

CONSTRUIRE UN GÉNÉRATEUR DE SCÉNARIOS ÉCONOMIQUES



1 jour

Bulletin de participation
sur www.caritat.fr

Thèmes transversaux

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 ?

Comprendre l'utilité des générateurs de scénarios économiques. Connaître les méthodes de construction. Maîtriser les paramètres des modèles. Savoir utiliser un générateur de scénarios dans le contexte Solvabilité II / IFRS.

Comment ?

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

Quels sont les prérequis ?

Connaissances de base en statistique.

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

Qui anime cette formation ?

Frédéric PLANCHET, actuaire agréé, docteur en sciences de gestion, professeur à l'ISFA, associé au cabinet PRIM'ACT.



Montassar TAMMAR, (ISFA) Actuaire IA associé, consultant chez PRIM'ACT depuis 2013.



Sugiban RATNASTHY, (ISFA), consultant chez PRIM'ACT depuis 2013.



La formation en pratique...

Quand et où ?

8 octobre 2018

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 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 85 34 72 00
Précisez que vous venez de la part de Caritat.
<http://elysees.hotusa.com/caritat/>

Qu'allez-vous apprendre ?



Introduction : Pourquoi mettre en place un ESG (Générateur de scénarios économiques) ?

- Le rôle d'un ESG, quel contexte, que peut-on en attendre ?
- Les approches risque-neutre (calculs de provisions) et historique (ORSA et ALM)
- Les points d'attention majeurs
- Les principes de construction, d'estimation et de mise en œuvre
- Discussion sur la structure de dépendance entre les risques

Exemple numéro 1 : un GSE « risque neutre »

- La structure du modèle
- Le calibrage des paramètres
- Le choix du modèle de taux en période de taux négatifs

Exemple numéro 2 : un GSE « historique »

- La structure du modèle
- Le calibrage des paramètres
- Quelle articulation avec le GSE « risque neutre » dans le cadre de l'ORSA ?

01 44 51 04 00
info@caritat.fr

Qu'en disent les stagiaires ?

« Les explications des formateurs étaient absolument claires avec la présentation bien structurée. Grâce à une discussion, Monsieur PLANCHET a résolu un problème qui était resté dans ma tête avant ce cours. Merci beaucoup ! »

WWW, Actuaire indépendant

« Excellente connaissance du sujet et bon rythme (bon panorama des problématiques avec focus sur des exemples concrets). »

GD, Responsable LPI – HSBC

« Formateurs agréables, communicants et pédagogues. »

AG, Actuaire Gestion Actif-Passif – CARAC

Cette formation est proposée en partenariat avec



SIRET 477 962 690 00020

5 rue Tronchet - 75008 Paris
Tél. : 01 44 51 04 00 - Fax : 01 44 51 04 09
www.caritat.fr