



**SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI**

Viale delle Milizie, 1 - 00192 Roma - Tel.: 06 3202922, fax 06 3210250  
E-mail: info@sifa-attuari.it

Roma, 20 ottobre 2016

**Prot. n. 014/16**

Siamo lieti di informarvi che sono aperte le iscrizioni al 2° corso 2016 di formazione permanente, dal titolo: **“Modelli di Regressione: dalle tecniche di pricing all’analisi dei rischi di sottoscrizione in Solvency II”**. Il corso si terrà a **Milano il 16 novembre 2016** presso Hotel Michelangelo Via Scarlatti, 33 - 20124 Milano.

Il corso si rivolge a dipendenti e professionisti che operano nell’ambito del settore assicurativo danni su tematiche di tariffazione, Risk Management, Actuarial Function.

La prima parte del corso presenterà un’introduzione sul processo di pricing utilizzato dalle compagnie di assicurazione danni e dagli impatti derivanti dal regime Solvency II. Successivamente sarà evidenziato come i modelli di regressione utilizzati nella tariffazione danni, con particolare riferimento a Modelli Lineari Generalizzati (GLM), Modelli Additivi Generalizzati (GAM) e Modelli Lineari Misti Generalizzati (GLMM), possano essere impiegati per la definizione di un Modello Interno Parziale relativo ai rischi di tariffazione e riservazione.

La parte conclusiva del corso verterà su un confronto dei risultati del Modello Interno Parziale con la stima degli Undertaken Specific Parameters e i parametri di volatilità della standard formula previsti per il Premium Risk.

Rispetto ai precedenti seminari del 2014 e 2015, i docenti presenteranno diversi aggiornamenti relativi ai nuovi sviluppi normativi, all’evoluzione dell’approccio metodologico, con possibili estensioni all’analisi del rischio di riservazione, e ai risultati derivanti da ulteriori applicazioni nel mercato italiano.

La docenza del corso è affidata al prof. Rocco Roberto Cerchiara (Università della Calabria) e al dott. Vittorio Magatti (Head of Modelling and Technical Price – Direct Business Italy per Zurich Insurance Company Ltd).

In particolare il programma del corso si articola come segue:

**1. Il processo di pricing, il regime di Solvency II e il rischio di sottoscrizione**

- a. Lo schema generale di tariffazione nel mercato italiano
- b. Il regime Solvency II
- c. Standard Formula, Undertaking Specific Parameters, Modelli Interni Parziali e Completi
- d. Dalla tariffazione all’analisi del Premium Risk e Reserve Risk

**2. Il Danno Aggregato a costo ultimo in un orizzonte temporale annuale: da un modello di tariffazione all’analisi del Premium Risk**

- a. Modello Lineare Generalizzato
- b. Modello Additivo Generalizzato
- c. Modello Lineare Misto Generalizzato
- d. Modello Interno Parziale per il Premium Risk



### **3. Un caso di studio per il Premium Risk**

- a. La selezione di modelli
- b. La distribuzione stimata del Danno Aggregato
- c. Il Value at Risk al 99,5mo percentile
- d. Confronto dei risultati tra Standard Formula, Undertaking Specific Parameters e Modello Interno Parziale

### **La partecipazione al corso da diritto all'acquisizione di 4 CFP.**

Si allega la scheda di iscrizione che dovrà essere inviata alla Segreteria di S.I.F.A. entro **giovedì 10 novembre 2016.**

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

Il Presidente  
(Giampaolo Crenca)

L'Amministratore Delegato  
(Stefano Borsetti)



***Sede del corso:***

Hotel Michelangelo  
Via Scarlatti, 33  
20124 Milano

***Segreteria operativa:***

S.I.A. s.r.l. - Viale delle Milizie 1 - 00192 Roma  
**Tel. 06.3202922, fax 06.3210250, E-mail: [info@sifa-attuari.it](mailto:info@sifa-attuari.it)**  
Federica Campanini

***Orario:***

**Mercoledì 16 novembre 2016**

**09.15 – 09.30** Registrazione  
09.30 – 11.00 Lezione  
11.00 – 11.15 Pausa caffè\*  
11.15 – 13.00 Lezione  
13.00 – 14.00 Intervallo  
14.00 – 15.30 Lezione  
15.30 – 15.45 Pausa caffè\*  
15.45 – 17.15 Lezione

\* Presso Hotel Michelangelo

***Numero dei partecipanti:***

Il numero massimo di partecipanti è fissato in 20 unità, ammessi secondo l'ordine cronologico di ricevimento della domanda.

***Iscrizioni:***

La scheda allegata va inviata alla segreteria della S.I.A. s.r.l., Viale delle Milizie 1, 00192 Roma, tramite fax o email, **entro giovedì 10 novembre 2016**. L'iscrizione al corso sarà confermata con nostra email.

***Quota di iscrizione:***

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **Euro 500,00 + IVA**. La quota dà diritto alla partecipazione ai lavori, al materiale didattico, alle due pause caffè.

***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 2 giorni prima dell'inizio del corso.



## 2° CORSO 2016 DI FORMAZIONE PERMANENTE

sul tema

### “Modelli di Regressione: dalle tecniche di pricing all’analisi dei rischi di sottoscrizione in Solvency II”

Milano, 16 novembre 2016

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 2016 di Formazione Attuariale Permanente. Al tal fine effettua il pagamento della quota di iscrizione mediante versamento sul c/c BNL: **IBAN: IT88F 01005 03240 00000 0021725 intestato alla S.I.A. s.r.l.**

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

.....

.....

#### 1.1 Oggetto: Informativa ai sensi dell'art. 13 Decreto Legislativo n 196 del 2003

Questa informativa viene fornita ai sensi dell'art. 13 del Decreto Legislativo 196 del 2003 (di seguito Codice privacy), dettato in materia di “protezione dei dati personali”.

Secondo la legge indicata, tale trattamento sarà improntato ai principi di correttezza, liceità e trasparenza e di tutela della Sua riservatezza e dei Suoi diritti.

Ai sensi dell'articolo 13 del Codice privacy, **Sviluppo Iniziative Attuariali S.r.l. (in seguito anche SIA)** con sede legale in Viale delle Milizie, 1, 00192 Roma, Titolare del trattamento, Le fornisce quindi le seguenti informazioni:

- il trattamento dei suoi dati personale è effettuato per:
    - la gestione e l'organizzazione dei corsi, per la sua iscrizione e per l'esecuzione delle attività amministrative, fiscali e contabili collegate;
    - l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
  - il trattamento sarà effettuato con strumenti automatizzati e manuali;
  - il conferimento dei dati di cui al punto a. è necessario e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di partecipare all'attività formativa; il conferimento dei dati di cui al punto b. è facoltativo e un eventuale rifiuto può comportare l'impossibilità di inviare comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi;
  - i dati, che non saranno diffusi, potranno essere comunicati, a soggetti terzi per l'adempimento delle finalità su menzionate, a società che si occupano di formazione e aggiornamento professionale e a soggetti cui la facoltà di accedere ai dati sia riconosciuta da disposizioni di legge e/o di normativa secondaria;
  - gli incaricati che si occupano della gestione degli iscritti potranno venire a conoscenza dei suoi dati personali esclusivamente per le finalità su menzionate;
- La informiamo, infine che potrà esercitare, i diritti contemplati dall'art. 7 del Codice privacy, tra cui quello di ottenere dal Titolare del trattamento, la conferma dell'esistenza o meno di Suoi Dati personali e di consentirLe, nel caso, la messa a disposizione scrivendo all'indirizzo e-mail [info@sifa-attuari.it](mailto:info@sifa-attuari.it). Lei potrà pertanto chiedere di avere conoscenza dell'origine dei dati nonché della logica e delle finalità del Trattamento; di ottenere la cancellazione, la trasformazione in forma anonima o il blocco dei dati trattati in violazione di legge, nonché l'aggiornamento, la rettifica o, se vi è interesse, l'integrazione dei dati stessi; di opporsi, per motivi legittimi, al trattamento.

Roma, 20 ottobre 2016

Il Titolare del trattamento  
Sviluppo Iniziative Attuariali s.r.l.

#### Consenso al trattamento dei dati personali

Il/La sottoscritto/a \_\_\_\_\_ conferma di aver letto con attenzione l'informativa su esposta e conferisce il consenso al trattamento dei suoi dati personali per l'invio, anche per e-mail, di comunicazioni/informazioni relative all'organizzazione dei corsi.

Data \_\_\_\_\_

Firma \_\_\_\_\_