S.I.F.A. s.r.l.
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, 27 aprile 2015

Prot. n. 016/15

Cari Colleghi, abbiamo il piacere di informarVi che il **3° corso FAC dell'anno 2015, 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 Roma **giovedì 14 maggio** pv, dalle ore 09,30 alle ore 16,30 presso **NH Hotel Leonardo da Vinci Via dei Gracchi 324 - 00192 Roma** (vicino Metro A, fermata Lepanto).

Il corso ha come titolo:

"Sulla stima degli Undertaking Specific Parameters (USP) e la verifica delle ipotesi"

La docenza del corso è affidata al prof. **Franco Moriconi** (Professore Ordinario nell'Università di Perugia).

Il corso illustra i processi di stima, e di verifica, degli Undertaking Specific Parameters in Solvency II. Per ciascun metodo di stima, sono richiamati i modelli teorici sottostanti; sono descritte le possibili metodologie per la verifica delle ipotesi e i test sulla bontà di adattamento ai dati; sono definiti i dati necessari al calcolo e commentati gli aspetti computazionali rilevanti. I passi salienti dei processi di calcolo sono corredati da esempi numerici illustrativi.

In particolare il programma del corso si articola come segue:

Parte I - I modelli teorici e la verifica delle ipotesi sottostanti

1. I modelli teorici alla base dei metodi standardizzati per gli USP

1.a. Il modello di riferimento per il Method 1 (Modello M1)
1.b. Il modello di riferimento per il Method 2 (Modello M2)

2. La verifica delle ipotesi dei modelli teorici

2.a. Verifica delle ipotesi del modello M1
- 2.a.1. Ipotesi sulla media
- 2.a.2. Ipotesi sulla varianza
- 2.a.3. Un esempio di verifica "marketwide" dell'ipotesi sulla varianza
- 2.a.4. Ipotesi sulla distribuzione
  - Test di normalità
  - Un confronto per simulazione delle metodologie di test
- 2.a.5. Appropriatezza del metodo di massima verosimiglianza

2.b. Verifica delle ipotesi del modello M2
- 2.b.1. Ipotesi sulla media e la varianza condizionate
- 2.b.2. Ipotesi di indipendenza. Test sui residui "time series"
- 2.b.3. Ipotesi di indipendenza. Test sui residui di Pearson

Parte II - Applicazione ai dati d'impresa

3. Premium Risk (modello M1)

3.a. Definizione dei dati in input
3.b. Applicazione del metodo
3.c. Sulla tecnica di minimizzazione

4. Reserve Risk (modello M1)

4.a. Definizione dei dati in input
4.b. Applicazione del metodo
4.c. Sulla tecnica di minimizzazione

5. Reserve Risk (modello M2)

5.a. Definizione dei dati in input
5.b. Applicazione del metodo

Orario:

09.15 – 09.30	Registrazione
09.30 – 11.00	Lezione
11.00 – 11.15	Pausa
11.15 – 13.00	Lezione
13.00 – 14.00	Intervallo
14.00 – 15.30	Lezione
15.30 – 15.45	Pausa
15.45 – 16.30	Lezione

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

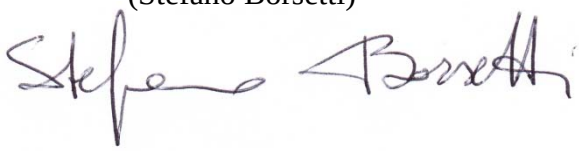
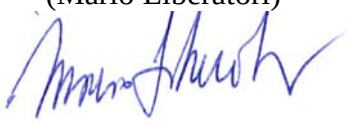
La richiesta di partecipazione è individuale e deve essere inviata personalmente dal partecipante alla SIFA per e-mail (info@sifa-attuari.it) **specificando nell'oggetto "richiesta di partecipazione 3° corso FAC-SIFA 2015"**.

La Segreteria della SIFA provvederà ad inviare la conferma di partecipazione entro lunedì 11 maggio 2015, in base all'ordine cronologico di arrivo delle richieste fino ad esaurimento dei 70 posti disponibili.

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)