



## SVILUPPO INIZIATIVE ATTUARIALI

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

Roma, 23 novembre 2023

**Prot. n. 017/23**

Cari colleghi,

siamo lieti di comunicarvi che, in continuità con la formazione a distanza, sono aperte le iscrizioni all'undicesimo corso SIA del 2023 dal titolo: **“Aggregazione dei Rischi e Solvency II in R”**. Il corso si terrà **martedì 12 dicembre 2023 in diretta web**.

Ricordiamo che è possibile iscriversi online direttamente dal nostro sito: [www.sia-attuari.it](http://www.sia-attuari.it).

Qualche giorno prima del corso, gli iscritti riceveranno, via mail, un link di collegamento alla piattaforma ZOOM. L'aula virtuale permetterà di interagire con il docente.

### **Docente**

Dott. Manuel Caccone – Quant Actuary/NL Risk M. presso UnipolSai

### **Obiettivi**

Il corso su "Aggregazione dei Rischi e Solvency II in R" si propone di fornire una comprensione approfondita dei principi di Solvency II, con particolare enfasi sui requisiti di capitale e gestione dei rischi. Si mira a insegnare l'utilizzo del linguaggio di programmazione R per l'analisi e l'aggregazione dei rischi, includendo la modellazione del rischio e il calcolo del Solvency Capital Requirement (SCR). Il corso copre anche la valutazione e la gestione dei rischi in conformità con le norme di Solvency II, evidenziando l'uso di R per la reportistica e la conformità normativa. Infine, verranno discussi casi di studio pratici e le ultime tendenze del settore, per preparare i partecipanti a navigare efficacemente le sfide nel settore assicurativo e finanziario.

### **Strumenti**

in questo corso verranno proposte metodologie statistiche con il giusto contenuto teorico, salvaguardando gli aspetti più pratici mediante l'utilizzo pratico del software R.

### **Contenuti**

- **Univariate Losses Distribution:** modelli PARAMETRICI discreti e modelli PARAMETRICI continui, stima dei parametri con metodi ML, GMM, reti neurali (casi pratici mediante l'utilizzo di R)
- **Le copule** per osservazioni IID: COPULE archimedee e ellittiche, stima dei parametri e bontà di adattamento ai dati (casi pratici mediante l'utilizzo di R);
- **Le misure di dipendenza e le misure di rischio:** misure di dipendenza lineare e non lineare, concetto di cointegrazione, misura del Valore a Rischio e dell'Expected ShortFall.
- **Introduzione alla Solvency II:** verranno ripercorsi brevemente il building block della SII, differenze fra modelli interni e formula standard
- **Aggregazione e diversificazione dei rischi:** aggregazione Var-Covar, Aggregazione di tipo Copula, allocazione dei rischi e regolarizzazione PSD della matrice di correlazione, aggregazione con reti neurali GAN
- **Applicazioni pratiche dei punti trattati.**



Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come stabilito dalle Linee Guida emanate dal Consiglio Nazionale degli Attuari in attuazione del regolamento sulla Formazione Attuariale Continua, redatto ai sensi dell'art. 7 comma 3 del D.P.R. N. 137/2012, pubblicato in gazzetta dal Ministero di Giustizia in data 30 dicembre 2018, saranno attribuiti **5 (cinque) CFP ai fini FAC** (Formazione Attuariale Continua).

L'iscrizione dovrà essere effettuata entro **giovedì 7 dicembre 2023.**

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

Il Presidente  
(Giampaolo Crenca)



**Segreteria operativa:**

S.I.A. s.r.l. - Viale delle Milizie 1 - 00192 Roma

E-mail: [info@sia-attuari.it](mailto:info@sia-attuari.it)

**Orario:**

**Martedì 12 dicembre 2023**

**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 – 17.45 Lezione

**Iscrizioni:**

Ci si può iscrivere direttamente sul nostro sito: [www.sia-attuari.it](http://www.sia-attuari.it) **entro giovedì 7 dicembre 2023.**  
**L'iscrizione al corso sarà confermata con nostra mail.**

**Quota di iscrizione:**

La quota di iscrizione per ogni partecipante è di **euro 450,00 + IVA**. La quota dà diritto alla partecipazione ai lavori e al materiale didattico.

**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.