

MATTEO IALENTI

ATTIVITA ACCADEMICA

- 2012 – oggi** **Università “La Sapienza”**. Roma
Cultore di Matematica Attuariale. Dipartimento di Scienze Statistiche.
- 2008 – 2012** **Università “del Sannio”**. Benevento
Docente a contratto del corso **“Bilanci Assicurativi e Previdenziali”**. Facoltà di Economia.

FORMAZIONE

- 2010** **Vincitore del Premio “Fabio Padoa”** con la tesi di Dottorato *“Riserve sinistri: determinazione del Fair Value e del Reserve Risk Capital mediante modelli interni”*.
- 2009 – 2010** **Università “La Sapienza”**. Roma
Vincitore dell’assegno di ricerca **“Modelli markoviani e semimarkoviani nella valutazione del rischio”** presso la Facoltà di Scienze Statistiche.
- 2009 – 2009** **Università “del Sannio”**. Benevento
Vincitore dell’incarico di ricerca trimestrale dal titolo: *“Progettazione delle garanzie nei modelli previdenziali e assicurativo-sanitari”*.
- 2005-2009** **Università “La Sapienza”**. Roma
Dottore di ricerca in Scienze Attuariali
Tesi di dottorato *“Riserve sinistri: determinazione del Fair Value e del Reserve Risk Capital mediante modelli interni”*.
- Ottobre 2005** **Università “La Sapienza”**, Roma
Vincitore con borsa di studio del concorso di Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali.
- Luglio 2005** **Ordine Nazionale degli Attuari**
Abilitazione all’esercizio della professione in seguito al superamento dell’Esame di Stato, sessione giugno 2005

2000-2004

Università "La Sapienza", Roma

Laurea in Scienze Statistiche ed Attuariali, votazione 110 e lode.

Tesi di laurea "Reti Neurali".

1995-2000

Liceo Scientifico Statale "A. Romita", Campobasso (CB)

Diploma di maturità scientifica, votazione 100/100

PUBBLICAZIONI SCIENTIFICHE

Autore di numerose pubblicazioni in ambito attuariale, con particolare riferimento alle tematiche Solvency II e Internal Risk Model per le Compagnie Danni.

- 1 "Risk Management and Capital Allocation for Non-Life Insurance Companies" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Venezia 2012.
- 2 "Claims reserving uncertainty in the development of internal risk models" (with S.Forte and M.Pirra) – Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance, Editor: Springer, ISBN/ISSN: 978-88-470-2341-3, 2012.
- 3 "Bayesian Fisher Lange reserve risk modelling: sensitivities and back testing analysis" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XXXV Convegno Amases, Pisa, 2011.
- 4 "Implementing a Solvency II internal model: Bayesian stochastic reserving and Parameter Estimation" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of ASTIN Colloquium, Madrid, 2011.
- 5 "The Solvency Capital Requirement for a Long-Term Care Insurance Annuity" (with S.Forte and M.Pirra) – XVII meeting on risk theory, Edizioni Libellula ISBN: 978-88-968-1867-1, 2011.
- 6 "Implementing a Solvency II Non Life Internal Model: ReReserving and Backtesting" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XXXIV Convegno Amases, Macerata, 2010.
- 7 "A reserve risk model for a non-life insurance company" (with S.Forte and M.Pirra) Mathematical Methods in Economics and Finance, ISBN/ISSN: 978-88-470-1480-0, 2009.
- 8 "Solvency II: un confronto tra modelli interni per la valutazione del rischio di riservazione di una Compagnia danni" (with S.Forte and M.Pirra), Acts of XVI Convegno di Teoria del Rischio, Loffredo Editore 2009, ISBN/ISSN: 978-88-7564-419-2, 2009.
- 9 "Internal risk models for non life insurers: the choice of the assessment model" (with S.Forte and M.Pirra), Acts of XXXIII Convegno Amases, 2009.
- 10 "Riserve Sinistri: determinazione del Fair Value e del Reserve Risk Capital mediante modelli interni", PHD thesis in Actuarial Science, 2009.
- 11 "Bayesian internal models for the reserve risk assessment" (with S.Forte and M.Pirra) – Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari, Volume LXXI, Roma, ISBN/ISSN: 0390-5780, 2008.
- 12 "A Bayesian internal model for the evaluation of reserve risk of a non life insurance company" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of X Italian-Spanish Congress of Financial and Actuarial Mathematics, 2008.
- 13 "Un modello interno per la valutazione del rischio di riservazione di una compagnia danni: il Fisher-Lange bayesiano" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XV Convegno di Teoria del Rischio, Aracne Editrice 2008, ISBN/ISSN: 978-88-548-2660-1, 2008.
- 14 "Un modello bayesiano di tipo Fisher-Lange per la determinazione del rischio di riservazione di una Compagnia Danni" (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XXXII Convegno Amases, Trento, 2008.

- 15 **“Effetti della dipendenza tra i rami nella valutazione market consistent delle passività tecniche danni”** (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XXXI Convegno AMASES, Lecce, 2007.
- 16 **“Fair Value delle passività tecniche danni: possibili soluzioni”** (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XXXI Convegno AMASES, Lecce, 2007.
- 17 **“Una proposta di valutazione al fair value delle passività tecniche danni”** (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of VIII Congresso Nazionale degli Attuari – Trieste, settembre 2007.
- 18 **“Sull’equilibrio finanziario dei sistemi Bonus-Malus nel caso di dipendenza tra frequenza sinistri e costo del danno”**– Quaderno di dipartimento, Dipartimento di Scienze attuariali e finanziarie, Roma, 2007.
- 19 **“Costruzione di Sistemi Bonus-Malus ottimi mediante Programmazione Lineare”** – Acts of XIV Convegno di Teoria del Rischio, Aracne Editrice 2007, ISBN/ISSN: 978-88-548-1827-9, 2007.
- 20 **“Una proposta di valutazione market consistent delle passività tecniche danni”** (with S.Forte and M.Pirra) – Acts of XIV Convegno di Teoria del Rischio, Aracne Editrice 2007, ISBN/ISSN: 978-88-548-1827-9, 2007.

CORSI E SEMINARI:

Docente ai seguenti corsi e seminari

SIFA

- **“Non Life Actuarial Mathematics”**, Roma 5 e 6 Dicembre 2011
- **“Solvency II non-life underwriting risk: formula standard, modelli interni e tecniche di Re-Reserving e Backtesting”**, Roma 7 e 8/03/2011, Milano 26 e 27/03/2012.
- **“Non Life Underwriting Assessment”**, Roma 8 Novembre 2012

ISTITUTO ITALIANO DEGLI ATTUARI

- **“Solvency II: Internal Model for Non Life Reserving Risk”**, Roma 9/06/2010.
- **“Fair Value evaluation of Non Life Insurance Technical Liabilities”**, Roma 14/04/2008.

UNIVERSITA' “LA SAPIENZA” DI ROMA

- **“Risk Management and Capital Allocation for Non-Life Insurance Companies”**, Roma 6/07/2012.
- **“Pricing Motor and Fire insurance taking into account the dependency effect through Copula function”**, Roma 9/02/2011.
- **“Solvency II: internal model for Claims outstanding reserves, Re-reserving and Backtesting techniques”**, Roma 9/02/2011.
- **“Assessment, Re-Reserving and Backtesting of reserving risk in the Solvency II framework”**, Roma 12/07/2010.
- **“Risk Capital requirement for an annuity product with LTC additional coverage”**. Roma 12/07/2010.