

**Tecnica Attuariale delle Assicurazioni sulla vita**  
**Corso di Laurea in Statistica e Informatica per l'Azienda e la Finanza**  
**a.a. 2013-2014**

<b>Codice</b>	27003127
<b>Descrizione</b>	Tecnica Attuariale delle Assicurazioni sulla Vita
<b>Codice Settore</b>	SECS-S/06
<b>Ambito</b>	Attività formative Affini e integrative
<b>Tipo Insegnamento</b>	SC – Affini e integrative
<b>CFU</b>	10
<b>Anno Corso</b>	1°
<b>Periodo Didattico</b>	1° semestre (1°-2° periodo didattico) – 30/09/2013 – 21/12/2013
<b>DOCENTE</b>	<b>Prof. MENZIETTI Massimiliano</b>
<b>Codice Ruolo / Matricola</b>	PA / 010758
<b>Tipo Attività</b>	LEZ
<b>Ore</b>	60
<b>Tirocinio</b>	NO
<b>Lingua di insegnamento</b>	Italiano
<b>Contenuti</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Mortalità aggravata e mortalità selezionata.</li> <li>2. Modelli di proiezione della mortalità: modelli della famiglia Lee-Carter e modelli della famiglia Cairns-Blake-Dowd , effetto coorte.</li> <li>3. Rischi biometrici: rischio di longevità e disabilità, individuazione, misura e gestione</li> <li>4. Assicurazioni vita a prestazioni variabili: with profit, unit-linked, equity linked</li> <li>5. Modelli attuariali di valutazione di un portafoglio di assicurazioni vita</li> <li>6. Riassicurazione ed altri strumenti di trasferimento del rischio nelle assicurazioni sulla vita</li> <li>7. Modelli di teoria del rischio per le assicurazioni sulla vita e requisiti di solvibilità</li> <li>8. Il progetto Solvency II per le assicurazioni sulla vita</li> <li>9. Assicurazioni sulla salute: polizze tradizionali, permanent health insurance, dread disease, long term care.</li> </ol>
<b>Testi di riferimento</b>	<p>- Dispense distribuite in aula</p> <p>Olivieri A., Pitacco E., <b>La valutazione nelle assicurazioni vita</b>, Egea, 2005.</p> <p>Pitacco E., <b>Matematica e Tecnica Attuariale delle assicurazioni sulla durata di vita</b>, Edizioni LINT, 2002.</p> <p>Pitacco E., Denuit M., Haberman S., Olivieri A., <b>Modelling longevity dynamics for pensions and annuity business</b>, Oxford University Press, 2009.</p> <p>Pitacco E., <b>Modelli attuariali per le assicurazioni sulla salute</b>, Egea, 1995.</p>
<b>Obiettivi formativi</b>	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.
<b>Prerequisiti</b>	nessuno
<b>Metodi didattici</b>	Lezioni frontali ed esercitazioni in aula ed in laboratorio informatico
<b>Altre informazioni</b>	Pagina Docente: <a href="http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/menzietti/">http://www.unical.it/portale/strutture/dipartimenti_240/disesf/servizi/menzietti/</a>
<b>Modalità di verifica dell'apprendimento</b>	esame orale
<b>Programma esteso</b>	