

## CURRICULUM ATTIVITÀ SCIENTIFICA E DIDATTICA

**NICOLINO ETTORE D'ORTONA**

### **Formazione:**

Laurea in Scienze Economiche e Sociali – Università degli Studi del Molise

Dottorato di ricerca in Scienze Attuariali – Università di Roma “La Sapienza”

Assegno di Ricerca biennale in Scienze Attuariali – Università di Roma “La Sapienza”

### **Status:**

Professore Associato di Metodi Matematici per l'economia e le scienze attuariali e finanziarie dal 1 novembre 2001 presso l'Università degli Studi del Sannio (BN). Afferisce al Consiglio Unico dei Corsi di Studio in Scienze Statistiche e Attuariali (SSA) del Dipartimento di Diritto Economia, Management e Metodi Quantitativi (DEMM).

### **Attività didattica:**

Attualmente Titolare della cattedra di Teoria del Rischio presso il Corso di laurea magistrale in SSA e Supplente sulla cattedra di Matematica attuariale e laboratorio di calcolo attuariale presso il Corso di laurea in SSA.

In passato ha coperto diversi insegnamenti dell'area attuariale e finanziaria erogati dai CdS in SSA, tra i quali: Matematica Finanziaria e laboratorio di calcolo finanziario, Economia e Finanza delle imprese di assicurazioni, Statistica assicurativa, Tecnica attuariale delle assicurazioni contro i danni, Tecnica attuariale delle assicurazioni sulla vita. Ha tenuto per supplenza e per due anni il corso di matematica finanziaria presso l'Universitas Mercatorum di Roma.

### **Incarichi istituzionali:**

Attualmente componente della Commissione paritetica docenti-studenti del Dipartimento DEMM e Componente del Gruppo Assicurazione della Qualità dei CdS SSA.

Nei diversi anni accademici di attività ha svolto le funzioni di:

- Presidente del Corso di laurea specialistica in Scienze Statistiche e Attuariali (classe 91/s)
- Presidente del Consiglio Unico dei Corsi di Studi in Scienze Statistiche e Attuariali (Classi L41 e LM83)
- Componente del Consiglio di Amministrazione dell'Università del Sannio
- Componente del Senato Accademico dell'Università del Sannio
- Delegato del Rettore a componente della commissione di orientamento di Ateneo
- Delegato del Rettore a referente dei progetti di Servizio Civile
- Responsabile della Qualità del Dipartimento DEMM
- Direttore della Biblioteca del Dipartimento DEMM
- Membro del Collegio dei Docenti del Dottorato in “Persone, Mercati e Istituzioni” del DEMM
- Membro del Collegio dei Docenti del Dottorato Scuola di Scienze Statistiche, curriculum in scienze attuariale dell'Università di Roma "La Sapienza".
- Componente di commissione di concorso per ricercatore e per professore associato
- Componente di commissioni di ammissione e di esame finale per il dottorato
- Componente di commissione di Esame di Stato per l'abilitazione alla professione di Attuario

### **Attività scientifica:**

L'attività scientifica si colloca prevalentemente nello sviluppo di alcune tematiche relative alle scienze finanziarie ed attuariali. Nell'ambito della Tecnica Attuariale delle Assicurazioni sulla Vita e delle Assicurazioni contro i Danni, si è affrontato in via prevalente il tema della solvibilità dell'impresa di assicurazioni. Nell'ambito della Tecnica Attuariale delle Assicurazioni Sociali è stato approfondito il tema della solvibilità degli schemi di previdenza complementare, tramite l'impiego integrato dei modelli attuariali classici e dei modelli finanziari. Infine, nell'ambito della Economia e della Finanza delle Assicurazioni è stata sperimentata la capacità classificatoria dei principali modelli per la valutazione della affidabilità economico-finanziaria delle imprese di assicurazioni, fondati sulle tecniche dell'analisi statistica multivariata.

I principali lavori riguardano l'argomento della riassicurazione con forme tradizionali o con schemi di tipo finanziario.

E' stato coordinatore locale di progetto PRIN. Ha coordinato progetti di ricerca finanziati con fondi di Ateneo per la ricerca (FRA).

Elenco delle pubblicazioni:

- D'Ortona, N.E., 2022, La riassicurazione finanziaria delle riserve sinistri per il controllo della solvibilità con approccio going concern, Vol. 1, ISBN-13 : 979-8371639240.
- D'Ortona, N. E., 2021, Sul controllo della solvibilità di un portafoglio di sinistri a riserva, ramo danni, mediante schemi riassicurativi di swap, ISBN-13 : 979-8791954824.
- D'Ortona, N.E., Marcarelli, G., Melisi, G., 2020, Loss portfolio transfer treaties within Solvency II capital system: a reinsurer's point of view, in Insurance Markets and Companies, vol. 11.
- D'Ortona, N.E., 2018, La verifica di adeguatezza delle basi tecniche e la coerenza delle tariffe R.C. Auto. Riflessioni sul quadro normativo e regolamentare, Youcanprint, Lecce, Vol.1.
- D'Ortona, N.E., 2019, Sulla riassicurazione finanziaria delle riserve sinistri mediante schemi di swap, Vol.1, ISBN-13 : 978-8831654777.
- D'Ortona, N.E., 2017, Problemi di Ottimizzazione nei Trattati Loss Portfolio Transfer, Youcanprint, Lecce, Vol. 1.
- D'Ortona, N, Melisi, G., 2016, Comparison of the claims reserves methods by analyzing the run-off error, in Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations, vol.7.
- D'Ortona, N.E., Marcarelli, G, 2016, Optimal proportional reinsurance from the point of view of cedent and reinsurer, in Scandinavian Actuarial Journal, n. 4.
- D'Ortona, N.E., Staffa, Ms., 2016, The theoretical surrender value in life insurance, in Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations.
- D'Ortona, N.E., 2015, L'immunizzazione finanziaria classica in ipotesi di mercati obbligazionari eterogenei, Libellula Edizioni, Vol. 1.
- D'Ortona, N, Melisi, G., 2014, Run-off error in the outstanding claims reserves evaluation, Springer International Publishing AG, in Mathematical and Statistical Methods for Actuarial Sciences and Finance.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., Tripodi, A., 2013, Optimal Reinsurance Programs Bearing Demographic and Financial Risks, in Mathematical Methods in Economics and Finance, n.1.
- D'Ortona, N.E., 2012, Sul rischio di sottostima della riserva sinistri, Youcanprint, Tricase.
- D'Ortona, N.E., Marcarelli, G., 2012, Insurer's optimal reinsurance programs, in Dynamics of Socio-Economics Systems, Vol. 3.
- D'Ortona, N.E., 2012, Il prezzo teorico di riscatto nelle assicurazioni sulla vita, Youcanprint, Tricase.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., Marcarelli, 2011, G, Optimal reinsurance programs for a portfolio of life annuities, in Insurance Markets and Companies: Analyses and Actuarial Computations, Vol. 2.
- D'Ortona, N.E., 2008, Sulla Base Tecnica delle polizze index-linked con funzioni di partecipazione alfa-quantile, in Metodi, Modelli e Tecnologie dell'Informazione a supporto delle decisioni, Franco Angeli, Milano.
- D'Ortona, N.E., 2006, Sul problema della riassicurazione, in Atti del XXX Convegno AMASES, Trieste.
- D'Ortona, N.E., 2006, Modelli di partecipazione e garanzie alfa-quantili in prodotti assicurativi sulla durata di vita con prestazioni di tipo linked, in Metodi, modelli e tecnologie dell'informazione a supporto delle decisioni, FrancoAngeli, Milano.
- D'Ortona, N.E., Ottaviani, R., 2006, Il mercato delle rendite vitalizie per la previdenza complementare: problematiche e soluzioni, in La previdenza complementare in Italia, ed. IL MULINO, Bologna.
- D'Ortona, N.E., 2006, Il metodo di Fisher e Lange per la Stima della Riserva Sinistri, in Atti del Convegno "Metodi matematici e statistici per l'analisi dei dati assicurativi e finanziari", Università di Salerno.
- D'Ortona, N.E., Greco, L., 2006, Considerazioni sulla base tecnica esprime il rischio finanziario nelle polizze con prestazioni collegate ai quantili di un indice azionario, in Annali della Facoltà di Economia, Edizioni Scientifiche Italiane, Napoli.

- D'Ortona, N.E., 2004, Studio di una polizza vita con prestazioni collegate ai quantili di un indice azionario, in *Metodi matematici e statistici per l'analisi dei dati assicurativi e finanziari*, CUSL, Fisciano (SA), Vol. 1.
- D'Ortona, N.E., 2004, Sulla ripartizione di rischi correlati tra imprese di assicurazione, in *Annali della Facoltà di Economia*, Edizioni Scientifiche Italiane, Napoli, Vol. 10
- D'Ortona, N.E., 2004, Sulla vantaggiosità dei trattati di riassicurazione, in *Annali della Facoltà di Economia*, Edizioni Scientifiche Italiane, Napoli, Vol. 10.
- D'Ortona, N.E., 2004, Gli errori di run-off nei procedimenti di stima delle riserve sinistri, in *Atti del X Convegno di Teoria del Rischio*, ESI, Napoli.
- D'Ortona, N.E., 2004, Sul rischio di sottostima della riserva sinistri, in *La gestione delle assicurazioni. Nuovi modelli e strategie*, Congresso Nazionale Attuari, IIA, Roma.
- D'Ortona, N.E., 2003, Sui trattati di trasferimento delle riserve sinistri, in *Annali della Facoltà di Economia*, ESI, Napoli.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 2002, Un'analisi della rischiosità di un fondo pensioni a contributo definito, in *Annali della Facoltà di Economia*, ESI, Napoli, Vol. 6.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., Ottaviani, R., 2001, Modelli per il controllo dei bilanci delle imprese di assicurazioni, XXII Convegno UMI, Ischia.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1999, La simulazione nella valutazione delle passività di un fondo pensioni, in *Annali della Facoltà di Economia*, Edizioni Scientifiche Italiane, Napoli, Vol. 5
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1999, Alcune considerazioni sul rischio finanziario e demografico nella gestione di un fondo pensioni, *Convegno di Teoria del Rischio*, Università del Molise, Campobasso.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1998, Sulla variabilità degli oneri di un Fondo Pensioni, in *Atti XXII Convegno A.M.A.S.E.S.*, Ed. Bozzi, Genova.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1997, Strategie riassicurative bilaterali: un modello per la R.C. Auto, in *Atti XXI Convegno A.M.A.S.E.S.*, Ed. Colombo, Roma, Vol. 1.
- D'Ortona, N., De Angelis, P., 1997, Strategie riassicurative bilaterali: considerazioni sulla riassicurazione dei rischi con distribuzioni di tipo poisson-composto, *Scritti in onore di G. Ottaviani*, Roma.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1996, Alcune considerazioni sui problemi di ottimizzazione nell'ambito della riassicurazione dei rischi, in *Quaderni del Dipartimento di Scienze Attuariali e Finanziarie*, Università degli Studi "La Sapienza", Roma, Vol. 3.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1996, Quelques considérations sur les problèmes de l'optimum dans la réassurance des risques, *Proceedings XXVII International ASTIN Colloquium*, Copenhagen.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1996, Politiche di ritenzione ottimali nell'ambito degli schemi riassicurativi lineari con vincoli di mercato, *Atti XX Convegno A.M.A.S.E.S.*, Urbino.
- D'Ortona, N.E., De Angelis, P., 1996, Sul problema bilaterale di ritenzione ottima dei rischi negli schemi riassicurativi, *Atti Giornata di Studio su "La valutazione del rischio nella gestione delle imprese finanziarie ed assicurative"*, Università del Molise, Campobasso.
- D'Ortona, N., De Angelis, P., 1994, Strategie riassicurative per il controllo del rischio d'impresa: una breve rassegna, *Convegno di teoria del Rischio*, Università del Molise, Campobasso.