

Progetto per l'esame di Laboratorio finanziario e attuariale

Il progetto deve essere organizzata in due parti: un testo, completo di riferimenti bibliografici, in cui si presentano il problema e le metodologie usate per le valutazioni; un progetto in VBA per le elaborazioni.

Il testo che descrive il progetto può essere anche sintetico, in forma di presentazione.

Si raccomanda di comunicare in anticipo, prima di presentarsi all'esame, quale argomento si intende sviluppare.

Si riportano di seguito possibili temi, con indicazione di alcuni riferimenti bibliografici.

Matematica finanziaria

- 1) Durata media finanziaria e indici temporali
Vedi, per esempio, [1] Cap. 24; [3] Cap. 10.
- 2) Misurazione della struttura per scadenza dei tassi di interesse
Vedi, per esempio, [1] Cap. 26; [3] Cap. 11.
- 3) Valutazione di titoli a tasso variabile
Vedi, per esempio, [3] Cap. 12.
- 4) Scelte finanziarie
Vedi, per esempio, [2] Parte II.
- 5) L'operazione di leasing
Vedi, per esempio, [1] Cap. 5; [2] Cap. 16.
- 6) L'immunizzazione
Vedi, per esempio, [1] Cap. 25; [3] Cap. 10.

Matematica attuariale delle assicurazioni sulla vita

- 1) Riserve matematiche. Rischio e Risparmio
Vedi, per esempio, [5] Cap. 5
- 2) Riserve matematiche. Basi tecniche e formazione dell'utile
Vedi, per esempio, [5] Cap. 6
- 3) Assicurazioni rivalutabili
Vedi, per esempio, [5] Cap. 7

Matematica attuariale delle assicurazioni danni

- 1) Modelli tariffari
Vedi, per esempio, [4].

RIFERIMENTI BIBLIOGRAFICI

- [1] Benninga S., Modelli finanziari – la finanza con Excel, McGraw-Hill, 2010
- [2] Castagnoli E., Peccati L., Matematica in azienda 1 – Calcolo finanziario con applicazioni, Egea, 2010
- [3] Castellani G., De Felice M., Moriconi F., Manuale di finanza – I. Tassi di interesse. Mutui e obbligazioni, Il Mulino, 2005
- [4] L. Picech, Modelli tariffari e stime dei parametri, Quaderni del Dipartimento di Matematica applicata alle Scienze economiche, statistiche e attuariali "Bruno de Finetti", n.5/1994
- [5] Pitacco E., Matematica e tecnica attuariale delle assicurazioni sulla durata di vita, LINT Editoriale, 2002