

PRESIDENTI

Paolo De Angelis
Nino Savelli

SOCI

Eraldo Antonini
Fabio Baione
Giulia De Angelis
Andrea Fortunati
Annalisa Iacobone
Paolo Nicoli
Marco Spina

PARTNERS SCIENTIFICI



Susanna Levantesi
Massimiliano Menziotti

INFORMAZIONI PERSONALI



Marco Spina

 Viale Regina Margherita 262 00198 Roma, Italia

 +39 06 98373365  +39 320 4927979

 m.spina@deangelis-savelli.it

 www.deangelis-savelli.it

POSIZIONE RICOPERTA

Attuario Socio dello Studio De Angelis-Savelli e Associati, con ruolo di coordinamento nelle attività di consulenza legate al Risk Management, Solvency II e Riassicurazione Danni e nelle attività di valutazione attuariale delle riserve tecniche Non-Life.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

OTT 2013 - GEN 2018

Dottorato di Ricerca (Phd) in Scienze Statistiche Attuariali

Università degli studi di Roma La Sapienza, XXIX Ciclo.

Titolo Tesi: Un modello di riservazione individuale multistato a tempo discreto.

GIU 2014

Abilitazione alla Professione di Attuario (Fully Qualified Actuary)

Albo Nazionale degli Attuari

SET 2010-GEN 2013

Laurea Magistrale in Scienze Attuariali e Finanziarie

Università di Roma -La Sapienza, Valutazione 110 e Lode/110.

Titolo Tesi: Il rischio di tasso di interesse nelle gestioni separate.

SET 2007-OTT 2010

Laurea Triennale in Scienze Statistiche, Finanza e Assicurazioni

Università di Roma - La Sapienza, Valutazione 110 e Lode/110.

Titolo Tesi: Il ricampionamento della frontiera efficiente nell'ambito del modello Media-Varianza.

**ESPERIENZA
PROFESSIONALE**

2016 IN CORSO

Socio dello Studio Attuariale De Angelis – Savelli & Associati con ruolo di coordinamento nelle attività di consulenza legate al Risk Management, Solvency II e Riassicurazione Danni e nelle attività di valutazione attuariale delle riserve tecniche Non-Life.

Progetti svolti e in corso di svolgimento:

- **BEL Riserve Sinistri e Premi**
Second opinion sulle BEL per compagnie danni con l'utilizzo di metodologie attuariali deterministiche e stocastiche.
- **Riassicurazione Danni**
Progetti di pricing riassicurativo, analisi dell'impatto delle strategie di riassicurazione su SCR, Risk-Adjusted Performance Measurement, sia con Standard Formula che con modelli interni.
- **Audit Solvency II**
Audit sul processo di calcolo delle BEL in ambito ORSA;
Supporto all'Internal Audit per la review dei processi e delle procedure per il calcolo del SCR così come previsto dalla lettera al mercato IVASS del 7 dicembre 2016.
- **Formazione**
Docente in corsi di formazione aziendale sul tema Solvency II - Standard Formula con particolare riferimento ai moduli Market, Non-Life e all'applicazione degli Undertaking Specifics Parameters.
- **Economic Capital Modeling**
Sviluppo di modellistica di ottimizzazione del capitale per una primaria compagnia danni Italiana.
- **Esternalizzazione Funzione di Risk Management**
Attività legate all'esternalizzazione della funzione di Risk Management per primario Gruppo Assicurativo Italiano. Analisi ORSA, progettazione scenari stress, supporto nell'esercizio dello Stress Test 2018.

2012-2016

Consultant Attuariale presso Studio Attuariale Savelli dove ha svolto attività connesse alla funzione di Attuario Revisore per compagnie Danni e Vita e attività di Attuario Incaricato per le compagnie R.C. Auto.

Sono stati svolti con ruolo di primo piano nello sviluppo e nella realizzazione i seguenti progetti:

Solvency II – Pillar 1

- Processo di autorizzazione Undertaking Specifics Parameters:
 - Creazione degli script in ambiente R per la determinazione dei parametri specifici secondo i metodi standardizzati previsti dalla normativa Solvency II;
 - Selezione della tipologia di test di verifica delle ipotesi e creazione degli script in ambiente R;
- Review calcolo della Standard Formula:
 - GAP analysis sul calcolo delle BEL (Danni) e applicazione formula standard con particolare riferimento ai moduli di rischio catastrofale Non-Life, Counterparty default risk e LAC DT;
- Reperforming BEL Non-Life per varie compagnie del mercato danni;

Pricing Non-Life

- Supporto alle CTP nel ricorso al TAR di varie compagnie del mercato Italiano contro la presunta elusione dell'obbligo a contrarre contestata dall'IVASS.
- Reperforming indipendente della tariffa RCT/RCO per il Comune di Roma per l'anno 2016;
- Reperforming tariffa RCA con l'utilizzo dei modelli GLM in ambiente R;

Analisi di Mercato

Studio statistico del Mercato Danni Italiano dal 1998 al 2016 con elaborazione dei dati ANIA-Infobila (periodicità annuale).

COMPETENZE PERSONALI

LINGUA MADRE Italiano

ALTRE LINGUE

	COMPRESIONE		PARLATO		PRODUZIONE SCRITTA
	ASCOLTO	LETTURA	INTERAZIONE	PRODUZIONE ORALE	
Inglese	B2	B2	B2	B2	B2

INFORMAZIONI AGGIUNTIVE

PRESENTAZIONI E PUBBLICAZIONI

OTTOBRE 2014

SIFA - Corso FAC di Formazione Attuariale Permanente n°2 del 2014

Titolo: *Moduli di Vigilanza e principali Indicatori Tecnici dei Rami Danni*

Codocenza - Intervento all'interno del corso sugli indicatori di variabilità del mercato danni basati sul Loss Ratio con presentazione dei risultati di specifiche elaborazioni sul database ANIA di mercato.

SETTEMBRE 2016

AMASES XL - 2016

40th Annual Meeting of the Italian Association for Mathematics Applied to Economic and Social Sciences

Titolo: *Mixed Effects in Premium Rating: A comparison between GLMM and GLM.*

Presentazione di uno studio comparativo in ambito pricing non-life tra i classici modelli GLM e la loro estensione con l'introduzione del Mixed Effect.

GENNAIO 2018

Tesi di Dottorato - Tecnica Attuariale delle Assicurazioni contro i Danni

Titolo: *Un modello di riservazione individuale multistato a tempo discreto.*

Edizioni Accademiche italiane - ISIN 978-620-2-08540-3

COMPETENZE INFORMATICHE

Conoscenza avanzata di Excel, Word PPT, R

Conoscenza media di MATLAB, STATA

Conoscenza base di SAS, C++

Principali applicazioni utilizzate e/o implementate: Costruzione di tool per la valutazione delle riserve sinistri con i metodi deterministici e stocastici. Metodologie di stima del rischio di tariffazione e riservazione con i metodi USP e con Internal Model. Script per la valutazione di trattati riassicurativi e relative strategie. Tecniche di simulazione Monte-carlo per la valutazione di opzioni implicite per polizze rivalutabili, calcolo premi e riserve rami vita, analisi e quadrature su database rischi e sinistri, stima coefficienti personalizzazione tariffa R.C. Auto con modelli GLM-GAM.