

CALCUL DE LA VALEUR ÉCONOMIQUE DES ENGAGEMENTS EN ASSURANCE-VIE : BONNES PRATIQUES



1 jour

Fiche d'inscription sur www.caritat.fr

Épargne – Retraite - Vie

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et autres collaborateurs des directions techniques et financières des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, de l'audit et du conseil.

Pour obtenir quoi ?

Faire le point sur le calcul des "best estimates" en assurance-vie en s'attachant à décrire le cadre de valorisation imposé par le régulateur, les méthodes de calcul qui en découlent et leur mise en œuvre opérationnelle compte tenu des contraintes imposées par les outils informatiques, les données et le cadre conceptuel lui-même.

Comment ?

Les apports théoriques alternent, tout au long du stage, avec des travaux pratiques d'application réalisés sur « R ».

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances de base en statistique.

! Chaque participant se munira d'un ordinateur portable pour les travaux pratiques.

Qui anime cette formation ?

Jean-Paul FELIX,
Responsable RISK Architecture & Reporting
au sein de la direction Risques
de BNP Paribas Cardif.



Quentin GUIBERT, actuaire qualifié, docteur en sciences de gestion, post-doctorant au LSAF, consultant chez PRIM'ACT.

Qu'allez-vous apprendre ?



Solvabilité 2 impose une évaluation « économique » des engagements ; cela se traduit en pratique par la nécessité de calculer la « meilleure estimation » (**best estimate**) des engagements.

L'utilisation d'un cadre d'absence d'opportunité d'arbitrage (AOA) rend, en assurance-vie, le calcul particulièrement délicat.

La journée de formation sera l'occasion de faire le point sur ces notions et leur mise en œuvre opérationnelle.

Les points suivants y seront plus particulièrement développés :

- La notion de « meilleure estimation »
- Le cadre général de la « valorisation économique » et les conséquences de l'hypothèse d'AOA
- Calculer un **best estimate** en présence d'interactions actif / passif : quel modèle pour calculer la valeur des options incluses dans les contrats ?
- La prise en compte des risques non répliquables, comme le risque de longévité ou certains risques financiers.

Cette formation est proposée en partenariat avec



La formation en pratique...

Quand et où ?

16 novembre 2016

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30
Caritat, Paris 8°

Combien ça coûte ?

1 220 € HT + TVA 20 %, soit 1 464 € TTC.
Les frais de participation couvrent la journée de formation, la documentation complète, le déjeuner et les pauses café.

Où vous loger ?

Si vous venez de province ou de l'étranger, pour toute réservation d'hôtel, contactez notre partenaire :
Elysées West Hôtel - 01 47 75 92 90 - www.ewh.com.
Précisez que vous venez de la part de Caritat.

Contact :

01 44 51 04 00

Mail :

info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.