

PRISE EN COMPTE DU RISQUE OPÉRATIONNEL DANS L'EXERCICE DE L'ORSA



2 jours

Fiche d'inscription
sur www.caritat.fr

Thèmes communs à toutes les branches



À qui s'adresse cette formation ?

A tous ceux :

- qui contribuent à l'établissement du plan multi annuel
- qui contribuent à l'agrégation des risques dans l'exercice de l'ORSA
- qui travaillent sur le registre des risques, sur le risque opérationnel et son évaluation.

Pour obtenir quoi ?

Une compréhension du poids du risque opérationnel dans la gestion des risques.

Une approche des meilleures pratiques dans ce domaine.

Un benchmark aisé à effectuer.

Comment ?

La combinaison d'une présentation de la théorie, des pratiques et outils du marché et une application pratique sur un cas réel.

Quels sont les pré-requis ?

Une connaissance générale de la directive solvabilité II et des techniques de simulations, ainsi que de la notion de MCEV, et des normes IFRS.

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

Qui anime cette formation ?

Jean-Marie NESSI

Consultant en risque et Président de la Commission de Qualification de l'Institut des Actuaire.



Xavier MILHAUD

Co-responsable de la voie actuariat de l'ENSAE ParisTech, membre qualifié de l'Institut des Actuaire



Qu'allez-vous apprendre ?

Introduction : la chaîne des risques dans l'assurance

Le plan dynamique à 3 ans et l'ORSA

- La gestion du risque de couverture
- Le poids du risque opérationnel
- L'arbitrage et prévention

La gestion des risques et du risque opérationnel

- Cartographie et taxonomie
- Registre des risques
- Base incidents

Cas pratique : la mesure du risque par simulation en approche Bayésienne

- Scénarii à dire d'expert
- Simulation de scénario
- Distribution du risque opérationnel

Cas pratique : la méthode de réplcation par base incidents

- Base incidents marché
- Tarification par Poisson Pareto
- Comparaison avec la formule standard

Conclusion

- Nécessité d'une approche benchmark ou 4 yeux

Contact :
01 44 51 04 00

La formation en pratique...

Quand et où ?

19 et 20 novembre 2015

9 h 00 - 12 h 30 et 14 h 00 - 17 h 30
Caritat, Paris 8°

Combien ça coûte ?

2 000 € HT + TVA 20%, soit 2 400 € TTC.

Les frais de participation couvrent les journées de formation, la documentation complète, les déjeuners 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.
Demandez le tarif Caritat.

Qu'en disent les stagiaires ?

Cette formation est une nouveauté du catalogue Caritat.