

Residenza:

Via Leoncavallo, 26
04100 Latina (LT).
Cell.: 345 - 3505297

Università:

Via P. Bucci, Cubo 3C
87036 Arcavacata di Rende (CS)
Tel.: 0984492350
Fax: 0984492277
Email: cerchiara@unical.it
Email privata: rocco.cerchiara@gmail.com



Rocco Roberto Cerchiara

Dati personali

Data di nascita: 22/09/1971

Luogo di nascita: Boeblingen (Germania ex R.F.T.)

Residenza: Via Leoncavallo, 26 – 04100, Latina (LT)

Stato civile: Sposato.

Istruzione

Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali, conseguito presso l'Università degli studi "La Sapienza" di Roma, in data 20/03/2006.

Tesi di dottorato: "*Metodo simulativo, Fast Fourier Transform ed Extreme Value Theory per l'analisi del costo sinistri aggregato nelle assicurazioni danni*", tutor: Prof. Nino Savelli.

Laurea in Scienze Statistiche ed Attuariali (vecchio ordinamento) conseguita presso l'Università degli studi "La Sapienza" di Roma, in data 13/07/1999, con voto 110/110 e lode. Tesi di laurea svolta in Matematica Attuariale dal titolo "*Aspetti di Teoria del Rischio nell'ambito della Riassicurazione Vita*", relatore: Prof. Riccardo Ottaviani.

Diploma di Perito Tecnico Informatico, conseguito nel 1991, presso l'I.T.I.S. "G. Galilei" di Latina (Lt), con voto 54/60.

Occupazione Attuale *Università*

Dal 01 febbraio 2005: Ricercatore confermato nel settore SEC-S/06 (settore concorsuale 13/D4- **Metodi Matematici dell'Economia e delle Scienze Attuariali e Finanziarie**) presso il Dipartimento di Scienze Economiche, Statistiche e Finanziarie dell'**Università della Calabria** (Arcavacata di Rende-Cosenza).

Principali temi di ricerca: modelli di teoria del rischio per l'analisi delle passività e la tariffazione delle Assicurazioni Danni e Vita; le riserve sinistri, valutazione di portafogli assicurativi e di Fondi Pensione.

Partecipazione a diversi progetti di ricerca, tra cui PRIN e il progetto ministeriale "Paysat" con l'obiettivo di Sviluppi Metodologici ed Applicazioni della Funzione Copula in ambito di Assicurazioni RCA.

Attività Professionale

Dal 30 novembre 2007, attività di ricerca e professionale anche in collaborazione con Towers Watson (ex Watson Wyatt) in tema di:

- review del modello interno non-life di un importante gruppo assicurativo italiano (4 anni)
- sviluppo di modelli di riservazione, tariffazione e capital modelling ai fini di Solvency II per assicurazioni danni
- supporto nella compilazione del QIS5 per compagnie italiane e UK
- supporto alla Funzione Attuariale di importanti gruppi assicurativi italiani
- litigation support in qualità di CTP in merito a controversie di compagnie danni con il supervisor in tema di tariffazione e riservazione
- Progetti di Merger & Acquisition
- organizzazione di eventi relativi al Capital Modelling
- supporto occasionale a progetti relativi ad assicurazioni vita.

Tra le diverse progettualità seguite, si segnala inoltre lo studio congiunto con l'ANIA e 18 compagnie di assicurazione italiane in merito all'analisi di mercato degli undertaking specific parameters in ambito Solvency II.

Le attività su indicate sono state seguite dal sottoscritto sempre sia in termini operativi che di project manager.

Dal 2012 al 2015, **Attuario Incaricato RCA** di due compagnie danni italiane.

Esperienze

professionali

precedenti

Società

Studio Attuariale Savelli da febbraio 2004 al 31 dicembre 2007, dove sono state condotte una serie di attività a livello nazionale ed internazionale relative principalmente a:

- Supporto all'attuario revisore per l'audit delle riserve tecniche per compagnie di assicurazione vita e danni
- CTU in relazione a controversie in tema previdenziale
- Progetti di Merger & Acquisition
- Privatizzazione di una Compagnia di assicurazione albanese "INSIG"
- Calcolo del Fondo di Trattamento di Fine Rapporto secondo i principi contabili internazionali (IAS)
- Valutazione della congruità di piani di ammortamento e strumenti finanziari.

Società

Arthur Andersen MBA S.r.l. (successivamente Deloitte Business Consulting S.r.l.) da febbraio 2000 al 31 dicembre 2003. Attività svolte:

Sviluppo di modelli di valutazione di Portafogli di Compagnie Vita (Embedded Value), analisi di congruità e calcolo delle riserve matematiche (Vita) e delle riserve sinistri (RCA e RCG), comfort letter o opinion in merito a stime dell'Embedded Value effettuate da altre società di consulenza, calcolo del TFR in base a quanto previsto dal principio contabile-IAS 19, ricerca nel campo attuariale con particolare attenzione alla Teoria del Rischio, il Capital at Risk e retention analysis; svolti anche alcuni progetti o di Credit Risk Management per le Banche. Corsi seguiti durante l'attività professionale:

- Business Audit Immersion (accounting training) effettuato a Segovia (Spagna) ed in Italia per un totale di cinque settimane.
- Programmazione in Matlab, tenuti dalla Società Teoresi di Torino.

Società

Assi.Re.Cre. S.r.l. da settembre 1999 a dicembre 1999. Attività svolte:

- Assistenza alla direzione in tema di Consulenza e tariffazione in tema di Fondi Sanitari Integrativi.
- Analisi e statistiche periodiche sull'andamento dei sinistri del ramo RCA dei clienti.

Publicazioni e

Presentazioni a

Convegni

- 1) "Un primo approccio verso la definizione della relazione tra pricing e solvibilità del ramo RCA", Rapporto Scientifico AMASES n° 22, 2003, Cagliari.
- 2) "Extreme value theory: the choice of threshold for rating and reinsurance", Quaderno del Dipartimento di Scienze Attuariali dell'Università "La Sapienza", 2004, Roma. Coautrice: Giorgia Esposito. Tale contributo è stato presentato anche al convegno "New Mathematical Methods in Risk Theory", Poster Session, Workshop in onore di Hans Bühlmann, Firenze, 6-8 Ottobre 2005.
- 3) "Bonus Malus and No Claim Discount Systems: effects on the solvency of a non life insurance company". Presentato al Convegno MAF 2004 a Fisciano e pubblicato tra gli Atti del XII Convegno di Teoria del Rischio presso l'Università degli Studi del Molise 2005, Campobasso.
- 4) "The Extreme Value Theory and the Risk Reserve in non life insurance companies", presentato al convegno AMASES del 2004 e pubblicato negli Annali n° 11 della Facoltà di Economia dell'Università del Sannio, 2005, Benevento.
- 5) "Extreme value theory: the choice of threshold for rating and reinsurance", Atti del Convegno New Mathematical Methods in Risk Theory, Workshop in honours of Hans Bühlmann, Firenze, Ottobre 6-8, 2005
- 6) "The calculation of Aggregate Loss distribution in Motor Third Party Liability insurance: Simulation or Fast Fourier Transform?", 10° International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Leuven, Belgio, Luglio 2006 e pubblicato negli Annali n° 12 della Facoltà di Economia dell'Università del Sannio, 2006, Benevento.
- 7) "Aggregate Loss Distributions and Risk Measures for Non-life Insurance", 10th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Leuven, Belgio, Luglio 2006.
- 8) "Fast Fourier Transform, Extreme Value Theory and Simulation Approach To Modelling Dependence between Normal and Large Claims for Non Life Insurance Company", Atti del II Convegno Metodi Matematici e Statistici per l'Analisi dei dati Assicurativi e Finanziari, Fisciano (SA) – Facoltà di Economia, Ottobre 2006.
- 9) "Il calcolo della distribuzione del danno aggregato nell'assicurazione RCA. Simulazione o Fast Fourier Transform?". Annali della Facoltà di Economia di Benevento, Vol. 12, pp. 165-193. Parte di Libro. ISBN: 0707046070. Napoli. ESI.
- 10) "FFT, Extreme Value Theory and Simulation to model non life insurance claims dependences". Mathematical and Statistical Methods for Insurance and Finance, pp. 61-65. Parte di Libro. ISBN: 9788847007031. DOI: 10.1007/978-88-470-0704-8. Milano. Springer.
- 11) "An overview on Fast Fourier Transform for Aggregate Losses and Stochastic Loss Reserves". Proceedings of Insurance Mathematics Economics 2007. Università del Pireo - Grecia. 10-12 luglio 2007.
- 12) "La Fast Fourier Transform nel calcolo della Riserva Sinistri". Atti dell'VIII Congresso Nazionale degli Attuari. Trieste, 19-21 Settembre 2007. Parte di Libro. Pubblicazione sottoposta ed approvata da un referee anonimo.
- 13) "Fast Fourier Transform for Capital Requirement Calculation under Solvency II Project". III Convegno MAF - Metodi Matematici e Statistici per l'Analisi dei dati Assicurativi e Finanziari presso l'Università di Venezia, 26-28 marzo 2008.

Publicazioni e

Presentazioni a

Convegni

14) "An analysis on the underwriting cycle of non-life insurance companies". XXXII Convegno AMASES. Trento. Coautore: Fabio Lamantia

15) "Generalized Linear Models in life insurance: Decrements and risk factor analysis under Solvency II". Presentato al 18° AFIR Colloquium. Roma, 1-3 Ottobre 2008 e in corso di pubblicazione sul Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari.

16) "Non-life insurance risk". Pubblicato sul Quaderno AIAF n.139 "Solvency II e l'analisi finanziaria delle assicurazioni" – Ottobre 2008. Milano.

17) "An analysis of the underwriting cycle for non-life insurance companies". Actuarial and Financial Mathematics Conference. Brussels. Febbraio 2009.

18) "A dynamic analysis of the underwriting cycle in non-life insurance". Atti del convegno "ASTIN 2009", Helsinki - Finlandia, 1-4 giugno, 2009. Coautore: Lamantia F.

19) "Multivariate analyses to modelling lapse risk capital charge under Solvency II". Atti del convegno "AFIR LIFE 2009", Munich, Germania. Coautori: Gambini A. Edwards M.

20) "Generalized Linear Models in Life Insurance: Decrements and Risk factor analysis under Solvency II". Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari, 2009, pp. 100-122. . Coautori: Gambini A. , Edwards M.

21) "Solvency 2: an analysis of the underwriting cycle with piecewise linear dynamical systems". AENORM, Utrecht: VSP, 2009, AENORM V. 17, Edition 64, pp. 56-60. Coautore: Lamantia F.

22) "Piecewise Linear Dynamic Systems and Risk Theory for solvency and profitability analysis of non-life insurance companies". Atti dell'International Congress of Actuaries, South Africa, 7-12 Marzo 2010. Coautore: Lamantia F.

23) "Piecewise Linear Dynamic Systems for Own Risk Solvency Assessment". Atti del convegno MAF 2010, Ravello. Coautore: Lamantia F.

24) "Approccio quantitativo alla gestione dei Rischi Operativi". Quaderni, AIAF 2010, pp. 26-33.

25) "Model risk and hindcast testing in claim reserving". AMASES, PISA, 2011.

26) "Piecewise Linear Dynamic Systems for Own Risk Solvency Assessment". In Mathematical and Statistical Methods in Insurance and Finance, Springer, 2012, pp. 87-95. Parte di libro: ISBN 978-88-470-2342-0. Coautore: Lamantia F.

27) "The Estimation of Standard Deviation of Premium Risk Under Solvency 2". In: Cira Perna/Marilena Sibillo. (a cura di): Cira Perna/Marilena Sibillo, Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance. p. 61-64, 2014. DORDRECHT-HEIDELBERG-NEW YORK: Springer, ISBN: 978-3-319-05014-0. Coautore: Magatti V.

28) "Undertaking Specific Parameters or a Partial Internal Model under Solvency 2?". In: Casualty Actuarial Society. (a cura di): Casualty Actuarial Society, Proceedings of International Congress of Actuaries 2014. Coautore: Magatti V.

29) "Undertaking specific parameters under solvency II: reduction of capital requirement or not?" European Actuarial Journal, 6(2), 351-376, 2016. DOI: 10.1007/s13385-016-0139-6. Coautore: Demarco V.

30) "Non Life Reserving Practices". Pubblicazione nell'ambito dell'Astin Working Party. Sezione relativa al mercato Italiano. Dicembre 2016

Attività di docenza

Cultore della materia di Teoria del Rischio nelle assicurazioni Danni presso l'Università del Sannio di Benevento, in collaborazione con il Prof. Savelli negli anni accademici 2002-2003 e 2003-2004.

Titolarità dell'insegnamento di **Teoria del Rischio nelle assicurazioni Danni** presso l'Università del Sannio di Benevento negli anni accademici 2004-2005 e 2005-2006.

Corsi ANAP organizzati dalla Regione Sardegna in relazione alle tecniche attuariali per i rami assicurativi Infortuni e Malattia (2005).

Docenza ai **Master: a)** ARMA presso l'Università La Sapienza di Roma, Facoltà di Economia in relazione ad "un modello di teoria del rischio per le assicurazioni vita"; **b)** IPE - Napoli.

Docenza alla **Scuola di Attuariato** – Modulo "**Bilancio e Financial Reporting delle imprese di assicurazione**", presso l'Università di Firenze dal 201

Titolarità dell'insegnamento di **Matematica Finanziaria** nel corso di laurea di Economia Aziendale della Facoltà di Economia dell'Università della Calabria. Anni accademici 2005-2006, 2006-2007, 2007-2008 e 2008-2009

Titolarità dell'insegnamento di **Tecnica Attuariale Danni + Vita - Moduli 1 e 2** nel corso di laurea di Scienze Statistiche della Facoltà di Economia dell'Università della Calabria. Anno accademico 2005-2006.

Titolarità dell'insegnamento di **Matematica Attuariale - Moduli 1 e 2 e Teoria del Rischio Assicurativo** nel corso di laurea di Scienze Statistiche della Facoltà di Economia dell'Università della Calabria dall'a.a. 2006-2007.

Titolarità del corso di **Bilancio contabile e financial reporting dell'impresa di assicurazione** (4 crediti), del corso di Laurea di Scienze Attuariali e Finanziarie, Facoltà di Scienze Statistiche, Università "La Sapienza" di Roma nell'anno accademico 2007-2008.

Titolarità dei corsi di **Teoria del Rischio, Matematica Attuariale e Tecnica Attuariale Danni** presso il Dipartimento di Economia Statistica e Finanza dell'Università della Calabria nel periodo 2009-2016.

Assistenza al Prof. Savelli N. al corso di **Matematica Finanziaria** presso l'Università LUISS Guido Carli - Dipartimento di Impresa e Management nell'anno accademico nell'a.a. 2016-2017

Contratto Integrativo di docenza al corso di Matematica Finanziaria – canale E - presso l'Università LUISS Guido Carli - Dipartimento di Impresa e Management nell'anno accademico 2017-2018

Titolarità dei corsi in lingua inglese di Risk Theory e Non-Life Insurance Mathematics nel corso di laurea magistrale Finance and Insurance presso il Dipartimento di Economia Statistica e Finanza dell'Università della Calabria dall'a.a. 2017-2018

Conoscenze informatiche

Ambienti : DOS, Windows, SQL server, Unix (rudimenti).

Fogli elettronici: Excel, Lotus 1-2-3.

Programmi: Word Processing, Access, Turbo Pascal, MATLAB, Mic. Flowcharter, Power Point, Visual Basic, Visual Basic for application, Erwin, Outlook, R.

Internet: INTERNET EXPLORER.

Programmi di rete: LOTUS NOTES

- Lingue straniere** Buona conoscenza della lingua Inglese scritta e parlata appresa attraverso corsi intensivi aziendali, presso “The Shenker Institute” di Latina ed in relazione alle esperienze lavorative maturate all'estero.
- Posizione militare** Assolto: dal 16 febbraio 1998 al 11 dicembre 1998. Arma: Marina Militare presso il Ministero della Marina Mercantile di Roma
- Iscrizione ad albi ed associazioni** Iscritto da gennaio 2000 all'**Albo Nazionale degli Attuari**, tenuto dall'Ordine Nazionale degli Attuari, con sede unica in Via delle Milizie, 1 – 00192 Roma. Matricola N° 1120.
Socio dell'**Istituto Italiano degli Attuari** dal 2000.
Membro del Consiglio Direttivo dell'**Istituto Italiano degli Attuari** dal 2016.
Socio **AMASES** dal 2003.
Socio **AIAF** dal 2013.
Membro della Commissione Nazionale Formazione Attuariale dal 28 gennaio 2008. In tale ambito è il coordinatore del “marketing attuariale” nelle Università
Membro dei Gruppi di Lavoro “CTU nei Tribunali” e “Solvency 2” presso l'Ordine Nazionale.

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali ai sensi del Decreto Legislativo 30 giugno 2003, n. 196 "Codice in materia di protezione dei dati personali".