

Codice	27003127
Denominazione Attività Formativa	Tecnica Attuariale delle Assicurazioni sulla Vita
Codice Settore	SECS-S/06
Ambito	Affini e integrative
Tipo Insegnamento	OB – Affini
CFU	10
Anno Corso	I
Periodo Didattico	1°-2° (29/09/2014 – 20/12/2014)
DOCENTE	MENZIETTI Massimiliano
Codice Ruolo / Matricola	PA / 010758
Tipo Attività	LEZ
Ore	60
Tirocinio	NO
Lingua di insegnamento	Italiano
Contenuti	<ol style="list-style-type: none"> 1. Mortalità aggravata e mortalità selezionata. 2. Modelli di proiezione della mortalità: modelli della famiglia Lee-Carter e modelli della famiglia Cairns-Blake-Dowd , effetto coorte. 3. Rischi biometrici: rischio di longevità e disabilità, individuazione, misura e gestione 4. Assicurazioni vita a prestazioni variabili: with profit, unit-linked, equity linked 5. Modelli attuariali di valutazione di un portafoglio di assicurazioni vita 6. Riassicurazione ed altri strumenti di trasferimento del rischio nelle assicurazioni sulla vita 7. Modelli di teoria del rischio per le assicurazioni sulla vita e requisiti di solvibilità 8. Il progetto Solvency II per le assicurazioni sulla vita 9. Assicurazioni sulla salute: polizze tradizionali, permanent health insurance, dread disease, long term care.
Testi di riferimento	<p>- Dispense distribuite in aula</p> <p>Olivieri A., Pitacco E., La valutazione nelle assicurazioni vita, Egea, 2005.</p> <p>Pitacco E., Matematica e Tecnica Attuariale delle assicurazioni sulla durata di vita, Edizioni LINT, 2002.</p> <p>Pitacco E., Denuit M., Haberman S., Olivieri A., Modelling longevity dynamics for pensions and annuity business, Oxford University Press, 2009.</p> <p>Pitacco E., Modelli attuariali per le assicurazioni sulla salute, Egea, 1995.</p>
Obiettivi formativi	Il corso si propone di fornire allo studente padronanza metodologica e pratica in relazione agli strumenti atti a definire i principi e le tecniche attuariali nelle assicurazioni sulla vita, con particolare riferimento ai prodotti vita innovativi, all'analisi del rischio demografico in un portafoglio assicurativo nell'ottica della riassicurazione e della solvibilità di impresa e alle valutazioni di portafogli vita.
Prerequisiti	nessuno

[0752] Corso di Laurea Magistrale in Statistica e Informatica per l'Azienda e la Finanza
– curriculum SFA (Statistica, Finanza ed Assicurazioni) -
SCHEDA INSEGNAMENTO a.a.2014-2015

Metodi didattici	Lezioni frontali ed esercitazioni in aula ed in laboratorio informatico
Altre informazioni	Pagina Docente: http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/menzietti/
Modalità di verifica dell'apprendimento	esame orale