

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – prima prova scritta

Tema numero 1 - estratto

1. Il teorema del limite centrale
2. La stima della varianza
3. Il modello binomiale per la determinazione del prezzo di una opzione
4. La determinazione del premio nelle assicurazioni danni

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – prima prova scritta

Tema numero 3 - non estratto

1. Il teorema di bayes
2. Determinazione dell'ampiezza di un campione
3. Il concetto di Value at Risk
4. Costruzione delle tavole di mortalità

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – prima prova scritta

Tema numero 2–non estratto

1. La distribuzione di Poisson
2. Cluster analysis
3. Dai tassi swap ai tassi a pronti
4. La determinazione del premio nelle assicurazioni vita

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – seconda prova scritta

Tema numero 1

1. Rischio demografico e la riassicurazione per rendite vitalizie
2. Metodi di controllo della riserva sinistri: il chain-ladder
3. Capitalizzazione individuale e collettiva nelle assicurazioni per collettività
4. Indici sintetici di sinistrosità nelle assicurazioni contro i danni
5. Il Value at Risk

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – Prova pratica – **ESTRATTO**

- 1) Il candidato illustri le modalità di progettazione e costruzione di una procedura per il calcolo dell'embedded value di una compagnia di assicurazione vita
- 2) Il candidato illustri le modalità di costruzione di una tariffa assicurativa RC auto.
- 3) Il candidato illustri le metodologie per l'aggiornamento delle basi tecniche necessarie alla redazione del bilancio tecnico di un fondo pensione



ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 – Prova pratica

- 1) Il candidato illustri la metodologia per la determinazione del margine di solvibilità di una impresa di assicurazione sulla vita, eventualmente in prospettiva della direttiva "solvency 2".
- 2) Il candidato illustri le metodologie di determinazione delle basi tecniche, comprese le ipotesi sui riscatti e sospensione di pagamento del premio. utili ai fini del calcolo delle riserve del secondo ordine..
- 3) Il candidato illustri i dati occorrenti per determinare la previsione pluriennale di un fondo pensione a ripartizione che eroghi solo le prestazioni di vecchiaia.

A handwritten signature in black ink, appearing to read "Pillet, Corbelli".

ESAME DI STATO PROFESSIONE ATTUARIO

Nuovo ordinamento

I sessione 2010 PROVA PRATICA

- 1) Il candidato illustri le modalità di progettazione e costruzione di una procedura di profit testing per una tariffa di assicurazione sulla vita collegata ad una gestione separata.
- 2) Il candidato illustri le modalità di sviluppo di un piano riassicurativo nell'ambito di una compagnia abilitata all'esercizio di tutti i rami danni ministeriali.
- 3) Il candidato illustri le modalità di elaborazione di un bilancio tecnico per un fondo pensione a prestazioni definite, eventualmente anche con metodologia IAS 19.

A handwritten signature in black ink, appearing to read "Piero Corbelli", is written over a horizontal dashed line.