



Denise Callari

Nationalità: Italiana Data di nascita: 06/01/1990

☎ Numero di telefono: (+39) 3662041534 ✉ Indirizzo e-mail: denisecallari@gmail.com

✉ Indirizzo e-mail: denise.callari@uniroma1.it

📍 Abitazione: Via Tommaso Inghirami 85, 00179 ROMA (Italia)

ESPERIENZA LAVORATIVA

Funzionario - Funzione Attuariale

Gruppo Assicurativo Poste Vita [06/2020 – Attuale]

Città: Roma

Coordinamento del calcolo delle riserve tecniche del business Danni;

Parere sulla politica di sottoscrizione e di riassicurazione;

Contributo al sistema di gestione dei rischi con riferimento alla modellizzazione dei rischi sottesi al calcolo del requisito patrimoniale e alle valutazioni ORSA;

Contributo alle valutazioni dei metodi e delle ipotesi sottostanti la determinazione degli USP e della qualità dei dati utilizzati nel calcolo.

Senior Associate

Pricewaterhousecoopers Actuarial Services [01/2019 – 06/2020]

Città: Roma

Attività di revisione attuariale delle riserve tecniche (Local GAAP e Solvency II) e del requisito patrimoniale di solvibilità (Formula Standard, USP) per diversi Gruppi e Compagnie di Assicurazione del business Danni;

Attività di consulenza per l'implementazione del Principio contabile IFRS 17 per Gruppi Assicurativi del business Danni e Vita.

Qualifica di Esperto Attuariale presso il Servizio Ispettorato

IVASS - Istituto per la vigilanza sulle assicurazioni [10/2016 – 01/2019]

Città: Roma

Accertamenti ispettivi presso Gruppi e Compagnie di Assicurazione del business Danni e Vita mirati alla verifica e alla valutazione dei requisiti quantitativi di Pillar I secondo Formula Standard Solvency II (analisi degli attivi, dei modelli di ESG, della politica ALM, dei rischi di mercato, di credito e tecnici per il calcolo del SCR, delle ipotesi tecniche sottostanti il calcolo delle BEL) e qualitativi di Pillar III (analisi della modellizzazione delle ipotesi sottostanti alle relazioni SFCR, RSR e ORSA inclusa la valutazione sull'adeguatezza degli stress test e sulla robustezza del giudizio esperto utilizzato). Inoltre, accertamenti ispettivi sulla Formula Standard USP (valutazione della qualità dei dati, analisi del modello teorico e dell'algoritmo di calcolo, verifica delle ipotesi statistiche sottostanti gli USP).

Tirocinante del Servizio Vigilanza Prudenziale

IVASS - Istituto per la vigilanza sulle assicurazioni [02/2016 – 10/2016]

Città: Roma

Conoscenza della Direttiva europea Solvency II e supporto al processo di valutazione prudenziale del modello interno di uno dei principali gruppi assicurativi europei, con riferimento all'analisi della metodologia e della modellistica adottata per la misurazione e gestione dei rischi di mercato e del relativo requisito patrimoniale.

Collaboratore presso lo Studio Micocci & Partners

Numerica Risk - Attuariato e Finanza [11/2015 – 02/2016]

Città: Roma

Analisi del profilo di rischio degli investimenti sottostanti polizze vita multiramo per conto di uno dei principali gruppi assicurativi europei e predisposizione della relativa rendicontazione periodica agli assicurati anche tramite programmazione in VBA.

ISTRUZIONE E FORMAZIONE

Dottoranda in "Management, Banking and Commodity Sciences"

Sapienza Università di Roma - Facoltà di Economia - Dipartimento di Management [10/2022 – Attuale]

Indirizzo: Roma

Campi di studio: Banking and Finance

Dottorato di Ricerca in "Management, Banking and Commodity Sciences" con curriculum bancario-finanziario. Particolare focus sulle metodologie e tecniche di ricerca al fine di fronteggiare le sfide in ambito finanza sostenibile e criteri Environmental, Social, and Corporate Governance (ESG) .

Laureata in "Finanza e Assicurazioni" (FINASS classe LM-16)

Sapienza Università di Roma - Facoltà di Economia [09/2012 – 10/2015]

Indirizzo: Roma

Tesi in "Finanza matematica", sotto la supervisione della Prof.ssa M. Chiarolla con Voto: 110/110 e Lode

Titolo tesi "GOP-Numeraire Pricing of Titanic Options in a Variable Annuity Contract"

Competenze quantitative e conoscenze economico-giuridiche di ambito finanziario e assicurativo per: la modellizzazione matematica e il pricing di obbligazioni strutturate e di strumenti finanziari derivati; la valutazione e gestione di portafogli finanziari e assicurativi; la misurazione del rischio di credito ed il pricing degli strumenti di hedging; la misurazione del capitale di rischio in ottica Solvency II.

Attestato di frequenza - Matlab e Simulink per il calcolo scientifico

SCSM - Scuola di calcolo scientifico con Matlab [07/2015]

Indirizzo: Università degli Studi di Palermo - Facoltà di Ingegneria, Palermo

Introduzione alla programmazione e ai fondamenti del calcolo scientifico: calcolo matriciale, interpolazione numerica, differenziazione e integrazione numerica, soluzione numerica di equazioni differenziali ordinarie.

Borsa di studio Erasmus presso la Stockholm University

Sapienza Università di Roma - Facoltà di Economia [01/2014 – 07/2014]

Indirizzo: Stoccolma

Conoscenze delle principali tecniche econometriche per l'analisi quantitativa in ambito economico e finanziario acquisite attraverso la simulazione e l'analisi di fenomeni reali in laboratorio (pacchetti statistici R e STATA).

Laurea triennale in "Economia, finanza e diritto per la gestione d'impresa" (Scienze aziendali)

Sapienza Università di Roma - Facoltà di Economia [09/2008 – 07/2012]

Indirizzo: Roma

Tesi in "Economia dell'Organizzazione Industriale"

Titolo tesi: "La competitività del Sistema Finanziario: regolamentazione bancaria tra stabilità e concorrenza"

COMPETENZE LINGUISTICHE

Lingua madre: **italiano**

Altre lingue:

inglese

ASCOLTO B2 LETTURA C1 SCRITTURA C1

PRODUZIONE ORALE B2 INTERAZIONE ORALE C1

COMPETENZE DIGITALI

Matlab / Excel e VBA / Software R

COMPETENZE ORGANIZZATIVE

Competenze organizzative

Autonomia, proattività e attitudine al problem solving;

Ottime capacità di analisi e a lavorare contemporaneamente su diversi task sviluppate durante l'attività ispettiva e di consulenza.

COMPETENZE COMUNICATIVE E INTERPERSONALI

Competenze comunicative e interpersonali.

Spiccate capacità a lavorare in team acquisite durante la carriera universitaria e successivamente sviluppate durante l'attività ispettiva e di consulenza.

ALTRE COMPETENZE

Altre competenze

- Impegno, determinazione e passione;
- Mobilità geografica sul posto di lavoro.

Autorizzo il trattamento dei miei dati personali presenti nel CV ai sensi dell'art. 13 d. lgs. 30 giugno 2003 n. 196 - "Codice in materia di protezione dei dati personali" e dell'art. 13 GDPR 679/16 - "Regolamento europeo sulla protezione dei dati personali".

Roma, 15/04/2023