



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, 8 ottobre 2012

Prot. n. 035/12

Cari Colleghi,

abbiamo il piacere di informarVi che il **5° corso FAC dell'anno 2012, 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 25 ottobre pv, dalle ore 10,15 alle ore 16,15 presso Starhotels Metropole, Via Principe Amedeo, 3 - 00185 Roma.

Il corso ha come titolo:

“Modelli matematici per li processi di sinistri”

Il programma del corso tenuto dalla **dott.ssa Giovanna Ferrara** è riportato in allegato.

Con la partecipazione al corso, che rientra tra le attività preclassificate, come da Regolamento della FAC, si acquisiscono 2 (due) CFP (Crediti Formativi Professionali) validi per il triennio 2010-2012.

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 5° corso FAC-SIFA 2012".**

La Segreteria della SIFA provvederà ad inviare la conferma di partecipazione entro lunedì 22 ottobre 2012, in base all'ordine cronologico di arrivo delle richieste fino ad esaurimento degli 80 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)



Allegato

MODELLI MATEMATICI PER I PROCESSI DI SINISTRI

Relazione tenuta dalla dott.ssa Giovanna Ferrara

Il corso si propone di esaminare gli aspetti rilevanti dei modelli che costituiscono il fondamento della solvency (cioè della teoria del rischio). In particolare saranno presentati metodi di calcolo numerico corredando l'esposizione con esempi tratti dalla prassi assicurativa. Per ogni modello inoltre saranno fornite le principali indicazioni bibliografiche.

CONTENUTI DEL CORSO

1) Modello del costo complessivo di un portafoglio (o del danno globale)

In questa prima parte, si esporranno alcuni principi fondamentali della teoria del rischio introducendo la nozione del costo complessivo di un portafoglio e delle sue componenti fondamentali. Saranno inoltre definite le ipotesi e le condizioni per una semplificazione del modello.

2) Modelli per il numero di sinistri

Anche sulla base di esempi numerici, sarà illustrata la prima componente del danno globale, cioè il processo del numero di sinistri indicando nel contempo i criteri di scelta fra le varie distribuzioni.

3) Modello per la tariffa Bonus- Malus

Si passerà successivamente all'esame di un modello per il trattamento delle tariffe Bonus - Malus, esemplificando numericamente la costruzione della matrice di transizione.

4) Modelli per il costo del sinistro

La seconda componente del costo complessivo, cioè il processo del costo dei sinistri, sarà esposta considerando le distribuzioni più citate nella letteratura attuariale. Anche in questo caso si indicheranno i criteri di scelta tenendo presente il grado di pericolosità. Saranno inoltre considerate criticamente le nozioni di VaR e di "Short -fall".

5) Le rappresentazioni grafiche per una migliore comunicazione

Infine, saranno forniti suggerimenti sulla rappresentazione grafica delle distribuzioni, ponendo l'accento sugli aspetti che ne agevolino la comunicazione.