

INFORMAZIONI PERSONALI

FABIO BAIONE



NATO A ROMA IL 07/08/1975

NAZIONALITÀ ITALIANA

GENERE: MASCHILE

VIALE REGINA ELENA, 295 –G 00161, ROMA, ITALIA

+39 06 49255317

fabio.baione@uniroma1.it

POSIZIONE RICOPERTA

DAL 02/05/2019

AD OGGI

Ricercatore a tempo determinato, ai sensi dell'art. 24, comma 3, lettera b), a tempo pieno, della legge 30 dicembre 2010, n. 240, per il settore concorsuale 13/D4, settore scientifico-disciplinare SECSS/ 06, Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, presso il Dipartimento di Statistica, "Sapienza" Università di Roma.

POSIZIONE PRECEDENTI

DAL 01/08/2018

AL 01/05/2019

Ricercatore a tempo determinato, ai sensi dell'art. 24, comma 3, lettera a), a tempo pieno, della legge 30 dicembre 2010, n. 240, per il settore concorsuale 13/D4, settore scientifico-disciplinare SECSS/ 06, Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, presso il Dipartimento di Metodi e Modelli per l'Economia, il Territorio e la Finanza, "Sapienza" Università di Roma.

POSIZIONI PRECEDENTI

DAL 20/12/2012

AL 19/12/2017

Ricercatore a tempo determinato, ai sensi dell'art. 24, comma 3, lettera a), a tempo definito, della legge 30 dicembre 2010, n. 240, per il settore concorsuale 13/D4, settore scientifico-disciplinare SECSS/ 06, Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie, presso il Dipartimento di Scienze per l'Economia e l'Impresa. Università degli Studi di Firenze.

ESPERIENZA ACCADEMICA

TITOLARITA' DI CORSI UNIVERSITARI

A.A. 2019/2020

Professore aggregato del corso di "Teoria del Rischio 2". (48h – 6 CFU)
Corso di Laurea Magistrale in "Scienze Attuariali e Finanziarie", Sapienza Università di Roma.

A.A. 2019/2020

Professore aggregato del corso di "Laboratorio di Matematica Finanziaria". (27h – 3 CFU).
Corso di Laurea in " Statistica, economia, finanza e assicurazioni ", Sapienza Università di Roma.

A.A. 2018/2019

Professore aggregato del corso di "Matematica Finanziaria". (72h – 9 CFU)
Corso di Laurea in "Management e diritto d'impresa", Sapienza Università di Roma-Sede di Latina.

A.A. 2017/2018

Professore aggregato del corso di "Metodi per l'analisi del rischio e la gestione del portafoglio". (72h – 9 CFU)
Corso di Laurea Magistrale in "Scienze Attuariali", Università degli Studi di Firenze.

A.A. 2017/2018

Professore a contratto per la docenza del corso di "Actuarial Life Insurance". (49h – 7 CFU)
Corso di Laurea Magistrale Interfacoltà: Scienze bancarie, finanziarie e assicurative - economia, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano.

- DALL' A.A. 2012/2013
ALL' A.A.2016/2017 Professore aggregato del corso di "Tecnica attuariale delle assicurazioni sulla vita". (72h – 9 CFU)
Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali, Università degli Studi di Firenze.
- DALL' A.A. 2015/2016
ALL' A.A.2016/2017 Professore a contratto per la docenza del corso di "Tecnica attuariale delle assicurazioni sulla vita". (28h – 5 CFU)
Corso di Laurea Magistrale Interfacoltà: Scienze bancarie, finanziarie e assicurative - economia, Università Cattolica del Sacro Cuore, Milano.
- DALL' A.A. 2008/2009
ALL' A.A.2016/2017 Professore a contratto per la docenza del corso integrativo per l'insegnamento della "Matematica Finanziaria" – Corso B. (12h)
Università LUISS – Guido Carli, Facoltà di Economia.
- DALL'A.A. 2010/2011
ALL' A.A.2011/2012 Professore a contratto per la docenza del corso di "Tecnica attuariale delle assicurazioni sulla vita". (63h – 9 CFU)
Università degli Studi del Sannio - Benevento Facoltà di Economia.
- A.A. 2011/2012 Professore a contratto per la docenza del corso di "Tecnica attuariale delle assicurazioni sulle Persone". (63h – 9 CFU)
Università degli Studi del Sannio - Benevento Facoltà di Economia.

DOCENZA IN MASTER E CORSI DI FORMAZIONE UNIVERSITARI

- A.A. 2002/2003 Docente del corso di "Tecnica delle assicurazioni II" presso il Master Universitario di I livello in Assicurazioni, Previdenza e Assistenza sanitaria - M.A.P.A. (16h)
Università Cattaneo - LIUC di Castellanza (VA).
- DALL'A.A. 2003/2004
ALL' A.A.2015/2016 Docente del corso di "Tecnica e Finanza delle assicurazioni II" presso il Master Universitario di II livello in Assicurazioni, Previdenza e Assistenza sanitaria - M.A.P.A. (16h)
Università Cattaneo - LIUC di Castellanza (VA).
- DALL'A.A. 2004/2005
ALL' A.A.2008/2009 Docente del corso di "Modelli Matematici Per le Assicurazioni persone I" presso il Master Universitario di secondo livello per Analista del Risk Management Assicurativo - A.R.M.A. (24h)
Università di Roma "La Sapienza" - Facoltà di Economia .
- DALL'A.A. 2004/2005
ALL' A.A.2008/2009 Docente del corso di "Modelli Matematici Per le Assicurazioni persone II" presso il Master Universitario di secondo livello per Analista del Risk Management Assicurativo - A.R.M.A. (24h)
Università di Roma "La Sapienza" - Facoltà di Economia
- DALL' A.A. 2004/2005
ALL' A.A.2008/2009 Docente del corso di "Modelli Matematici per il Fair Value dei contratti di Assicurazione" presso il Master Universitario di secondo livello per Analista del Risk Management Assicurativo - A.R.M.A. (24h)
Università di Roma "La Sapienza" - Facoltà di Economia.
- DALL' A.A. 2007/2008
ALL'A.A. 2015/2016 Docente del corso "La gestione assicurativa, modelli attuariali e modalità di gestione delle attività e passività" Corso Professionalizzante di Alta Formazione Universitaria in Amministrazione, Gestione, Direzione e Controllo delle Forme di Previdenza Complementare. (16h)
Università Cattaneo - LIUC di Castellanza (VA).

10-12 OTTOBRE 2016 Docente del corso: "Risk Management for Solvency II in Life Companies".
Dipartimento di Scienze Economiche, Aziendali, Matematiche e Statistiche dell'Università degli Studi di Trieste per Generali Academy.

**ALTRE ATTIVITA' DI SUPPORTO
ALLA DIDATTICA UNIVERSITARIA**

- A.A.2019/2020 Membro del Gruppo di Gestione AQ
Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali e Finanziarie, Sapienza Università di Roma.
- A.A.2016/2017 Membro del Comitato per la didattica
Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali, Università degli Studi di Firenze.
- DALL' A.A. 2013/2014 Responsabile tirocini curriculum attuariale-finanziario
ALL' A.A.20016/2017 *Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali, Università degli Studi di Firenze.*
- DALL' A.A. 2013/2014 Membro del Gruppo di Riesame
ALL' A.A.2015/2016 *Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali, Università degli Studi di Firenze.*
- DALL' A.A. 2012/2013 Supporto alla didattica del corso di "Metodi per l'analisi del rischio e la gestione del portafoglio", Prof. L. Vannucci (24 h 3 CFU)
ALL' A.A.20016/2017 *Corso di Laurea Magistrale in Scienze Attuariali, Università degli Studi di Firenze.*
- DALL' A.A. 2000/2001 Cultore della materia e supporto alla didattica presso la cattedra di "Matematica Finanziaria I" del Prof. P. De Angelis
ALL' A.A.2001/2002 *Università di Roma "La Sapienza" sede di Latina.*
- A.A. 2000/2001 Cultore della materia e supporto alla didattica presso la cattedra di "Matematica Finanziaria II" del Prof. M. Micocci.
Università di Roma "La Sapienza" sede di Latina.
- DALL'A.A. 2002/2003 Cultore della materia e supporto alla didattica presso la cattedra di "Matematica Finanziaria II" del Prof. P. De Angelis
ALL' A.A.2003/2004 *Università degli Studi di Roma La Sapienza - Facoltà di Economia - Corso di Laurea di Latina.*
- DALL' A.A. 2004/2005 Cultore della materia e supporto alla didattica presso la cattedra di "Complementi di Matematica ed fondamenti di Matematica Finanziaria" del Prof. P. De Angelis.
ALL' A.A.2009/2010 *Università degli Studi di Roma La Sapienza - Facoltà di Economia - Corso di Laurea di Latina.*
- DALL' A.A. 2004/2005 Cultore della materia e supporto alla didattica presso la cattedra di "Modelli Matematici per i Mercati Finanziari" del Prof. P. De Angelis.
ALL' A.A.2009/2010 *Università degli Studi di Roma La Sapienza - Facoltà di Economia - Corso di Laurea di Latina.*
- A.A. 2007/2008 Supporto alla docenza del corso di "Complementi di Matematica e fondamenti di Matematica Finanziaria" del Prof. P. De Angelis.
Università degli Studi di Roma La Sapienza – Facoltà di Economia – Corso di Laurea di latina.
- DALL' A.A. 2005/2006 Cultore della materia presso la cattedra di "Matematica applicata all'economia finanza e assicurazioni" del Prof. P. De Angelis.
ALL' A.A.2009/2010

Università degli Studi di Roma La Sapienza - Facoltà di Economia - Corso di Laurea di Latina.

**INCARICHI DI INSEGNAMENTO O
RICERCA ALL'ESTERO**

DAL 15-04-2002
AL 07-07-2002

Full time student - Postgraduate Occasional Actuarial Science.
City University, Londra, UK.

INTERESSI DI RICERCA

- Matematica attuariale per assicurazioni sulla Vita, contro i Danni, sulla Salute e forme di Previdenziali;
- Matematica finanziaria;
- Requisiti di solvibilità per le assicurazioni, fondi pensione e sanitari;
- Valutazioni attuariali in ambito multistato nelle assicurazioni sulla salute
- Modelli statistici multivariati applicati in ambito attuariale

**ESPERIENZA
PROFESSIONALE**

DALL' APRILE 2001 AD
OGGI

Partner scientifico di A.C.R.A. (Associazione per la Consulenza e la Ricerca Attuariale), svolgendo attività di consulenza nell'ambito delle assicurazioni danni, con particolare riferimento al settore delle assicurazioni malattia, assistenziali e di responsabilità civile autoveicoli. Esperto nell'implementazione di modelli interni per il pricing di strumenti finanziari derivati e per la valutazione di portafogli assicurativi e finanziari.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

GIUGNO 2003

Dottore di ricerca (Ph. D.) in Scienze Statistiche ed Attuariali (XV Ciclo)

Facoltà di Scienze Statistiche – Sapienza Università di Roma

MAGGIO 1999

Diploma di Laurea in Scienze Statistiche ed Attuariali

Facoltà di Scienze Statistiche - Sapienza Università di Roma

**INFORMAZIONI
AGGIUNTIVE
PUBBLICAZIONI**

ARTICOLI SU RIVISTA

1. Baione F., Levantesi S., Menziotti M., "The development of an optimal Bonus-Malus system in a competitive market", ASTIN Bulletin, Vol. 32, No. 1, 2002, pp. 159-170 - Louvain -Belgio.

2. Baione F., De Angelis P., Fortunati A., "On a Fair Value Model for Participating Life Insurance Policies", *Investment Management and Financial Innovations*, n. 2, 2006 pp.105-115 Sumy - Ucraina.
3. Baione F., De Angelis P., "A Review on Statistical and Probabilistic Models for The Control of Insurance Companies", in *Investment Management and Financial Innovations*, n. 4, 2006 pp.65-78 Sumy - Ucraina.
4. Baione F., Levantesi S., "A health insurance pricing model based on prevalence rates: Application to critical illness insurance", *Insurance: Mathematics and Economics*, Vol. 58 Elsevier 2014, pag: 174-184, DOI: 10.1016/j.insmatheco.2014.07.005.
5. Baione F., De Angelis P., Menzietti M., Tripodi A. "A comparison of risk transfer strategies for a portfolio of life annuities based on RORAC", In *Journal of Applied Statistics* - ISSN:0266-4763, 2016, pag:1-18, DOI: DOI:10.1080/02664763.2016.1238047
6. Baione F., Levantesi S. "Pricing Critical Illness insurance from prevalence rates: Gompertz versus Weibull", In *North American Actuarial Journal*, ISSN: 1092-0277 print / 2325-0453 online DOI: 10.1080/10920277.2017.1397524 , vol. 22(2), 2018, pp. 270-288.
7. Baione F., Biancalana D. "An Individual Risk Model for Premium Calculation Based on Quantile: A Comparison between Generalized Linear Models and Quantile Regression", In *North American Actuarial Journal*, DOI: 10.1080/10920277. 2019.1604238.
8. Baione F., Biancalana D., De Angelis P. "A Quantile Regression approach for the analysis of the diversification in non-life premium risk, *SOFT COMPUTING*. - ISSN 1432-7643, 2019, pp. 1-14.

CAPITOLI DI LIBRO

9. Baione F., De Angelis P., Fortunati A., "Actuarial Models for a Fair Evaluation of Life Insurance Policies", *Convegno MTISD 2004*, Università del Sannio, in P. Amenta, L. D'Ambra, M.Squillante, A.Ventre, *Metodi, Modelli e Tecnologie dell'informazione a supporto delle decisioni*, ed. Franco Angeli, 2005, ISBN 88-464-7440-6 pp.31-54.
10. Baione F., De Angelis P. "Un modello attuariale per il Rating delle Imprese di Assicurazione sulla vita", in P. Amenta, M. Squillante e V. Ventre "Il Trattamento del Rischio in Ambito -Bancario e Assicurativo". Franco Angeli Editore, 2008, pp. 39 – 62; ISBN: 978-88-464-8382-9.
11. Baione F., De Angelis P., Ottaviani R., 2010 "On a Decision Model for a Life Insurance Company Rating". In: Greco S., Marques Pereira R.A., Squillante M., Yager R.R., Kacprzyk J. (eds) *Preferences and Decisions. Studies in Fuzziness and Soft Computing*, vol 257. Springer, Berlin, Heidelberg.
12. Baione F., De Angelis P., "I prodotti Ramo Danni", in: Previati-Porzio-Cocozza-Pisani-Miani, "Economia delle imprese assicurative", McGraw-Hill, 2011, ISBN: 6554-7.
13. Baione F., Levantesi S., Marchese R., Menzietti M., Tripodi A., "Un approccio risk-based per il calcolo della tariffa Medical Malpractice", a cura di: Boccadoro A. e De Angelis P., "Sanità pubblica e assicurazioni: il fair price del rischio Medical Malpractice", Cedam 2012, ISBN: 978-88-13-31475-0.

14. Baione F., De Angelis P., "Elementi tecnico-attuariali per le assicurazioni sulla vita e contro i danni", Parte II – IMPRESA Capitolo 3 in: M. Hazan, S. Taurini, "Assicurazioni Private", Wolters Kluwer – IPSOA 2015, ISBN: 978-88-217-4609-3, 978-88-217-4643-7.
15. Baione F., Levantesi S., Conforti C., Menziotti M., Tripodi A., Cap 3 in "Assicurazioni sulla salute: caratteristiche, modelli attuariali e basi tecniche", a cura di: De Angelis P., Di Falco L., il Mulino 2016, ISBN: 978-88-15-26084-0.
16. Baione F., Levantesi S., Conforti C., Menziotti M., Tripodi A., Cap 4 in "Assicurazioni sulla salute: caratteristiche, modelli attuariali e basi tecniche", a cura di: De Angelis P., Di Falco L., il Mulino 2016, ISBN: 978-88-15-26084-0.
17. Baione, F. De Angeis P. "Il processo di selezione del gestore assicurativo". In: La gestione del rischio nei fondi sanitari integrativi - ISBN:978-88-943523-2-0, 2019, pp.57-70.
18. Baione, F. De Angeis P. "Criteri per il controllo di gestione e per i processi di risk management." In: La gestione del rischio nei fondi sanitari integrativi - ISBN:978-88-943523-2-0, 2019, pp.119-131.

**CONTRIBUTI SU ATTI DI
CONVEGNO**

19. Baione F., De Angelis P., Fortunati A., "Il Fair Value di Contratti di Assicurazioni sulla Vita: Analisi dell'effetto sul Bilancio della Compagnia", Atti del VI Congresso Nazionale di Scienza e Tecnica della Assicurazioni, 2004, pp.111-122.
20. Baione F., "Modelli per la cartolarizzazione delle riserve sinistri nel ramo RC auto" Atti del Convegno. MTISD 2006 - Metodi, modelli, e tecnologie dell'informazione a supporto delle decisioni, RCE. Edizioni, ISBN: 88-8399-080-3, 2006.
21. Baione F., "Riserva sinistri stocastica e misure di risk capital per assicurazioni non-life", MTISD 2008 – Methods, Models and Information Technologies for Decision Support Systems, Università del Salento, Lecce, 2008 e-ISBN: 978-88-8305-060-2 (cd-rom v.) 978-88-8305-061-9 (on-line v.), pp. 203-205.
22. Baione F., De Angelis P., Fortunati A., Tripodi A., "Longevity Risk and Financial Markets: Some Issues", Advances and Applications in Statistical Sciences "Proceedings of The V Meeting on Dynamics of Social and Economic Systems", Volume 6, Issue 6, September 2011, Pages 423-441; ISSN 0974-6811.
23. Baione F., De Angelis P., "Portfolio Selection and Management Fees: some considerations", Advances and Applications in Statistical Sciences "Proceedings of The V Meeting on Dynamics of Social and Economic Systems", Volume 6, Issue 6, September 2011, Pages 407-422; ISSN 0974-6811.
24. Baione F., De Angelis P., Granito I., "On a capital allocation principle coherent with the Solvency II standard formula", proceedings of the Ivass Conference On Insurance Research 2017, Roma. <https://www.ivass.it/pubblicazioni-e-statistiche/pubblicazioni/att-sem-conv/2017/conf-131407/index.html>
25. Baione F., D. Biancalana, De Angelis P., Granito I. "Classification ratemaking via Quantile Regression and a comparison with Generalized Linear Models", in Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, MAF. Editors: Corazza, M., Durbán, M., Grané, A., Perna, C., Sibillo, M., Springer International Publishing. 2018, Madrid DOI: 10.1007/978-3-319-89824-7. eBook ISBN: 978-3-319-89824-7.

26. Baione F., D. Biancalana, De Angelis P., Granito I. "Dynamic policyholder behavior and surrender option evaluation for life insurance", in *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, MAF. Editors: Corazza, M., Durbán, M., Grané, A., Perna, C., Sibillo, M., Springer International Publishing. 2018, Madrid DOI: 10.1007/978-3-319-89824-7. eBook ISBN: 978-3-319-89824-7.

ALTRE PUBBLICAZIONI

27. Baione F., "Un confronto analitico sulla determinazione del premio periodico per forme assicurative con prestazioni ancorate ad un indice o fondo di riferimento", *Quaderni del Dipartimento di Scienze Attuariali e Finanziarie*, n.18, 2000.
28. Baione F., Levantesi S., Menzietti M., "Alcune considerazioni sull'efficienza dei sistemi Bonus-Malus" *Rapporti Scientifici A.M.A.S.E.S.*, n. 10, 2002.
29. Baione F., *La cartolarizzazione della riserva sinistri: un modello atuariale per il ramo R.C.Auto. Tesi di dottorato, Dottorato di ricerca in Scienza Attuariali*, XV ciclo, p. 1-101. Bibl. Nazionale Centrale Firenze, 2003
30. Baione F., Levantesi S., "A quantitative analysis of disability surveys in five European countries", *Quaderni del Dipartimento di Scienze Attuariali e Finanziarie*, n.25, 2004.
31. Baione F., Menzietti M., "Forme Assicurative Index Linked con Prezzo d'Esercizio α -Quantile", *Analisi dei rischi ed ottimalità delle garanzie nei prodotti assicurativi vita*, Ricerca Interuniversitaria PRIN 2003 cofinanziata dal MIUR, Firenze 2004.
32. Baione F., Levantesi S., "Alcune considerazioni sulla costruzione delle basi tecniche per le assicurazioni Dread Disease", *Rapporti Scientifici A.M.A.S.E.S.*, n. 28, 2005.
33. Baione F., De Angelis P., Granito I., "On a capital allocation principle coherent with the Solvency 2 standard formula", *Arxiv*, 2018 arXiv:1801.09004 [q-fin.RM]

WORK IN PROGRESS E ACCEPTED/SUBMITTED PAPERS

34. Baione F. De Angelis P., D' Ecclesia R. (-) "A review of Redington's immunization theorem in a Solvency 2 framework". To be submitted
35. Baione F., D. Biancalana, De Angelis P., (-) "An application of Sigmoid and Double-Sigmoid functions for dynamic policyholder behaviour". Submitted to *Decisions in Economics and Finance*.
36. Baione F., D. Biancalana, "A Beta regression approach for modelling surrenders and withdrawals in a life insurance portfolio.". Submitted to *Insurance: Mathematics and Economics*.

RICONOSCIMENTI E PREMI

Borsa di studio del MIUR per il Dottorato in "Scienze Attuariali" (XVI ciclo), Facoltà di Scienze Statistiche, Sapienza Università di Roma. Dal 01-11-1999 al 31-10-2002.

APPARTENENZA A GRUPPI / ASSOCIAZIONI

DA LUGLIO 2000	Attuario iscritto all'Albo dell'Ordine Nazionale degli Attuari con il numero 1133
DA GENNAIO 2001	Socio AMASES (Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali)
DA DICEMBRE 2007	Socio dell'Istituto Italiano degli Attuari

FINANZIAMENTI PER LA RICERCA

DAL MARZO 2014 A GIUGNO 2014	Vincitore della selezione per il conferimento di un incarico in Co.co.co. sul tema "Analisi delle fonti statistiche nazionali ed internazionali sulla insorgenza delle malattie gravi e delle patologie a causa della non autosufficienza. Sviluppo di modelli quantitativi per la stima delle distribuzioni di probabilità dei rischi assicurabili con contratti di assicurazione di tipo dread disease e long term care" presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza" finanziato dall'ANIA.
DAL GENNAIO 2012 A FEBBRAIO 2012	Vincitore della selezione per il conferimento di un incarico in Co.co.co. sul tema "Supporto tecnico - attuariale allo sviluppo di un modello di tariffazione del Rischio RCG Medical Malpractice" presso il Dipartimento di Scienze Statistiche dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza" finanziato dall'AIBA (Associazione Italiana dei Brokers Assicurativi).
A.A. 2011/2012	Partecipante alla Progetto di Ricerca: Optimal reinsurance programs bearing demographic risk. Unità di ricerca: Università La Sapienza.
A.A. 2009/2010	Partecipante alla Ricerca Facoltà Economia Università La Sapienza "Modelli attuariali per la Securitization del rischio di mortalità".
DA GENNAIO 2008 A DICEMBRE 2009	Membro di Unità locale del progetto PRIN 2007: "Modelli per la valutazione del rischio ai fini della solvibilità in ambito assicurativo e previdenziale" (Coordinatore: Paolo De Angelis).
A.A.2007/2008	Partecipante alla Ricerca Facoltà Economia Università La Sapienza "Misure coerenti di rischio e solvibilità dei fondi pensione.
A.A.2005/2006	Partecipante alla Ricerca Facoltà Economia Università La Sapienza "Misure di rischio per la valutazione del capitale economico delle compagnie di assicurazione".
DA GENNAIO 2003 A DICEMBRE 2005	Membro di Unità locale del progetto PRIN 2003: "Ottimalità e valutazione di garanzie assicurative con elementi aleatori. Unità di ricerca: Università La Sapienza" (Coordinatore: Ernesto Volpe di Prignano).
A.A. 2003/2004	Partecipante al Progetto di ricerca di Facoltà di Economia Università La Sapienza: "Modelli per la valutazione del Fair Value dei contratti di assicurazione sulla vita".

ATTIVITA' EDITORIALE

REFEREE PER RIVISTE INTERNAZIONALI	Insurance: Mathematics and Economics Annals of Operations Research Decisions in Economics and Finance
------------------------------------	---

ATTIVITA' DIDATTICA DI FORMAZIONE

- 19 GIUGNO 2019 Eurovita Assicurazioni. Solvency II in Life Insurance Companies. Milano
- 08 APRILE 2017 IRSA. Progetto formativo Groupama "Formazione Business Unit Protezione", Groupama. Roma
- 28 OTTOBRE 2017 Corso di Scuola di Attuariato Laboratorio di "Enterprise Risk Management Concetti di Base". CISA - Firenze
- DAL 2016 AD OGGI Scuola Attuariato, Docente del corso di "Tecnica Attuariale delle assicurazioni sulla Vita". CISA - Firenze
- DAL 2014 AD OGGI Scuola Attuariato, Responsabile del Laboratorio di "Tecnica Attuariale delle assicurazioni sulla Vita". CISA - Firenze
- 14-15 NOVEMBRE 2012 IRSA. Progetto formativo CNP Vita "Corso di Finanza di Base e Finanza Progredito" CNP Vita. Milano
- 21 NOVEMBRE 2008 BDO: Metodi di stima delle riserve sinistri: metodologie ed applicazioni. Rimini
- 22-23 APRILE 2008 AXA, Progetto di formazione su "Fair Value, Economic Capital e Internal Models per la valutazione di una Compagnia di Assicurazioni". Milano
- 05-06 MAGGIO 2009 AXA, Progetto di formazione "Compliance Danni: Tariffe e Riserve". Milano
- 9 - 10 LUGLIO 2008 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale) corso di formazione professionale su "Current Estimate, Risk Margin e Economic Capital per la valutazione delle passività di una Compagnia di Assicurazioni". II edizione. Roma
- 2 - 3 LUGLIO 2008 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale), corso di formazione professionale in "Finanza di Base per le Assicurazioni". II edizione. Milano
- 11-12 GIUGNO 2007 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale) corso di formazione professionale su "Current Estimate, Risk Margin e Economic Capital per la valutazione delle passività di una Compagnia di Assicurazioni". I edizione. Roma
- 21 - 22 GIUGNO 2006 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale) corso di formazione professionale su "Unit-linked e index-linked metodi per la valutazione" II edizione. Milano.
- 10 - 11 MAGGIO 2006 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale), corso di formazione professionale in "Finanza di Base per le Assicurazioni". I edizione. Roma
- 1-2 MARZO 2005 SIFA s.r.l. (Società Sviluppo Iniziative Formazione Attuariale) corso di formazione professionale su "Unit-linked e Index-linked metodi per la valutazione" I edizione. Roma

COMUNICAZIONI A CONVEGNI E SEMINARI

- 9-12 OTTOBRE 2018 Dynamics of Social and Economic Systems (DYSES). Sorbonne, Paris, paper: "A dynamic policyholder behavior model for lapse risk assessment in a participating life insurance portfolio" with Biancalana D. De Angelis P. and Granito I.
- 4-6 APRILE 2018 VIII Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Madrid, papers "Dynamic Policyholder Behavior and Surrender Option Evaluation for Life Insurance" and "Classification Ratemaking via Quantile Regression and a Comparison with Generalized Linear Models" with Biancalana D. De Angelis P. and Granito I.
- 8-10 NOVEMBRE 2017 Seminario, Leeds University, UK "An individual risk model for premium calculation based on quantile: a comparison between Generalized Linear Models and Quantile Regression"
- 13-14 LUGLIO 2017 Ivass Conference On Insurance Research 2017, Roma. "On a capital allocation principle coherent with the Solvency II standard formula".
- 25 MAGGIO 2016 Ania, Roma. Presentazione del libro "Assicurazioni sulla salute: caratteristiche, modelli attuariali e basi tecniche: Assicurazioni LTC e malattie gravi: modelli attuariali e applicazioni". (co-authors: S. Levantesi, M. Menzietti). (<http://www.ania.it/export/sites/default/it/sala-stampa/eventi/Documenti-correlati/2016/Presentazione-del-libro-Assicurazioni-sulla-salute-caratteristiche-modelli-attuariali-e-basi-tecniche-ANIA-25.05.2016-Programma.pdf>)
- 28 NOVEMBRE 2015 70° anniversario dell'Ordine degli Attuari, Roma "Guardando al futuro: la attuariale professione a tra tradizione ed innovazione"
- 14 -16 SETTEMBRE 2015 XXXVI Conferenza AISRE - Associazione italiana di scienze regionali Arcavacata di Rende (Cosenza) "La Valutazione del costo della Medical Malpractice attraverso un approccio di tipo risk-based"
- 05-08 SETTEMBRE 2015 XXV Convegno AMASES, Padova. Paper: "An individual premium risk valuation in a non-life insurance: a quantile regression approach" (co-author: D. Biancalana). http://www.math.unipd.it/~vargiolu/AMASES2015/Aux_Files/AbstractsAMASES2015/AbstractsTalks/Abs39AMASES_Biancalana.pdf
- 28 APRILE 2015 La Sapienza Roma, Seminari attuariali, corso di laurea magistrale FINASS– Corso di Laurea Magistrale Finass. "Modelli per il pricing del rischio RCA"
- 1 OTTOBRE 2014 Workshop "Linea 38", Associazione Italiana Broker Assicurativi (AIBA) "SIR Self insured retention in ambito MedMal: Valutazioni e Riflessioni sotto l'aspetto attuariale".
- 16-18 SETTEMBRE 2014 Dynamics of Social and Economic Systems (DYSES). Siviglia. "Traditional and financial re-insurance strategies for a portfolio of life annuities: an economic point of view. (co-authors P. De Angelis, A. Tripodi and M. Menzietti).
- 16-18 SETTEMBRE 2014 Dynamics of Social and Economic Systems (Dyses), Siviglia. "Non-Life Insurance Immunization in the Semi-Deterministic Setting: A Proposal of a Duration Measure" (co-author a. Tripodi)

- 15 NOVEMBRE 2013 Le Séminaire du laboratoire SAF, Institut de Sciences Financière et d'Assurances (ISFA) Université Lyon 1, France. Invited speaker. "Fair valuation of life insurance policies for a life insurance company rating". <http://isfa.univ-lyon1.fr/recherche/seminaires-et-congres/>
- 05-07 GIUGNO 2013 X Congresso Nazionale deli Attuari, Roma "La gestione finanziaria dei fondi pensione: il ruolo dell'attuario tra passato, presente e futuro"
- 10-12 APRILE 2012 V Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Venezia, paper: "An actuarial model for Loss Given Default estimation via Semi-Markov process". (co-author: R. Marchese). Extended abstract (<http://maf2012.unive.it/viewpaper.php?id=112>)
- 20-25 SETTEMBRE 2010 Dynamics of Social and Economic Systems (DYSES). Benevento. Paper: "Portfolio Selection and Management Fees: some considerations for a pension fund management" (co-author A. Fortunati)
- 18-20 SETTEMBRE 2010 Workshop PRIN 2007: Modelli per la valutazione del rischio in ambito assicurativo, Tropea (CS). Papers: "Portfolio Selection and Management Fees: some considerations" (co-author: A. Fortunati)
- 18-20 SETTEMBRE 2008 Methods, Models and Information Technologies for Decision Support Systems MTISD 2008 - Università del Salento, Lecce. "Riserva sinistri stocastica e misure di risk capital per assicurazioni non-life"
- 11-13 OTTOBRE 2006 Metodi Matematici e Statistici per le Assicurazioni e la Finanza MAF 2006-Università di Salerno, Salerno, 2006. "Obbligazioni strutturate collegate allo smontamento delle riserve sinistri"
- 28-30 SETTEMBRE 2006 Methods, Models and Information Technologies for Decision Support Systems MTISD 2006 Università del Sannio, Procida – "Modelli per la cartolarizzazione delle riserve sinistri nel ramo RC auto"
- 12-14 SETTEMBRE 2005 XXIX Convegno AMASES, Palermo. Paper: "Alcune considerazioni sulle basi tecniche delle assicurazioni Dread Disease" (co-author S. Levantesi)
- 14-16 GIUGNO 2004 VIII International Congress on Insurance: Mathematics & Economics, Roma, 2004. "A fair value model for traditional life insurance policies" (co-auteurs: P. De Angelis, A. Fortunati)
- 18-20 GENNAIO 2004 VI° Congresso Nazionale di Scienza e Tecnica delle Assicurazioni, Bologna, "Il Fair Value di Contratti di Assicurazioni sulla Vita: Analisi dell'effetto sul Bilancio della Compagnia"
- 05-08 SETTEMBRE 2001 XXV Convegno AMASES, Firenze, 2001" Alcune considerazioni sull'efficienza dei sistemi Bonus-Malus"

ALTRE INFORMAZIONI

LINGUA MADRE

Italiano

ALTRE LINGUE

COMPRESIONE	PARLATO	PRODUZIONE SCRITTA
-------------	---------	--------------------

	ASCOLTO	LETTURA	INTERAZIONE	PRODUZIONE ORALE	
Inglese	B1	B2	B2	B1	B2
Livelli: A1/2 Livello base - B1/2 Livello intermedio - C1/2 Livello avanzato Quadro Comune Europeo di Riferimento delle Lingue					

PATENTE DI GUIDA Categoria B

COMPETENZE INFORMATICHE Ottima conoscenza del sistema operativo Microsoft Windows e dei pacchetti applicativi Office (Word, Excel, PowerPoint, Outlook, VBA)
Ottima conoscenza di programmi ad uso scientifico: R, Matlab, Mathematica, LaTeX.

Luogo e data: Roma 19/11/2019