

MARCO PIRRAmarco.pirra@unical.it**ATTIVITA' ACCADEMICA****2008 – oggi****Università della Calabria**

Ricercatore universitario confermato per il settore scientifico-disciplinare "SECS-S/06 – *Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie*" presso il Dipartimento di Economia, Statistica e Finanza dell'Università della Calabria.

Ambiti di ricerca: analisi della solvibilità delle compagnie assicurative, modelli interni per la valutazione dei rischi assicurativi, metodologie stocastiche di valutazione delle riserve tecniche.

Docente titolare dei corsi di *Matematica Attuariale 1*, *Matematica Attuariale 2*, *Matematica Finanziaria*.

2012 – 2014**LUISS Business School, Roma**

Docente del corso "Quantitative methods for Finance" nell'ambito del programma MBA e del corso "Basics of financial modeling" per il Master in Corporate Finance.

2007 – 2008**LUISS Guido Carli, Roma**

Assegnista di ricerca (assegno quadriennale) nell'area scientifico-disciplinare quantitativa con titolo del progetto di ricerca *Modelli matematici attuariali per l'analisi della solvibilità delle compagnie assicurative*.

2006 – 2008**Università degli Studi del Sannio, Benevento**

Docente titolare dei corsi di *Teoria del rischio per le assicurazioni contro i danni* e di *Economia e finanza delle imprese di assicurazione*.

2007 – 2008**LUISS Guido Carli, Roma**

Docente corsi integrativi *Matematica Finanziaria* e *Matematica Finanziaria Corso Progredito*.

2007**Università "La Sapienza", Roma**

Cultore della materia presso la cattedra di *Matematica Generale*, Facoltà di Economia, sede di Latina.

2006**Casualty Actuarial Society**

Membro del "Research Working Party on the Loss Development Simulation Model".

ALTRE ATTIVITA'

- 2012 – oggi** **Istituto Italiano degli Attuari**, Roma
Segretario Generale, nominato a seguito di elezione nel Consiglio Direttivo, febbraio 2012.
Membro del Group Consultatif Actuariel Europeen Rappresentante IIA Education Committee.
- 2008 – oggi** **Ordine Nazionale degli Attuari**
Membro della Commissione Formazione e del Comitato Solvency II.
- Gennaio 2004** **Ordine Nazionale degli Attuari**
Abilitazione all'esercizio della professione in seguito al superamento dell'Esame di Stato, sessione novembre 2003.

FORMAZIONE

- 2007** **ISVAP**, Roma
Vincitore del concorso per il perfezionamento all'estero degli studi in materia assicurativa.
- 2003-2006** **Università "La Sapienza"**, Roma
Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali
Tesi di dottorato *"Riassicurazione e rischi non indipendenti: un modello multivariato per il pricing di coperture di rischi aggregati"*.
Coordinatore: Prof. Fabio Grasso, Tutor Scientifico: Prof. Riccardo Ottaviani.
- Ottobre 2003** **Università "La Sapienza"**, Roma
Vincitore con borsa di studio del concorso di Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali.
- 1999-2003** **Università "La Sapienza"**, Roma
Luglio 2003
Laurea in Scienze Statistiche ed Attuariali, votazione 110 e lode.
Tesi di laurea *"La reazione del mercato alla liberalizzazione delle tariffe R.C.Auto"*. Relatore: Prof. Riccardo Ottaviani.
- 1999-2003** **Laureati Federazione Nazionale Cavalieri del Lavoro**, Roma
Medaglia d'oro Laureati conseguita dopo aver trascorso il percorso formativo universitario (vincitore di borsa di studio della Federazione) nel Collegio Universitario "Lamaro-Pozzani", Roma, superando con esito positivo corsi annuali di lingue, diritto ed economia con relativo esame interno.
- 1994-1999** **Liceo Ginnasio Statale "G.B. Gandino"**, Bra (CN)
Diploma di maturità classica.

ALTRO

Socio dell'Associazione per la Matematica Applicata alle Scienze Economiche e Sociali.
Socio del Groupe Consultatif Actuariel Europeen.
Socio dell'Associazione Internazionale degli Attuari

PUBBLICAZIONI

- [2013] "Risk Management and Capital Allocation for Non-Life Insurance Companies", with S.Forte and M.Ialenti, *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance* - Springer. DOI: 10.1007/978-3-319-02499-8.
- [2013] "La valutazione dell'aliquota contributiva in funzione di un determinato tasso di sostituzione", con S.Forte e M. Ialenti, *Atti del Convegno Strumenti Innovativi del calcolo attuariale per la valutazione e la gestione dei fondi pensione*.
- [2013] "Un modello per la valutazione dell'aliquota di contribuzione ad un fondo di previdenza", con S. Forte e M. Ialenti, Carocci editore S.p.A., Roma, ISBN 978-88-430-6986-6.
- [2012] "Risk Dependencies and Capital Allocation" - 1st European Actuarial Journal Conference, Lausanne.
- [2012] "Claims reserving uncertainty in the development of internal risk models" (with S.Forte and M.Ialenti), *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Springer.
- [2011] "Implementing a Solvency II internal model: Bayesian stochastic reserving and parameter estimation" (with S.Forte and M.Ialenti). 15th IME Congress in Trieste, 2011. 40th International ASTIN Colloquium, Madrid.
- [2010] "Implementing a Solvency II internal model in the QIS5 framework" (with S.Forte and M.Ialenti) - XXXIV AMASES Congress, Macerata.
- [2010] "A reserve risk model for a non-life insurance company" (with S.Forte and M.Ialenti) *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, ISBN/ISSN: 978-88-470-1480-0.
- [2010] "The Solvency Capital Requirement for a Long-Term Care Insurance Annuity" (with S.Forte and M.Ialenti) -XVII Risk Theory Congress.
- [2009] "Bayesian internal models for the reserve risk assessment" (with S.Forte and M.Ialenti) - Italian Institute of Actuaries Journal, Volume LXXI, Roma.
- [2008] "A Bayesian internal model for the evaluation of reserve risk of a non life insurance company" (with S.Forte and M.Ialenti) - X Italian-Spanish Congress of Financial and Actuarial Mathematics.
- [2008] "Un modello interno per la valutazione del rischio di riservazione di una compagnia danni: il Fisher-Lange bayesiano" (with S.Forte and M.Ialenti) - XV Risk Theory Congress.
- [2008] "Un modello bayesiano di tipo Fisher-Lange per la determinazione del rischio di riservazione di una Compagnia Danni" (with S.Forte and M.Ialenti) - XXXII AMASES Congress, Trento.
- [2008] "A reserve risk model for a non-life insurance company" (with S.Forte and M.Ialenti) - *Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance*, Venice, available at <http://maf2008.unive.it/viewabstract.php?id=47>.
- [2007] "Effetti della dipendenza tra i rami nella valutazione market consistent delle passività tecniche danni" (with S.Forte and M.Ialenti) - XXXI AMASES Congress, Lecce, available at <http://www.sms.dsems.unile.it/amases2007/abstracts/f050.pdf>.
- [2007] "Fair Value delle passività tecniche danni: possibili soluzioni" (with S.Forte and M.Ialenti) - XXXI AMASES Congress, Lecce, available at <http://www.sms.dsems.unile.it/amases2007/abstracts/f052.pdf>.
- [2007] "Una proposta di valutazione al fair value delle passività tecniche danni" (with S.Forte and M.Ialenti) - VIII National Congress of Actuaries - Trieste.
- [2007] "Effetti della variabilità del parametro di dipendenza sulla riassicurazione di rischi non indipendenti" (with S.Forte) - Working Paper, Department of Actuarial Sciences, Roma.
- [2007] "Un modello multivariato per la determinazione dell'esborso atteso del riassicuratore" - XIV Risk Theory Congress, Aracne Editions.
- [2007] "Una proposta di valutazione market consistent delle passività tecniche danni" (with S.Forte and M.Ialenti) -XIV Risk Theory Congress, Aracne Editions.
- [2007] "Riassicurazione e rischi non indipendenti: un modello multivariato per il pricing di coperture di rischi aggregati" - PADIS, Roma.
- [2006] "Effetti sulla riassicurazione della dipendenza tra sinistri con danno a cose e sinistri

con danno a persone" (with S.Forte) – Working Paper n. 29, Department of Actuarial Sciences, Roma, XIII Risk Theory Congress (Aracne Editions), XXX AMASES Congress, Trieste.

[2005] "Sul risarcimento del riassicuratore nel trattato stop-loss in caso di rischi non indipendenti" (with S.Forte) – XII Risk Theory Congress, Aracne Editions.

[2004] "Gli effetti di un sistema di rilevazione della frode centralizzato" – XI Risk Theory Congress, Aracne Editions.

Autorizzo il trattamento dei miei dati ai sensi della legge 31 dicembre 1996, n. 675.