



SVILUPPO INIZIATIVE FORMAZIONE ATTUARIALE

Via del Corea, 3 - 00186 Roma - Tel.: 063202922 Fax: 063203772
Web: www.sifa-attuari.it - e-mail: info@sifa-attuari.it

Roma, 14 novembre 2013

Prot. n. 023/13

Cari Colleghi,

abbiamo piacere di informarVi che il **3° corso FAC dell'anno 2013, organizzato dalla SIFA** in base alla Convenzione sottoscritta con l'Ordine Nazionale degli Attuari e rivolto agli Attuari iscritti all'Albo, **la cui partecipazione è gratuita**, si tiene a **Milano, giovedì 28 novembre pv, dalle ore 10,15 alle ore 16,15** presso **Hotel Michelangelo, Via Scarlatti, 33 – 20122 Milano.**

Il corso ha come titolo:

“La valutazione della Riserva Sinistri con i GLM”

Le relazioni sono tenute dalla prof. Liviana Picech – Università degli Studi di Trieste

Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come da Regolamento della FAC, si acquisiscono 2 (due) CFP (Crediti Formativi Professionali).

La richiesta di partecipazione è individuale e deve essere inviata personalmente dal partecipante alla SIFA per e-mail (info@sifa-attuari.it) **specificando nell'oggetto "richiesta di partecipazione 3° corso FAC-SIFA 2013".**

La Segreteria della SIFA provvederà ad inviare la conferma di partecipazione entro lunedì 25 novembre 2013, in base all'ordine cronologico di arrivo delle richieste fino ad esaurimento dei circa 80 posti disponibili.

OBBIETTIVO:

Il corso fornisce un'impostazione di tipo metodologico sulla valutazione della riserva sinistri mediante modelli stocastici, ponendo in particolare l'accento sugli aspetti della previsione e della valutazione dell'errore di previsione. Sono trattati in dettaglio particolari modelli che possono essere implementati nell'ambito dei GLM. Si trattano inoltre i modelli “Credible claims reserves” che, in particolari ipotesi, possono essere stimati mediante tecniche proprie dei GLM.



PROGRAMMA:

1. I modelli stocastici per la valutazione delle riserve sinistri:
 - a) Previsione della riserva sinistri e valutazione dell'errore di previsione.
 - b) I modelli Chain-Ladder e Bornhuetter-Ferguson.
 - c) L'algoritmo Chain-Ladder e l'ipotesi di distribuzione di Poisson.

2. I modelli GLM per la valutazione della riserva sinistri:
 - a) Richiami sui modelli lineari generalizzati.
 - b) Stima; analisi inferenziali; controllo del modello; verifica di ipotesi e confronto tra modelli; strutture di regressione e procedimenti di selezione delle variabili esplicative.
 - c) Modelli GLM per la valutazione delle riserve sinistri: modelli Poisson-logaritmo e gamma-logaritmo.
 - d) Modelli con quasi-verosimiglianza: il modello di Poisson-logaritmo con sovradisersione.
 - e) Modelli GLM con funzione di varianza di tipo potenza.
 - f) Previsioni ed errori di previsione.
 - g) Il rischio di modello; scelta del modello in una classe di modelli.

3. I modelli "Credible claims reserves":
 - a) Il modello Bornhuetter-Ferguson e i GLM.
 - b) Il modello con effetti aleatori Overdispersed Poisson-gamma.
 - c) Previsione e valutazione dell'errore di previsione per Credible claims reserves.

* * *

Questo corso rientra tra le iniziative prese dall'Ordine Nazionale degli Attuari, per consentire agli iscritti di contenere le spese di formazione dando nel contempo l'opportunità di rispondere alle esigenze di aggiornamento professionale.

Nell'auspicare la massima partecipazione, porgiamo i nostri più cordiali saluti.

Il Presidente
(Stefano Borsetti)

L'Amministratore Delegato
(Mario Liberatori)