

CORRÉLATIONS, DÉPENDANCE, DIVERSIFICATION : COMMENT Y VOIR CLAIR...



1 jour

Fiche d'inscription sur www.caritat.fr

Méthodes et outils d'Actuariat

À qui s'adresse cette formation ?

Aux actuaires et autres collaborateurs des services techniques et bureaux d'études des sociétés d'assurance et de réassurance, des mutuelles et institutions de prévoyance, du courtage, de l'audit et du conseil, et à toute personne désireuse de comprendre ou approfondir la notion de dépendance entre risques.

Pour obtenir quoi ?

Connaître les principales mesures de risques et mesures de dépendance entre les risques dans un portefeuille d'assurance, dans le nouvel environnement Solvabilité 2.

Comment ?

Les apports théoriques sont complétés par des travaux pratiques d'application sous Excel.

Quels sont les pré-requis ?

Connaissances générales en statistique.

Contact :
01 44 51 04 04

Qui anime cette formation ?

Arthur CHARPENTIER, professeur assistant à l'Université de Rennes, professeur associé à l'École Polytechnique, docteur en mathématiques (KUL), membre agrégé de l'Institut des Actuaires.



La formation en pratique...

Quand et où ?

Dates en cours de programmation

9 h - 12 h 30 et 14 h - 17 h 30
Lieu à préciser (Paris centre)

Combien ça coûte ?

1 190 € HT + TVA 19,60%, soit 1 423,24 € 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.
Demandez le tarif Caritat.

Qu'allez-vous apprendre ?

Dépendance entre risques et Solvabilité 2

- Mesures de risque (VaR, TailVaR et mesures par distorsion)
- Risque d'un portefeuille

Présentation des copules : séparer la dépendance et le comportement marginal

- Introduction générale
- Principales familles de copules
- Grands risques et corrélation. Introduction aux extrêmes

Mesures de dépendance : corrélations de rangs et dépendance de queue

- Corrélation linéaire et corrélation de rangs
- Corrélation entre événements extrêmes

Estimation de copules, quelques aspects statistiques

- Estimation de paramètres
- Tests d'ajustement

Méthodes de simulation en grande dimension

- Méthode de Monte Carlo
- Quasi Monte Carlo

Mesurer les risques dans un portefeuille

- Primes de Tchen et Value at Risk
- Recherche de bornes sur le risque d'un portefeuille

Quantification de l'impact de la diversification

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

Qu'en disent les stagiaires ?

« Formation très intéressante et très bien animée. Mises en pratique enrichissantes. »

Sabrina L., GAN Eurocourtage Vie

« Excellent pédagogue qui maîtrise son sujet. »

Fabien R., MUTUALITÉ FRANÇAISE

« Très bonne présentation des copules, claire et bien détaillée. Très bonne pédagogie avec beaucoup de pratique. »

Harry S., AGF Vie