





CURRICULUM VITAE NINO SAVELLI

RECAPITI STUDIO

-  Viale Regina Margherita, 262 - 00198 Roma
-  +39 06 98373365
-  n.savelli@deangelis-savelli.it
-  www.deangelis-savelli.it

RECAPITI UNIVERSITA'

-  Università Cattolica del Sacro Cuore
Facoltà di Scienze Bancarie, Finanziarie ed Assicurative
Largo Gemelli, 1 - 20123 Milano
-  n.savelli@unicatt.it

ATTIVITÀ ACCADEMICA

- Laureato in Scienze Statistiche ed Attuariali presso la Facoltà di Statistica dell'Università degli Studi di Roma "La Sapienza" nel luglio 1983 con voti 110/110 e lode discutendo una tesi dal titolo "Condizioni di solvibilità di una compagnia di assicurazione: strategie operative", relatore il prof. Francesco Cetta;
- Superamento nel novembre 1983 dell'Esame di Stato per l'abilitazione alla professione di Attuario;
- Vincitore nel novembre 1983 del concorso pubblico per l'ottenimento di una borsa di studio dell'ISVAP - IVASS per la partecipazione ad un corso professionale semestrale sulle assicurazioni a seguito del quale partecipa al suddetto corso organizzato dall'ISVAP - IVASS e tenuto a Roma presso l'Università degli Studi di Roma "La Sapienza" nel periodo gennaio-giugno 1984. Nel gennaio 1985 risulta vincitore del concorso pubblico indetto dall'ISVAP - IVASS per l'assunzione di n. 29 vice-capo ufficio nella carriera direttiva del Servizio Ispettivo dell'ISVAP;
- Dal 1° marzo 1985 al 30 giugno 1996 ha prestato servizio nel Servizio Ispettivo dell'ISVAP - IVASS fino a ricoprire il ruolo di funzionario dal dicembre 1992;
- Vincitore nel settembre 1988 di una borsa di studio della "Fondazione Mario Gasbarri - Alleanza Assicurazioni" per lo svolgimento di un periodo di ricerca all'estero nell'ambito delle materie assicurative;
- Svolgimento di attività di ricerca per una durata di 18 mesi circa svolta negli anni 1989-91 ad Helsinki, in collaborazione con il Prof. Teivo Pentikainen ed il Dott. Jukka Rantala, sul tema "La solvibilità delle compagnie di assicurazione sulla vita" presso l'Università di Helsinki ed il gruppo assicurativo finlandese Pohjola. Nel corso di tale periodo di ricerca ha partecipato attivamente in qualità di segretario tecnico al Working Group istituito dal Governo Finlandese presieduto dal Direttore della Autorità Finlandese di Vigilanza sulle Assicurazioni Dott. Rantala, avente quale oggetto lo studio e la definizione dei requisiti minimi di solvibilità per le compagnie vita in Finlandia tramite modelli stocastici di natura tecnico-attuariale;

- Negli anni 1989-92 ha frequentato il Dottorato di Ricerca in Scienze Attuariali presso l'Università di Roma "La Sapienza" conseguendo il titolo finale di Dottore di Ricerca in Scienze Attuariali nel maggio 1992 con una discussione della Tesi dal titolo "La valutazione della solvibilità di una impresa di assicurazioni sulla vita: una metodologia di analisi stocastica", relatore il prof. Massimo De Felice;
- Nel giugno 1992 ha conseguito il Premio finale della "Fondazione Mario Gasbarri – Alleanza Assicurazioni" per la Relazione finale inerente l'attività di ricerca svolta in Finlandia negli anni 1989-91, i cui risultati sono stati pubblicati nel 1993 in un libro finanziato dall'Associazione per lo Sviluppo e lo Studio delle Assicurazioni presieduto dal dott. Alfonso Desiata, dal titolo "Un modello di Teoria del rischio per la valutazione della solvibilità di una compagnia di assicurazioni sulla vita" Edizioni LINT;
- Dall'a.a. 1994-95 all'a.a. 2000-2001 è professore a contratto di Teoria del rischio presso la Facoltà di Scienze Bancarie, Finanziarie e Assicurative dell'Università Cattolica di Milano. Presso la stessa Università dall'a.a. 1997-98 all'a.a. 2000-2001 riceve altresì l'incarico di professore a contratto di Economia e tecnica dei sistemi previdenziali;
- A seguito della vincita nel 1998 del concorso nazionale per professore associato di ruolo, dal 1° novembre 1998 è Professore associato di Teoria del Rischio presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi del Molise (dall'a.a. 2000-2001 è Professore associato di ruolo di Matematica Finanziaria presso la stessa Facoltà). Negli stessi anni svolge anche il corso di Matematica Generale;
- A seguito del trasferimento dall'Università degli Studi del Molise, dal 1° novembre 2001 prende servizio presso la Facoltà di Scienze Bancarie, Finanziarie e Assicurative dell'Università Cattolica di Milano quale professore associato di ruolo di Teoria del Rischio. Negli stessi anni è anche titolare presso la stessa Università degli insegnamenti di Tecnica Attuariale delle Assicurazioni Sociali e di Modelli matematici dei mercati finanziari.
- Dal 2002 al 2004 riceve l'incarico di professore a contratto di Teoria del Rischio presso la Facoltà di Economia dell'Università degli Studi del Sannio con sede a Benevento;
- Dal novembre 2002 al marzo 2003 è visiting professor presso la Cass Business School della City University di Londra, dove svolge attività di ricerca sul tema della solvibilità nelle assicurazioni danni in collaborazione con il prof. Steven Haberman;
- Dal 2004 al 2009 riceve l'incarico di professore a contratto di Economia e Tecnica degli Intermediari Finanziari ed Assicurativi presso la LUMSA (Libera Università Maria Santissima Assunta) con sede a Roma;
- Dal 1° marzo 2006 è nominato professore straordinario di ruolo per l'insegnamento di Teoria del Rischio presso la Facoltà di Scienze Bancarie, Finanziarie e Assicurative dell'Università Cattolica di Milano, a seguito dell'idoneità di professore di prima fascia conseguita nel Novembre 2004 a seguito di concorso nazionale;
- Dal 2009 Visiting Faculty, MIB Trieste School of Management, docente di Corsi al Master in Insurance and Risk Management, ERM/Solvency II e Non-life Underwriting Risk.
- Dal 1° marzo 2009 all'attualità è professore ordinario di ruolo per l'insegnamento di Teoria del Rischio, presso la Facoltà di Scienze Bancarie, Finanziarie e Assicurative dell'Università Cattolica di Milano a seguito dell'ottenimento del giudizio di conferma a professore di prima fascia emesso dalla apposita Commissione nazionale. Negli stessi anni è anche titolare presso la stessa Università degli insegnamenti di Matematica Attuariale, Tecnica Attuariale delle Assicurazioni Danni e Tecnica Attuariale delle Assicurazioni Sociali;
- Dal 2011 al 2012 riceve l'incarico di professore a contratto di Mathematics Finance presso la Facoltà di Economia della LUISS-Guido Carli di Roma;
- Dal 2013 al 2016 è stato nominato dal Supervisory Board dell'EIOPA (European Insurance and Occupational Pensions Authority) membro dell'IRSG (Insurance & Reinsurance Stakeholder Group) istituito presso la sede di Francoforte della stessa EIOPA in qualità di "academic".
- Nel luglio 2014 è stato nominato dalla Città del Vaticano membro del Comitato Tecnico per il Fondo Pensione del Vaticano, in qualità di esperto
- Nel marzo 2016 è stato socio co-fondatore dello Studio Attuariale De Angelis – Savelli e Associati.

- Nel marzo 2016 è stato nominato dal Sommo Pontefice Presidente del Fondo Pensioni Vaticano.
- A partire dall'a.a. 2016-17 è professore a contratto di Matematica Finanziaria presso la LUISS con sede a Roma.
- Nel maggio 2018 è stato nominato dal Rettore dell'Università Cattolica del Sacro Cuore, membro del Comitato direttivo del Centro di Ricerca "Enterprise Risk Lab (ERIL)" costituito con l'ANRA e le maggiori Società specializzate in Risk Management

- Docente su tematiche delle scienze attuariali di vari Master sulle Scienze Assicurative presso la LUISS-Guido Carli di Roma (anni 1993-1996), l'Università Commerciale L. Bocconi di Milano (anni 2000-2002), l'Università Cattolica e CETIF dal 2004-2012), l'Università di Roma La Sapienza (2005-2009) e la MIB School of Management di Trieste (MIRM e EMIF dal 2009).
- Ha partecipato in qualità di relatore a varie iniziative inerenti il progetto Solvency II con ISVAP - IVASS, ANIA, CEA e CEIOPS/EIOPA.
- Docente di vari Corsi di aggiornamento e seminari organizzati da Istituto Italiano degli Attuari, Ordine Nazionale degli Attuari, SIFA, ISVAP - IVASS, ANIA/IRSA, AIBA e da varie compagnie di assicurazione, con particolare riferimento al tema della valutazione delle riserve tecniche, del progetto Solvency II e dei modelli per la valutazione del rischio di underwriting.
- Autore di pubblicazioni scientifiche su varie tematiche delle scienze attuariali, con particolare riferimento al tema della solvibilità delle compagnie di assicurazione e dei fondi pensione e sui modelli interni per la valutazione del rischio di underwriting (life e non-life).

ATTIVITÀ PROFESSIONALE

- Dal 1999, quale titolare dell'omonimo Studio Attuariale Savelli, e dal 2016, quale socio co-fondatore dello Studio Attuariale De Angelis-Savelli e Associati, svolge l'attività professionale attuariale. Svolge la consulenza attuariale su varie tematiche di natura attuariale, tra cui:
 - Valutazione Riserve Sinistri mediante modelli deterministici e stocastici;
 - Analisi e determinazione tariffe dei rami R.C. Auto e degli altri rami danni;
 - Valutazione di Portafogli Vita e Danni;
 - Modelli stocastici per la predisposizione di strategie riassicurative e/o piani di riassicurazione;
 - Analisi stocastiche per Internal Model, Solvency II ed Enterprise Risk Management;
 - Risk-Based Capital e Capital Allocation;
 - Valutazione Riserve Matematiche mediante modelli deterministici e stocastici;
 - Analisi Fondi Pensione e Fondi Sanitari;
 - Valutazioni TFR ex IAS 19;
 - Attività di revisione e consulenza tecnico-gestionale.

Tematiche di particolare sviluppo metodologico nel settore delle Assicurazioni Danni da parte dello Studio sono:

1. sviluppo di metodologie deterministiche e stocastiche per la valutazione delle riserve sinistri;
2. modelli stocastici per la valutazione del Premium Risk nell'ambito della stima del Non-Life Underwriting Risk tramite Collective Risk Models;
3. analisi di tecniche di bootstrapping per la stima del Reserve Risk;
4. modelli per la quantificazione dell'impatto della riassicurazione sulla stima del Premium Risk e del Reserve Risk e predisposizione di piani riassicurativi mediante analisi di trade-off rischio/rendimento.
5. applicazioni nel campo assicurativo danni per tematiche di pricing e reserving tramite l'utilizzo di GLM (Generalised Linear Models);
6. analisi del fitting dei dati mediante tecniche statistiche di tipo MLE e MDA per la stima della severity dei principali rami danni;

7. Analisi, sviluppo metodologico e assistenza tecnica delle imprese per l'utilizzo degli Undertaking Specific Approach (USP) per la stima del Premium Risk e/o reserve Risk nell'ambito Solvency II nell'ambito del relativo iter di autorizzazione da parte dell'Autorità di Vigilanza.

In merito a tali tematiche lo Studio ha acquisito un forte riconoscimento sul mercato, anche mediante la presenza dello scrivente ad importanti iniziative di formazione attuariale (da parte di Università, ANIA, ISVAP - IVASS, Ordine Attuari) e di convegni di natura scientifica a livello nazionale ed internazionale (v. ad es. International ASTIN Colloquia e International Congress of Actuaries) oltre che il riconoscimento allo scrivente di far parte, come detto, dell'EIOPA-IRSG presso la sede di Francoforte dell'EIOPA dall'Ottobre 2013 in qualità di "academic".

ALTRE ATTIVITÀ (NAZIONALI ED INTERNAZIONALI)

- Dal 1983 è iscritto all'Albo Nazionale degli Attuari.
- Dal 1985 è Socio effettivo dell'Istituto Italiano degli Attuari.
- Dal 1990 è Socio dell'Associazione Internazionale degli Attuari.
- Dal 1990 è Socio delle sezioni ASTIN e AFIR della International Actuarial Association.
- Dal 1998 al 2002 è stato segretario generale dell'Istituto Italiano degli Attuari.
- Dal 1999 al 2009 è stato membro della Commissione di Formazione Attuariale Permanente, istituita dall'Istituto Italiano degli Attuari, dal Consiglio Nazionale degli Attuari e dal Consiglio dell'Ordine degli Attuari.
- Dal novembre 1999 al maggio 2003 è stato presidente della SIFA, società appositamente costituita dall'Istituto Italiano degli Attuari e dal Consiglio dell'Ordine degli Attuari per curare la formazione e l'aggiornamento sulle materie assicurative ed attuariali.
- Sindaco effettivo di Sanpaolo Vita S.p.A. nel triennio 2002-2004.
- Dal 2003 al 2018 è stato membro del Consiglio Direttivo dell'Istituto Italiano degli Attuari ricoprendo la carica di Vice Presidente dal 2007 al 2018.
- Dal 2003 al 2011 è stato membro nominato e tesoriere dell'ASTIN Committee, laddove l'ASTIN rappresenta la sezione Non-Life Insurance dell'IAA (International Actuarial Association).
- Dal 2003 al 2009 è stato membro del Consiglio dell'Ordine degli Attuari.
- Dal 2004 è membro del Solvency Sub-Committee della IAA (International Actuarial Association).
- Dal 2005 è membro della Commissione Interconsiliare Assicurazioni Danni, istituita dall'Istituto Italiano degli Attuari, dal Consiglio Nazionale degli Attuari e dal Consiglio dell'Ordine degli Attuari.
- Dal 2006 al 2011 è stato membro del Comitato Didattico-Scientifico Solvency II istituito presso l'ANIA.
- Dal 2007 al 2012 è stato membro del Working Group Internal Models istituito dal Groupe Consultatif Actuariel Europeen.
- Dal 2009 al 2013 è stato membro dell'AFIR-ERM Committee, laddove l'AFIR-ERM costituisce la sezione del Financial Risk ed Enterprise Risk Management nell'ambito della IAA-International Actuarial Association (membro nominato dalla presidenza della stessa IAA).
- Nell'ottobre 2013 è stato nominato dal Supervisory Board dell'EIOPA (European Insurance and Occupational Pensions Authority) membro dell'IRSG (Insurance & Reinsurance Stakeholder Group) istituito presso la sede di Francoforte della stessa EIOPA in qualità di "academic".
- Membro della Giuria per l'attribuzione del Premio Attuariato SCOR-Italia dal 2003 e Presidente della Giuria dal 2017.

PRODUZIONE SCIENTIFICA PRINCIPALE

MONOGRAFIE

- N. Savelli:
A Risk-theory model as a tool in evaluating the solvency of a life insurance office
Final Report to "Fondazione Mario Gasbarri – Alleanza Assicurazioni", dicembre 1991, Helsinki
- N. Savelli:
Un modello di Teoria del rischio per la valutazione della solvibilità di una compagnia di assicurazioni sulla vita,
Edizioni LINT, 1993, Trieste (pag. 1-220)
- N. Savelli:
Modelli per schemi pensionistici a prestazioni definite con capitalizzazione individuale,
Edizioni Kappa, 1995, Roma (pag. 1-103)
- N. Savelli, G.P.Clemente:

Lezioni di Matematica Attuariale delle Assicurazioni Danni
 EduCatt 2014, Milano (pag. 1-184)

- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Lezioni di Teoria del Rischio per le Assicurazioni
 Ed. McGraw-Hill, 2014, (pag. 1-450), in corso di pubblicazione

ARTICOLI

- N. Savelli:
 L'introduzione delle riserve di equilibrio tecnico in Italia: riflessi sulla solvibilità e sul risultato di esercizio di una compagnia danni,
 Atti V Congresso Nazionale degli Attuari, ottobre 1992, Firenze
- N. Savelli:
 La valutazione del Capital-at-Risk di una compagnia di assicurazioni sulla vita,
 Atti V Congresso Nazionale di Scienza delle Assicurazioni, 1-3 dicembre 1996, Torino
- N. Savelli:
 Capital at Risk and return on capital in life reinsurance strategies with risk premium basis,
 Proceedings 1st International Congress on "Insurance: Mathematics and Economics", August 1997, Amsterdam
- N. Savelli:
 A Capital at Risk approach for life reinsurance strategies on risk-premium basis,
 Transactions 26th International Congress of Actuaries (vol. 4), 7-12 June 1998, Birmingham;
- N. Savelli:
 La riserva di equilibrio tecnico per le assicurazioni danni: un modello di teoria del rischio per la sua regolamentazione,
 Rivista di Diritto ed Economia dell'Assicurazione, n. 1/1998, Milano
- N. Savelli:
 I fondi pensione negli Stati Uniti: i problemi attuali sulla loro sostenibilità,
 Rivista INPDAP, n. 5/1998, Roma
- N. Savelli:
 A Simulation Model for Solvency and Reinsurance Analysis in General Insurance,
 in (a cura di) B.V.Frosini "Metodi Statistici per la Finanza e le Assicurazioni", Ed. Vita e Pensiero, 2002 Milano
- N. Savelli:
 Risk analysis of a non-life insurer and traditional reinsurance effects on the solvency profile,
 Proceedings 6th Congress on Insurance: Mathematics & Economics, July 2002, Lisbon;
- N. Savelli:
 A Risk Theoretical Model for Assessing the Solvency Profile of a General Insurer,
 - 34th ASTIN International Colloquium, 25-27 August 2003, Berlin
 - XXX GIRO Convention – Institute & Faculty of Actuaries, 14-16 October 2003, Cardiff
- N. Savelli:
 Management simulation models e Solvibilità nelle assicurazioni danni,
 Atti del VI Congresso di Scienza e Tecnica delle Assicurazioni, 18-20 gennaio 2004, Bologna
- M. Rytgaard, N. Savelli:
 Risk-Based Capital Requirements for Property and Liability Insurers according to different Reinsurance Strategies and the Effect on Profitability
 35th ASTIN International Colloquium, 6-9 June 2004, Bergen
 8th International Conference on "Insurance: Mathematics & Economics", 14-16 June 2004, Rome
- L. Ballotta, N. Savelli:
 Risk-Based Capital Modelling for P&C Insurers and financial sensitivity,
 36th ASTIN International Colloquium, 4-7 September 2005, Zurich
- L. Ballotta, N. Savelli:
 Dynamic Financial Analysis and Risk-Based Capital for a General Insurer,
 Transactions 28th International Congress of Actuaries, 28 May / 2 June 2006, Paris.
- N. Savelli:
 Solvency II project and Risk Capital Modelling for the Underwriting Risk of Property and Casualty Insurers,
 Statistica Applicata - Italian Journal of Applied Statistics, Vol. 18 n.3, 2008, pag. 685-714.
- N. Savelli:
 Solvency II e Risk Management, (invited lecture)
 Atti VIII Congresso Nazionale degli Attuari, Settembre 2007 (Trieste).
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Livelli di assorbimento del capitale sulle assicurazioni danni: il nuovo scenario prospettato da Solvency II,
 Rivista "Assicurazioni", Anno LXXV n.1, gennaio-marzo 2008 (pag. 41-91).
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Modelling Aggregate Non-Life Underwriting Risk: Standard Formula vs Internal Model

38th ASTIN International Colloquium 2008 (Manchester UK)

18th AFIR International Colloquium 2008 (Rome IT)

UK-GIRO Convention 2008 (Sorrento IT)

e pubblicato in Numero speciale del "Giornale dell'Istituto Italiano degli Attuari" del 2009 in merito agli Atti dell'International AFIR Colloquium 2008 tenutosi a Roma.

- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Hierarchical Structures in the Aggregation of Premium Risk for Insurance Underwriting,
 39th ASTIN International Colloquium, 1-4 June 2009, Helsinki.
 Scandinavian Actuarial Journal (2011/3), pag. 193-213, Ed. Taylor & Francis, London
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 A Collective Risk Model for Outstanding Claims Reserve Distribution,
 in Transactions International Congress of Actuaries (ICA), 7-12 March 2010, Cape Town, South Africa.
 e in (a cura di) E. Badolati "XVI Convegno Teoria del Rischio – Università degli Studi del Molise, 18 settembre 2009", Ed. Loffredo Editore Napoli, 2010 (pag. 59-87).
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Stochastic Claim Reserving based on CRM for Solvency II purposes,
 40th ASTIN International Colloquium, 19-22 June 2011, Madrid.
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 A Risk-Theory model to assess the capital requirement for mortality and longevity risk,
 15th International Congress IME (Insurance: Mathematics and Economics), 14-17 June 2011, Trieste.
 e pubblicato in Journal of Interdisciplinary Mathematics, Vol. 16 (2013), No. 6, pp. 397-429, Ed. Taru Publications – Taylor&Francis, New Delhi
- N. Savelli, G.P. Clemente:
 Internal model techniques for non-life underwriting risk
 5th International Conference – MAF 2012 (Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Science and Finance), 10-12 April 2012, Venice (in corso di pubblicazione presso Springer-Verlag).
- G.P. Clemente, N. Savelli, D. Zappa:
 Modelling and calibration for non-life underwriting risk: from empirical data to risk capital evaluation,
 41st ASTIN International Colloquium, 1-4 October 2012, Mexico City.
- G.P. Clemente, N. Savelli, D. Zappa:
 Modelling Premium Risk for Solvency II: from empirical data to risk capital evaluation,
 International Congress of Actuaries, March 2014, Washington.
- N. Savelli, G.P. Clemente, D. Zappa:
 The Impact of Reinsurance Strategies on Capital Requirements for Premium Risk in Insurance Risks,
 pag. 164-182, 2015.
- G.P. Clemente, N. Savelli:
 Actuarial Improvements of Standard Formula for Non-life Underwriting Risk,
 in "Insurance Regulation in the European Union – Solvency II and Beyond", Edited by P. Marano-M. Siri, Palgrave Macmillan, 2017.
- G.P. Clemente, N. Savelli, G. Schena, D. Zappa:
 Assessing safety loadings for policyholders' clusters in non-life insurance pricing,
 DySES 2018: Systemic Risk, October 9-12, 2018 – Paris, France.