

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.

