

Universiteit van Amsterdam, afdeling Kwantitatieve economie, sectie Actuarieel,
H. Wolthuis, W.J. Willemse

Dit tentamen bestaat uit acht vragen en één essayvraag. Het aantal punten per opgave is tussen haakjes gegeven na elke deelvraag (op een totaal van 100 punten). De totale behaalde score wordt gedeeld door 10 en afgerond op 0,5 punt om tot een cijfer te komen.

VEEL SUCCES!

1. Het Actuarieel Genootschap gaat bij het afronden van sterftequotiënten voor de hoge leeftijden uit van de formule van Gompertz. Geef commentaar hierop uitgaande van het artikel van Gavrilov en Gavrilova (2002). (10)
2. In het artikel van Pitacco worden twee soorten van heterogeniteit beschreven. Geef de actuariële betekenis van beide soorten. (10)
3. Wat was het essentieel nieuwe van de Equitable Society opgericht in 1762? (10)
4. Noem drie belangrijke *internationale* organisaties op het gebied van actuariaat/verzekeren en geef hun betekenis aan. (10)
5. Geef de voor- en nadelen van de huidige internationale actuariële notatie. (10)
6. Wat wordt bedoeld met het falsificatiecriterium van Popper? Waarom was dat volgens Popper beter dan het verificatiecriterium van de leden van de Wiener Kreis? (10)
7. In het hoofdstuk 'Being professional' wordt een aantal taken van beroepsorganisaties beschreven. Noem drie belangrijke taken van een beroepsorganisatie en geef steeds een voorbeeld. (10)
8. Huber en Verrall noemen in hun artikel een aantal belangrijke nadelen van financieel economische modellen. Welke zijn dat? Hoe zouden actuarissen volgens hen met deze nadelen moeten omgaan? (10)

Essay vraag

Er wordt tegenwoordig in de bankenwereld veel gesproken over operationele risico's. Dat zijn risico's die samenhangen met bedrijfsprocessen, mensen en organisaties zoals fraude en falende IT-systemen en bedrijfsprocessen. Beschrijf op maximaal één A4 of een actuaaris volgens u in zijn oordeelsvorming mede in overweging moeten nemen de risico's die een verzekeraar of pensioenfonds loopt op dit gebied. Beargumenteer uw mening aan de hand van het huidige Reglement van Orde voor Actuarissen. (20)