

Università degli Studi di Trieste

**ESAMI DI STATO DI ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO  
DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**  
per laureati con laurea specialistica (nuovo ordinamento)

I SESSIONE 2011

I prova scritta (15 giugno 2011)

*Il candidato risponda alle seguenti domande:*

**A1.1 Calcolo delle probabilità**

Si illustrino le principali proprietà della funzione generatrice dei momenti di una variabile aleatoria.

**A1.2 Statistica**

Si presenti il concetto di statistica sufficiente.

**A1.3 Matematica finanziaria**

Si presentino le proprietà della legge esponenziale.

**A1.4 Matematica attuariale**

Si presentino alcuni criterio di calcolo del premio puro in assicurazione contro i danni e se ne discutano le relative proprietà.

(AII. 2)

Università degli Studi di Trieste

**ESAMI DI STATO DI ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO  
DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**  
per laureati con laurea specialistica (nuovo ordinamento)

I SESSIONE 2011

Il prova scritta (16 giugno 2011)

*Il candidato risponda alle seguenti domande*

**A2.1 Tecnica attuariale delle assicurazioni di persone**

Si definisca l'intensità di mortalità e se ne descrivano i principali modelli.

**A2.2 Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni**

Si illustrino i principali metodi di valutazione della riserva sinistri.

**A2.3 Tecnica attuariale delle assicurazioni per collettività**

Si presentino le espressioni delle probabilità relative di eliminazione in una collettività.

**A2.4 Statistica attuariale**

Si illustrino le problematiche relative alla credibilità lineare riferendosi in particolare al modello di Bühlmann-Straub.

**A2.5 Finanza matematica**

Si illustrino le tecniche di immunizzazione di portafoglio in presenza di entrate e uscite multiple in ambito semi-deterministico.

Università degli Studi di Trieste

**ESAMI DI STATO DI ABILITAZIONE ALL'ESERCIZIO  
DELLA PROFESSIONE DI ATTUARIO**  
per laureati con laurea specialistica (nuovo ordinamento)

I SESSIONE 2011

Prova pratica (5 luglio 2011)

*Il candidato svolga uno a scelta fra i tre temi seguenti*

**Tema 1 (A2.1 - Tecnica attuariale delle assicurazioni di persone)**

Si illustri la costruzione di un profit testing di una polizza mista rivalutabile.

**Tema 2 (A2.2 – Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni)**

Nel Capitale di Rischio di Sottoscrizione Non-Vita, l'effetto di diversificazione gioca un ruolo fondamentale. Si richiede di spiegare il concetto di base dell'effetto di diversificazione (tra Linee di business, tra compagnie, tra rischi) e di indicare i principali metodi e gli effetti sul Capitale di Rischio.

**Tema 2 (A3.1 - Bilancio delle imprese di assicurazione)**

Si illustrino le voci del conto profitti e perdite di una compagnia di assicurazione vita.