0.001(h+k)$ con riferimento a chi ha età h all'inizio dell'anno k .