

Calculer les besoins assureurs sur la base de modélisation des facteurs de risques

Code
157

Durée
1 jour / 7 heures

Tarif Inter*
1 267 € HT

PROCHAINES SESSIONS

- **PARIS :**
5 juin. 2024
- **A DISTANCE :**
5 juin. 2024
- **PARIS :**
4 nov. 2024
- **A DISTANCE :**
4 nov. 2024

[🔗 Voir toutes les sessions](#)

PUBLIC

Actuaires - Managers et collaborateurs des fonctions ALM et trésorerie - Relation Institutionnels - Analystes ALM - Risk managers - Conformité - Consultants SSII dans le secteur de l'assurance - Agents généraux - Banquiers privés

PRÉ-REQUIS

La participation à cette formation requiert d'avoir de solides connaissances mathématiques, une bonne maîtrise d'excel et une première expérience sur le sujet

NIVEAU D'EXPERTISE

Expertise

MOYENS PÉDAGOGIQUES

- Dispositif de formation structuré autour du transfert des compétences
- Acquisition des compétences opérationnelles par la pratique et l'expérimentation
- Apprentissage collaboratif lors des moments synchrones
- Parcours d'apprentissage en plusieurs temps pour permettre engagement, apprentissage et transfert
- Formation favorisant l'engagement du participant pour un meilleur ancrage des enseignements

SATISFACTION ET EVALUATION

- L'évaluation des compétences sera réalisée tout au long de la formation par le participant lui-

*Repas inclus (en présentiel)

Objectifs pédagogiques

- Décortiquer les modalités de calcul des sous-modules de SCR bruts de marché et de contrepartie
- Décomposer les facteurs de risque sur les fonds et les produits complexes, les montages avec couverture
- Calculer les besoins quantitatifs des assureurs
- Sensibiliser sur les évolutions à venir de la revue « 2020 » de Solvabilité 2 et ses impacts sur les placements et les risques de marché
- Mettre en évidence les grandes différences réglementaires entre un assureur Solvabilité 2 et un FRPS IORP2

Programme de la formation

Décortiquer les modalités de calcul des sous-modules de SCR bruts de marché et de contrepartie

Lister les calculs

- Taux d'intérêt, action (type 1/2/infrastructure QII & QICI/LTEI/Private Equity), spread (dont infrastructure), devise et immobilier
- Besoins annexes pour le sous-module SCR brut de contrepartie
- Exemples

Etudier les causes et effets des dispositifs de correction des risques

- Dampener
- Prime contra-cyclique
- Matching adjustment
- Exemple de calculs

Décomposer les facteurs de risque sur les fonds, les produits complexes, les montages avec couverture

Déterminer les besoins quantitatifs des assureurs auprès des sociétés d'asset management auprès desquelles ils détiennent des fonds

- Architecture des données attendues par les assureurs
- Pour réaliser les calculs
- Pour alimenter le reporting du Pilier 3 (QRT et rapports narratifs)
- Exemples

même (auto-évaluation) et/ou le formateur selon les modalités de la formation.

- Evaluation de l'action de formation en ligne sur votre espace participant :
 - ▶ A chaud, dès la fin de la formation, pour mesurer votre satisfaction et votre perception de l'évolution de vos compétences par rapport aux objectifs de la formation. Avec votre accord, votre note globale et vos verbatims seront publiés sur notre site au travers d'Avis Vérifiés, solution Certifiée NF Service
 - ▶ A froid, 60 jours après la formation pour valider le transfert de vos acquis en situation de travail
- Suivi des présences et remise d'une attestation individuelle de formation ou d'un certificat de réalisation

Calculer les besoins quantitatifs des assureurs

Évaluer le SCR sur des actifs financiers complexes

- Le cas d'une obligation convertible en action
- Etude de cas : un fonds diversifié avec couverture

Intégrer ORSA

- Rappel de ses objectifs
- Compensation des limites du SCR
- Prise en compte de la tolérance au risque
- Introduction d'une vision prospective (durabilité, vision « going concern » versus « run-off »)
- Dispositif de gouvernance
- Etude de cas : exemples d'indicateurs susceptibles d'être suivis en matière de gestion des actifs

Sensibiliser sur les évolutions à venir de la revue « 2020 » de Solvabilité 2 et ses impacts sur les placements et les risques de marché

- Mettre en évidence les grandes différences réglementaires entre un assureur Solvabilité 2 et un FRPS IORP2
- Brainstorming : Comparaison des règles de comptabilisation et de solvabilité entre Solvabilité 2 et FRPS (Loi Sapin2/IORP2)

Parmi nos formateurs



Lionel Texier

Actuaire

Après une expérience dans le marketing et la distribution, Lionel a travaillé cinq ans dans les directions techniques de compagnies d'assurance en France et au Luxembourg où il a effectué des travaux d'actuariat Vie et Non-Vie. Depuis dix ans, il accompagne les assureurs en tant que consultant.