

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO (Laurea Specialistica)

I sessione 2009

I prova scritta (traccia estratta)

1-Dipendenza stocastica e correlazione.

2- Definire la duration di Macaulen e precisarne i criteri di applicazione al caso di un C.C.T.

3- Definire le principali tecniche di campionamento stratificato.

4-I principi di calcolo del premio puro.

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO (Laurea Specialistica)

I sessione 2009

II prova scritta (traccia estratta)

1- Caratteristiche delle polizze unit linked.

2- Il candidato esponga le ipotesi alla base di un metodo di calcolo della riserva sinistri RCA.

3- I principi del sistema di gestione a ripartizione pura.

4- I principi della credibilità bayesiana.

5- Definizione e limiti del value at risk.

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO (Laurea Specialistica)

I sessione 2009

Prova pratica – sviluppare una delle tre tracce proposte

1. Si determini formalmente *l'embedded value* di un portafoglio di polizze del ramo I.
2. Il candidato sviluppo formalmente il calcolo del contributo di equilibrio di un fondo pensioni gestito a ripartizione pura.
3. Il candidato esponga gli elementi applicativi necessari alla verifica delle basi tecniche utilizzate dall'impresa per la costruzione della tariffa RCA