



## SVILUPPO INIZIATIVE FORMAZIONE ATTUARIALE

Via del Corea, 3 - 00186 Roma - Tel.: 063202922 Fax: 063203772  
Web: [www.sifa-attuari.it](http://www.sifa-attuari.it) - e-mail: [info@sifa-attuari.it](mailto:info@sifa-attuari.it)

Roma, 9 aprile 2009

Prot. n. 006/09

Siamo lieti di informarvi che sono aperte le iscrizioni al 3° corso 2009 di formazione permanente, dal titolo: **“Solvency II e modelli quantitativi per la stima del non-life underwriting risk”**.

Il corso che si terrà a **Milano** nel giorno **6 - 7 maggio 2009**, è destinato alle figure professionali, all'interno ed all'esterno delle compagnie di assicurazione, che utilizzano o intendono specializzarsi nello sviluppo di modelli quantitativi di risk management e di capital allocation relativamente alle assicurazioni danni.

Il corso ha per obiettivo di illustrare sia il quadro generale che le metodologie quantitative riguardanti la valutazione dell'Underwriting Risk nelle Assicurazioni Danni secondo uno sviluppo coerente con il noto progetto Solvency II.

Nel Corso, in particolare, sarà approfondito sia il rilievo delle principali componenti (Premium Risk e Reserve Risk) nell'ambito della c.d. Standard Formula per il calcolo del Solvency Capital Requirement proposta negli ultimi Quantitative Impact Studies promossi dal CEIOPS (QIS3 e QIS4) sia lo studio di modelli quantitativi per il Premium ed il Reserve Risk per lo sviluppo di Internal Model.

La docenza del corso è affidata al dott. Gian Paolo Clemente (Università Cattolica del Sacro Cuore), al dott. Angelo Doni (ANIA), alla dott.ssa Giorgia Esposito (ANIA) e al prof. Nino Savelli (Università Cattolica del Sacro Cuore).

Si allegano il programma e la scheda di iscrizione; quest'ultima dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.F.A. entro **lunedì 4 maggio 2009**.

Con l'auspicio che anche questo corso possa dare luogo ad una intensa partecipazione, si inviano cordiali saluti.

Il Presidente  
(Paolo De Angelis)

L'Amministratore Delegato  
(Bruno Delle Donne)

**Oggetto: Informativa ex art.10 legge n. 675 del 31 dicembre 1996.**

Le forniamo le seguenti informazioni relativamente al trattamento dei Suoi dati personali, ai sensi dell'art. 10 della Legge n. 675/1996:

1. il trattamento ha per finalità la promozione delle nostre attività;
2. il trattamento sarà effettuato con strumenti automatizzati e manuali;
3. il conferimento dei dati è facoltativo e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di continuare le attività suddette;
4. i dati non verranno né comunicati né diffusi;
5. il titolare del trattamento è S.I.F.A. S.r.l. con sede in Roma in Via del Corea n. 3.

Al titolare del trattamento Lei potrà rivolgersi per far valere i Suoi diritti così come previsti dall'articolo 13 della Legge n. 675/1996



### **3° CORSO 2009 DI FORMAZIONE PERMANENTE**

sul tema

## **“Solvency II e modelli quantitativi per la stima del non-life underwriting risk”**

**Milano, 6-7 maggio 2009**

#### ***Docenti:***

Dott. Gian Paolo Clemente (Università Cattolica del Sacro Cuore)  
Dott. Angelo Doni (ANIA)  
Dott.ssa Giorgia Esposito (ANIA)  
Prof. Nino Savelli (Università Cattolica del Sacro Cuore)

#### ***Programma del corso***

**Mercoledì 6 maggio 2009**

#### ***Modelli di Teoria del Rischio per Premium e Reserve Risk***

(prof. Savelli e dott. Clemente)

1. Le componenti del costo aggregato per un singolo ramo
2. Le distribuzioni del numero e del costo dei sinistri
3. I momenti esatti del costo aggregato
4. La distribuzione di probabilità di Loss Ratio e Combined Ratio
5. La probabilità di rovina ed il Capital-at-Risk (CaR)
6. L'approccio proposto dalla International Actuarial Association per la stima di Premium e Reserve Risk

#### ***Solvency II e Non-Life Underwriting Risk***

(dott. Doni e dott.ssa Esposito)

1. Una visione sintetica sullo sviluppo del Progetto Solvency II
2. La Standard Formula per il Solvency Capital Requirement
3. Il Non-Life Underwriting Risk nei recenti Quantitative Impact Studies
4. I risultati del QIS4, con un focus sul Non-Life Underwriting Risk
5. Best Estimate e Risk Margin delle riserve tecniche dei rami danni
6. Full/Partial Internal Model.

**Giovedì 7 maggio 2009**

#### ***Internal Model per la stima del Premium Risk***

(prof. Savelli e dott. Clemente)

1. Un Internal Model per il premium risk: le ipotesi e la stima dei parametri
2. I risultati di un modello simulativo per una compagnia multiline
3. Aggregazione e dipendenza tra i rami
4. Internal Model e Standard Formula: un confronto tra i risultati

#### ***Internal Model per la stima del Reserve Risk***

(prof. Savelli e dott. Clemente)

1. Il SCR per il reserve risk
2. Il Modello di Mack ed il prediction error
3. I modelli di simulazione mediante la tecnica del Bootstrapping
4. I risultati secondo differenti rami e dimensioni
5. Cenni sull'aggregazione tra i rami.



**Sede del corso:**

Jolly Hotel Machiavelli  
Via Lazzaretto, 5 – 20124 Milano

**Segreteria operativa:**

S.I.F.A. S.r.l. - Via del Corea 3 - 00186 Roma  
**Tel. 06.3202922, fax 06.3203772, E-mail: [info@sifa-attuari.it](mailto:info@sifa-attuari.it)**  
Sig.ra Federica Campanini, Sig.ra Mara Pastore

**Orario:**

Mercoledì 6 maggio 2009

Giovedì 7 maggio 2009

08.45 – 09.15	Registrazione e benvenuto		
09.15 – 11.00	Lezione	09.15 – 11.00	Lezione
11.00 – 11.15	Pausa caffè	11.00 – 11.15	Pausa caffè
11.15 – 13.00	Lezione	11.15 – 13.00	Lezione
13.00 – 14.00	Colazione di lavoro*	13.00 – 14.00	Colazione di lavoro*
14.00 – 15.30	Lezione	14.00 – 15.30	Lezione
15.30 – 15.45	Pausa caffè	15.30 – 15.45	Pausa caffè
15.45 – 17.30	Lezione	15.45 – 17.30	Lezione

\* Presso il Jolly Hotel Machiavelli

**Numero dei partecipanti:**

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 50 unità, ammesse secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda, con un minimo di 20 adesioni.

**Iscrizioni:**

La scheda allegata va inviata alla segreteria della S.I.F.A. S.r.l., Via del Corea 3, 00186 Roma, anche tramite fax, **entro lunedì 4 maggio 2009**. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostro fax.

**Quota di iscrizione:**

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 1.250,00 + IVA**. Società ed Enti che intendessero iscriverne più di una persona usufruiranno di uno sconto del 25% sulle quote di iscrizione relative ai partecipanti aggiunti al primo. La quota dà diritto alla partecipazione ai lavori, al materiale didattico, alle colazioni di lavoro ed a due pause caffè giornaliere.

Per quanto riguarda i Soci Enti dell'Istituto Italiano degli Attuari, al primo iscritto verrà riconosciuto uno sconto del 10% mentre dal secondo iscritto in poi verrà riconosciuto uno sconto del 30%, quest'ultimo comprensivo di quello previsto nel punto precedente.

Per quanto riguarda i Dottorandi (con dichiarazione del dipartimento di appartenenza), i Borsisti (con dichiarazione dell'Ente erogatore), i Laureandi (con attestato di iscrizione all'ultimo anno del corso di laurea) ed i Neo Laureati (fino ad un anno dal conseguimento della laurea ed a condizione che non svolgano attività professionale o di lavoro subordinato comprovata mediante apposita autodichiarazione), la quota di iscrizione, per un massimo di sei partecipanti ad ogni corso, è di **Euro 350,00 + IVA**. Al fine del rispetto di tale limite si terrà conto dell'ordine cronologico di ricevimento della scheda di iscrizione.

**Modalità di pagamento:**

**Il versamento della quota di iscrizione, da effettuarsi successivamente alla nostra conferma, dovrà pervenire entro e non oltre l'inizio del corso, con l'evidenza del corrispondente numero di fattura.**

Eventuali rimborsi per impedita partecipazione saranno consentiti nella misura dell'80% se la mancata partecipazione sarà comunicata per iscritto almeno 5 giorni prima dell'inizio del corso.



### 3° CORSO 2009 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

## “Solvency II e modelli quantitativi per la stima del non-life underwriting risk”

Milano, 6-7 maggio 2009

IL SOTTOSCRITTO (Dott., Prof., Sig.) .....

ATTUARIO:  - OPERATORE FINANZIARIO:  - INTERMEDIARIO:  - ALTRO:

INDIRIZZO.....

CAP ..... CITTA' ..... PROV.....

TELEFONO ..... FAX ..... E-MAIL .....

SOCIETA' O ENTE DI APPARTENENZA.....

Intende partecipare al 3° Corso 2009 di Formazione Attuariale Permanente.

Al tal fine effettua il pagamento della quota di iscrizione mediante versamento sul **c/c n. 21725** c/o BNL, succursale di Via del Corso n. 473, Agenzia n. 6340, **IBAN: IT88 F 01005 03240 000 000 021725** intestato alla S.I.F.A. S.r.l. **(Vi preghiamo di prestare attenzione al numero IBAN, prendendone buona nota).**

La fattura va intestata a: .....

Partita IVA n. .... Cod. Fisc. ....

(si prega di indicare sia partita IVA che codice fiscale anche se coincidenti)

La fattura va inviata a: .....

Data

FIRMA

.....

.....

#### INFORMATIVA EX LEGGE N. 675/1996 – TUTELA DELLA PRIVACY

S.I.F.A. S.r.l., il titolare del trattamento, con sede in Roma in Via del Corea n. 3, La informa che:

1. il trattamento, effettuato con strumenti automatizzati e manuali, ha per finalità l'iscrizione e la partecipazione ai corsi realizzati da S.I.F.A. S.r.l.;
2. il conferimento dei dati, di cui non è prevista la diffusione, ma solo la comunicazione ai professionisti e alle aziende che per nostro conto svolgono le attività di gestione amministrativa, contabile e fiscale, è obbligatorio e in sua mancanza non potremo procedere ad iscriverLa al corso.

Lei potrà rivolgersi al titolare del trattamento per far valere i Suoi diritti così come previsto dall'articolo 13 della Legge n. 675/1996; in particolare potrà chiedere conferma dell'esistenza dei dati che possono riguardarLa, ottenerne la cancellazione per motivi legittimi, l'aggiornamento e la rettifica.

#### FORMULA DI CONSENSO AL TRATTAMENTO DEI DATI

Acquisite le informazioni di cui all'articolo 10 della Legge n. 675/1996, ai sensi dell'articolo 11 della legge stessa conferisco il consenso - in particolare - ai seguenti trattamenti dei propri dati personali:

- comunicazione e diffusione dei dati personali ai clienti e ai potenziali clienti di S.I.F.A. S.r.l. per finalità promozionali;

do il consenso       nego il consenso      Firma\_\_\_\_\_

- trattamento dei dati personali per ricevere comunicazioni relative alle attività e alle promozioni di S.I.F.A. S.r.l.

do il consenso       nego il consenso      Firma\_\_\_\_\_