



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, 24 febbraio 2012

Prot. n. 005/12

Siamo lieti di informarvi che sono aperte le iscrizioni al 2° corso 2012 di formazione permanente, dal titolo: **“Solvency II non-life underwriting risk: formula standard, modelli interni e tecniche di Re-Reserving e Backtesting”**.

Il corso che si terrà a **Milano**, presso l'Hotel Bristol, nei giorni **26 e 27 marzo 2012**, si rivolge

- agli attuari che debbono approfondire le problematiche delle forme di copertura danni, sia per danni alla persona sia per danni a cose;
- agli attuari che lavorano nel settore delle assicurazioni private e, in particolare, presso la direzione tecnica danni.

Il corso ha per obiettivo l'analisi delle più recenti evoluzioni della normativa Solvency II, anche alla luce dell'ultimo studio promosso dal CEIOPS (QIS5), e l'impatto delle metodologie quantitative nella valutazione dell'underwriting risk nelle assicurazioni danni. In particolare, verrà approfondito il tema dei modelli interni che, se adeguatamente testati e validati, possono rappresentare una possibile alternativa di calcolo dei requisiti di capitale rispetto alla formula standard.

La docenza del corso è affidata al Dott. Salvatore Forte (Università degli Studi di Roma “La Sapienza”), al Prof. Fabio Grasso (Università degli Studi di Roma “La Sapienza”), Dott. Matteo Ialenti (Università degli Studi di Roma “La Sapienza”), Dott. Marco Pirra (Università della Calabria).

La partecipazione al corso da diritto all'acquisizione di 3 CFP.

Si allegano il programma e la scheda di iscrizione; quest'ultima dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.F.A. entro **mercoledì 21 marzo 2012**.

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

L'Amministratore Delegato
(Mario Liberatori)



2° CORSO 2012 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

“Solvency II non-life underwriting risk: formula standard, modelli interni e tecniche di Re-Reserving e Backtesting”

Roma, 26 e 27 marzo 2012

Docenti:

Dott. Salvatore Forte	(Università degli Studi di Roma “La Sapienza”)
Prof. Fabio Grasso	(Università degli Studi di Roma “La Sapienza”)
Dott. Matteo Ialenti	(Università degli Studi di Roma “La Sapienza”)
Dott. Marco Pirra	(Università della Calabria)

Programma del corso

Solvency II

- 1 1. Stato dell'arte del Progetto Solvency II
- 2 2. Best Estimate e Risk Margin delle riserve tecniche dei rami danni
- 3 3. La Standard Formula per il Solvency Capital Requirement nel QIS5
- 4 4. Il Non-Life Underwriting Risk con la standard formula
- 5 5. Internal Risk Models per la definizione dei requisiti di capitale.
- 6 6. Alcuni esempi numerici

Modelli interni per il Premium Risk

- 7 1. Modelli probabilistici per il numero di sinistri, per i danni e per i risarcimenti.
- 8 2. Focus su alcuni possibili modelli probabilistici per la valutazione del danno aggregato
- 9 3. La mitigazione e la diversificazione del rischio
- 10 4. Alcuni esempi numerici

Modelli interni per il Reserve Risk e tecniche di Re-Reserving e Backtesting

1. Livelli di confidenza e orizzonti temporali delle analisi
2. I modelli di Mack e di Mertz-Wuthrich
3. La tecnica del Re-Reserving
4. I modelli di simulazione mediante la tecnica del Bootstrapping
- 1 5. I Collective Risk Models
- 2 6. I modelli bayesiani: Chain ladder, Bornhuetter Ferguson, Fisher Lange
- 3 7. Validazione dei modelli e tecniche di Backtesting
- 4 8. Cenni sull'aggregazione dei rischi
- 5 9. Alcuni esempi numerici



Sede del corso:

Hotel Bristol
Via Scarlatti, 32
20124 Milano

Segreteria operativa:

S.I.F.A. S.r.l. - Via del Corea 3 - 00186 Roma

Federica Campanini

Tel. 06.3202922, fax 06.3203772, E-mail: info@sifa-attuari.it

Orario:

Lunedì 26 marzo 2012

13.45 – 14.00 Registrazione
14.00 – 15.30 Lezione
15.30 – 15.45 Pausa caffè
15.45 – 17.30 Lezione

Martedì 27 marzo 2012

09.00 – 11.00 Lezione
11.00 – 11.15 Pausa caffè
11.15 – 13.00 Lezione
13.00 – 14.00 Colazione di lavoro*
14.00 – 15.30 Lezione
15.30 – 15.45 Pausa caffè
15.45 – 17.30 Lezione

* Presso Hotel Bristol

Numero dei partecipanti:

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 40 unità, ammesse secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda.

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 martedì 21 marzo 2012**. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostro fax.

Quota di iscrizione:

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 1.000,00 + IVA**. Società ed Enti che intendessero iscrivere 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, alla pausa caffè del primo giorno, alla colazione di lavoro ed a due pause caffè del secondo giorno.

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 375,00 + 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.



2° CORSO 2012 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

“Solvency II non-life underwriting risk: formula standard, modelli interni e tecniche di Re-Reserving e Backtesting”

Roma, 26 e 27 marzo 2012

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 2° Corso 2012 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 Corso 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 _____