

**ESAME DI STATO PER L'ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**

**ANNO 2016 – II SESSIONE secondo giorno**

**COMPITO 1**

**Tecnica attuariale delle assicurazioni di persone:**

L'utile atteso e timing dell'emergere dell'utile.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni:**

Personalizzazione dei premi nei rami danni.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni per collettività:**

Le riserve matematiche nel regime di premi medi.

**Statistica attuariale:**

I modelli lineari generalizzati.

**Finanza matematica:**

Il modello binomiale per la valutazione delle opzioni



**ESAME DI STATO PER L'ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**

**ANNO 2016 – II SESSIONE secondo giorno**

**COMPITO 2**

**Tecnica attuariale delle assicurazioni di persone:**

Rischio di longevità nei prodotti di rendite vitalizie.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni:**

La riassicurazione non proporzionale di un singolo rischio o di un portafoglio.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni per collettività:**

Premi medi: equilibri attuariali per generazione e per anno di gestione

**Statistica attuariale:**

La distribuzione di probabilità per l'ammontare del singolo danno basata su dati empirici.

**Finanza matematica:**

Prezzi a pronti, forward e prezzi futures.

  
  






**ESAME DI STATO PER L'ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**

**ANNO 2016 – II SESSIONE secondo giorno**

**COMPITO 3**

**Tecnica attuariale delle assicurazioni di persone:**

Le riserve matematiche per assicurazioni su gruppi di persone.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni:**

I rischi catastrofali.

**Tecnica attuariale delle assicurazioni per collettività:**

I sistemi tecnico-finanziari di gestione utilizzati per i regimi previdenziali.

**Statistica attuariale:**

La perequazione con funzioni spline.

**Finanza matematica:**

Gli swaps su tasso di interesse.

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*